



PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

# Halbjahresbericht

30. Juni 2023



ALLGEMEINE KENNDATEN

**Fondstyp:**

OGAW

**Anzahl an Fonds der Gesellschaft:**

56 Fonds

**Zum 30. Juni 2023 angebotene Anteilklassen der Gesellschaft:\***

**Institutional**

Institutional AUD (Hedged)  
 Institutional BRL (Hedged)  
 Institutional CAD (Hedged)  
 Institutional CHF (Hedged)  
 Institutional CHF (Partially Hedged)  
 Institutional CZK (Hedged)  
 Institutional EUR (Currency Exposure)  
 Institutional EUR (Hedged)  
 Institutional EUR (Partially Hedged)  
 Institutional EUR (Unhedged)  
 Institutional GBP (Currency Exposure)  
 Institutional GBP (Hedged)  
 Institutional GBP (Partially Hedged)  
 Institutional GBP (Unhedged)  
 Institutional HKD (Unhedged)  
 Institutional ILS (Hedged)  
 Institutional JPY (Hedged)  
 Institutional MXN (Hedged)  
 Institutional NOK (Hedged)  
 Institutional NOK (Partially Hedged)  
 Institutional NZD (Hedged)  
 Institutional PLN (Hedged)  
 Institutional RMB (Hedged)  
 Institutional SEK (Hedged)  
 Institutional SGD (Hedged)  
 Institutional USD (Currency Exposure)  
 Institutional USD (Hedged)

**Investor**

Investor AUD (Hedged)  
 Investor CAD (Hedged)  
 Investor CHF (Hedged)  
 Investor EUR (Hedged)  
 Investor EUR (Unhedged)  
 Investor GBP (Hedged)  
 Investor JPY (Hedged)  
 Investor NOK (Hedged)  
 Investor RMB (Hedged)  
 Investor SEK (Hedged)  
 Investor SGD (Hedged)  
 Investor USD (Hedged)

**Administrative**

Administrative AUD (Hedged)  
 Administrative CHF (Hedged)  
 Administrative EUR (Hedged)  
 Administrative GBP (Hedged)  
 Administrative HKD (Unhedged)  
 Administrative JPY (Hedged)  
 Administrative SEK (Hedged)  
 Administrative SGD (Hedged)

**BE Retail**

BM Retail

BM Retail AUD (Hedged)

BM Retail USD (Hedged)

**BN Retail**

**E Class**

E Class AUD (Hedged)

E Class AUD (Partially Hedged)

E Class CHF (Hedged)

E Class EUR (Currency Exposure)

E Class EUR (Hedged)

E Class EUR (Partially Hedged)

E Class EUR (Unhedged)

E Class GBP (Hedged)

E Class GBP (Partially Hedged)

E Class HKD (Unhedged)

E Class JPY (Hedged)

E Class NOK (Hedged)

E Class RMB (Hedged)

E Class SGD (Hedged)

E Class SGD (Partially Hedged)

E Class USD (Currency Exposure)

E Class USD (Hedged)

G Retail EUR (Hedged)

G Retail EUR (Unhedged)

**H Institutional**

H Institutional EUR (Hedged)

H Institutional USD (Currency Exposure)

H Institutional USD (Hedged)

**M Retail**

M Retail AUD (Hedged)

M Retail HKD (Unhedged)

M Retail SEK (Hedged)

M Retail SGD (Hedged)

M Retail USD (Hedged)

**N Retail**

**R Class**

R Class AUD (Hedged)

R Class EUR (Hedged)

R Class GBP (Hedged)

**T Class**

T Class EUR (Hedged)

T Class USD (Hedged)

**W Class**

W Class CAD (Hedged)

W Class CHF (Hedged)

W Class EUR (Hedged)

W Class GBP (Hedged)

W Class NOK (Hedged)

W Class SEK (Hedged)

W Class SGD (Hedged)

W Class USD (Currency Exposure)

**Z Class**

Z Class AUD (Hedged)

Z Class EUR (Hedged)

Z Class GBP (Hedged)

**Anteilsarten:**

Innerhalb jeder Klasse darf die Gesellschaft, vorbehaltlich der jeweiligen Ergänzung, ausschüttende Anteile (Gewinne ausschüttende Anteile), thesaurierende Anteile (Gewinne thesaurierende Anteile) und/oder Ausschüttend-II-Anteile (Anteile, die eine höhere Rendite erzielen sollen) ausgeben.

**Nettovermögen (Angaben in Tausend):**

158.304.274 USD

**Mindestbestand:**

Die Mindestbeteiligung für die Anteilklassen Institutional, Investor, Administrative, H Institutional und W Class liegt bei 500.000 USD oder dem Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilklasse. Die Mindestbeteiligung für die Anteilklassen BE Retail Class, BM Retail Class, BN Retail Class, E Class, G Retail, M Retail, N Retail, R Class und T Class liegt bei 1.000 USD oder bei Bedarf beim Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilklasse. Die Mindestbeteiligung für

**Für den Teilfonds Income Fund II wurde kein Vertriebsanzeigeverfahren gemäß § 310 KAGB bei der deutschen Finanzmarktaufsichtsbehörde („BaFin“) durchgeführt. Anteile an diesem Teilfonds dürfen daher nicht in Deutschland vertrieben werden.**

## ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

die Z-Klassen liegt bei 20 Mio. USD oder dem Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse. Die Pacific Investment Management Company LLC („PIMCO“) ist nach eigenem Ermessen befugt, auf das Erfordernis der Mindestanfangszeichnung und des Mindestbestandes gemäß dem aktuellen Verkaufsprospekt zu verzichten.

### **Handelstag:**

Für einen Fonds bezeichnet er den Tag oder die Tage, die die jeweilige Ergänzung zu diesem Fonds vorgibt, wobei es alle vierzehn Tage mindestens einen Handelstag geben muss. Der Verwaltungsrat hat PIMCO die Befugnis erteilt, die Häufigkeit der Handelstage je Fonds zu ändern. Jegliche Änderung an der Häufigkeit der Handelstage erfordert die vorherige Zustimmung der Verwahrstelle. Dies wird den Anteilinhabern des/der betroffenen Fonds im Voraus mitgeteilt.

Ungeachtet der vorangehenden Ausführungen ist ein Tag für einen Fonds kein Handelstag, wenn es entweder aufgrund von Feiertagen oder einer Markt- bzw. Börsenschließung in jeglichem Rechtsgebiet schwierig ist, (i) einen Fonds zu verwalten oder (ii) einen Teil des Fondsvermögens zu bewerten. Anteilinhaber und potenzielle Anleger können weitere Einzelheiten über geplante Schließungen von Fonds während des Jahres beim Administrator erfragen oder sie im Feiertagskalender der Fonds finden (eine Kopie desselben kann beim Administrator angefordert werden).

### **Funktionswährung der Fonds:**

USD (\$), mit Ausnahme der Fonds UK Corporate Bond Fund und UK Long Term Corporate Bond Fund, die auf Pfund Sterling (£) lauten, sowie der Fonds Dynamic Multi-Asset Fund, Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro, Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, Euro Short-Term Fund, PIMCO European High Yield Bond Fund und PIMCO European Short-Term Opportunities Fund, die auf Euro (€) lauten.

## ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

### Zulassung in Hongkong:

Die Gesellschaft und bestimmte ihrer Fonds sind von der Securities and Futures Commission in Hongkong („SFC“) zugelassen und unterliegen den Anforderungen des von der SFC herausgegebenen Code on Unit Trusts and Mutual Funds („Code“). Derzeit können die folgenden Fonds Finanzderivate zu Anlagezwecken, zur Absicherung und/oder zur effizienten Portfolioverwaltung erwerben. Der Einsatz von Finanzderivaten erfolgt vorbehaltlich der voraussichtlichen Höchstgrenzen im überarbeiteten Code, wie nachstehend aufgeführt. Die Einstufung der Fonds entweder als Derivatfonds oder als Nicht-Derivatfonds ist ebenfalls nachstehend angegeben. Es gibt keine Änderungen zum Einsatz von Finanzderivaten durch die folgenden Fonds:

Fonds	Erwartetes maximales Nettoengagement in Derivaten (% des Nettoinventarwerts)	Einstufung des Fonds
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	bis zu 50 %	Nicht-Derivatfonds
Asia Strategic Interest Bond Fund	bis zu 50 %	Nicht-Derivatfonds
Commodity Real Return Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Diversified Income Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Emerging Local Bond Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Emerging Markets Bond Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Global Bond Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Global High Yield Bond Fund	bis zu 50 %	Nicht-Derivatfonds
Global Investment Grade Credit Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Global Real Return Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Income Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Income Fund II	bis zu 50 %	Nicht-Derivatfonds
Low Average Duration Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
Total Return Bond Fund	mehr als 100 %	Derivatfonds
US High Yield Bond Fund	bis zu 50 %	Nicht-Derivatfonds

Die folgenden Fonds sind in Hongkong nicht zugelassen und für Einwohner von Hongkong nicht erhältlich:

PIMCO Capital Securities Fund  
 PIMCO Climate Bond Fund  
 PIMCO Credit Opportunities Bond Fund  
 Diversified Income Duration Hedged Fund  
 Diversified Income ESG Fund  
 Dynamic Bond Fund  
 Dynamic Multi-Asset Fund  
 Emerging Local Bond ESG Fund  
 Emerging Markets Bond ESG Fund  
 Emerging Markets Corporate Bond Fund  
 PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund  
 PIMCO ESG Income Fund  
 Euro Bond Fund  
 Euro Credit Fund  
 Euro Income Bond Fund  
 Euro Long Average Duration Fund  
 Euro Short-Term Fund  
 PIMCO European High Yield Bond Fund  
 PIMCO European Short-Term Opportunities Fund  
 Global Advantage Fund  
 Global Bond ESG Fund  
 Global Bond Ex-US Fund  
 PIMCO Global Core Asset Allocation Fund  
 Global Investment Grade Credit ESG Fund  
 Global Low Duration Real Return Fund  
 Inflation Multi-Asset Fund  
 Low Duration Global Investment Grade Credit Fund  
 Low Duration Income Fund  
 Low Duration Opportunities Fund  
 Low Duration Opportunities ESG Fund  
 PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund  
 Mortgage Opportunities Fund  
 PIMCO StocksPLUS™ AR Fund  
 StocksPLUS™ Fund  
 Strategic Income Fund

PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund  
 UK Corporate Bond Fund  
 UK Long Term Corporate Bond Fund  
 US Investment Grade Corporate Bond Fund  
 US Short-Term Fund

### Zulassung in Singapur

Diese Fonds werden von der Monetary Authority of Singapore gemäß dem Securities and Futures Act, Kapitel 289 von Singapur, nicht anerkannt und stehen Privatanlegern in Singapur nicht zur Verfügung:

PIMCO Credit Opportunities Bond Fund  
 Diversified Income ESG Fund  
 Emerging Local Bond ESG Fund  
 Emerging Markets Bond ESG Fund  
 PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund  
 Euro Credit Fund  
 Euro Income Bond Fund  
 Euro Long Average Duration Fund  
 Euro Short-Term Fund  
 PIMCO European High Yield Bond Fund  
 PIMCO European Short-Term Opportunities Fund  
 Global Bond ESG Fund  
 Global Investment Grade Credit ESG Fund  
 Global Low Duration Real Return Fund  
 Low Duration Opportunities Fund  
 Low Duration Opportunities ESG Fund  
 PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund  
 Mortgage Opportunities Fund  
 PIMCO StocksPLUS™ AR Fund  
 PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund  
 UK Corporate Bond Fund  
 UK Long Term Corporate Bond Fund  
 US Short-Term Fund

### Reuters-Seite:

PAFPPLC

™ Eingetragenes Warenzeichen oder Warenzeichen der Pacific Investment Management Company LLC in den USA und/oder sonstigen Ländern.



	Seite
Marktkennnisse*	4
Wichtige Angaben zu den Fonds	5
Beschreibungen der Vergleichsindizes	68
Finanzstatus	74
Betriebsergebnisrechnung	94
Ausweis der Nettovermögensänderungen	114
Aufstellung des Wertpapierbestands	120
Erläuterungen zum Abschluss	738
Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung	798
Glossar	856
Allgemeine Informationen	858

FONDS	Fonds- überblick*	Aufstellung des Wertpapierbestands
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	7	120
Asia Strategic Interest Bond Fund	8	129
PIMCO Capital Securities Fund	9	137
PIMCO Climate Bond Fund	11	145
Commodity Real Return Fund	12	153
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	13	163
Diversified Income Fund	14	172
Diversified Income Duration Hedged Fund	16	189
Diversified Income ESG Fund	17	199
Dynamic Bond Fund	18	206
Dynamic Multi-Asset Fund	19	223
Emerging Local Bond Fund	20	234
Emerging Local Bond ESG Fund	21	250
Emerging Markets Bond Fund	22	258
Emerging Markets Bond ESG Fund	23	274
Emerging Markets Corporate Bond Fund	24	288
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	25	296
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	26	310
PIMCO ESG Income Fund	27	321
Euro Bond Fund	28	333
Euro Credit Fund	29	341
Euro Income Bond Fund	30	347
Euro Long Average Duration Fund	31	356
Euro Short-Term Fund	32	362
PIMCO European High Yield Bond Fund	33	367
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	34	373
Global Advantage Fund	35	379
Global Bond Fund	36	397
Global Bond ESG Fund	38	422
Global Bond Ex-US Fund	39	439
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	40	455
Global High Yield Bond Fund	41	468
Global Investment Grade Credit Fund	42	478
Global Investment Grade Credit ESG Fund	44	499
Global Low Duration Real Return Fund	45	513
Global Real Return Fund	46	521
Income Fund	47	531
Income Fund II	49	569
Inflation Multi-Asset Fund	50	576
Low Average Duration Fund	51	585
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	52	593
Low Duration Income Fund	53	602

FONDS	Fonds- überblick*	Aufstellung des Wertpapierbestands
Low Duration Opportunities Fund	54	616
Low Duration Opportunities ESG Fund	55	627
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	56	630
Mortgage Opportunities Fund	57	633
StocksPLUS™ Fund	58	642
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	59	649
Strategic Income Fund	60	654
Total Return Bond Fund	61	671
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	62	684
UK Corporate Bond Fund	63	700
UK Long Term Corporate Bond Fund	64	707
US High Yield Bond Fund	65	713
US Investment Grade Corporate Bond Fund	66	721
US Short-Term Fund	67	731

Dieser Halbjahresbericht kann in andere Sprachen übersetzt werden. Diese Übersetzungen dürfen ausschließlich dieselben Informationen wie der englischsprachige Halbjahresbericht enthalten und müssen dieselbe Bedeutung haben. Soweit zwischen dem englischsprachigen Halbjahresbericht und dem Halbjahresbericht in einer anderen Sprache Abweichungen bestehen, hat der englischsprachige Halbjahresbericht Vorrang, es sei denn, es ist in irgendeinem Rechtsgebiet, in dem die Anteile verkauft werden, gesetzlich vorgeschrieben, dass bei einer Klage, die auf Angaben in einem Halbjahresbericht in einer anderen Sprache als Englisch beruht, die Sprache des Halbjahresberichts, auf der diese Klage beruht, maßgeblich ist. Etwaige Streitigkeiten bezüglich der Bedingungen des Halbjahresberichts unterliegen unabhängig von der Sprache des Halbjahresberichts irischem Recht und werden in Übereinstimmung mit diesem ausgelegt.

\* In diesem Dokument sind die Ansichten der Gesellschaft enthalten. Diese Ansichten können sich ohne Vorankündigung ändern. Dieses Material wurde ausschließlich zu Informationszwecken verteilt. Prognosen, Schätzungen und bestimmte hierin enthaltene Informationen beruhen auf firmeneigenem Research und sollten nicht als Anlageberatung oder Empfehlung eines bestimmten Wertpapiers, einer bestimmten Strategie oder eines bestimmten Anlageprodukts erachtet werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. Die hierin enthaltenen Informationen wurden aus Quellen bezogen, die als verlässlich erachtet werden. Eine diesbezügliche Garantie wird jedoch nicht abgegeben. Kein Teil dieses Dokuments darf ohne ausdrückliche schriftliche Zustimmung in jedweder Form reproduziert werden, und es ist ebenso untersagt, in anderen Veröffentlichungen darauf Bezug zu nehmen. PIMCO ist in den USA und weltweit eine Marke von Allianz Asset Management of America LLC. ©2023, PIMCO

### Sehr geehrte Anteilhaber,

Dieser Halbjahresbericht behandelt den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 (der „Berichtszeitraum“). Auf den folgenden Seiten finden Sie Einzelheiten zu den Anlageergebnissen sowie eine Erörterung der Faktoren, die die Wertentwicklung während des Berichtszeitraums beeinflussten.

Vor dem Hintergrund einer erhöhten Inflation in vielen Ländern während des Berichtszeitraums sah sich die Weltwirtschaft mit Herausforderungen konfrontiert, die auf höhere Zinssätze, verschärfte Kreditbedingungen aufgrund der Turbulenzen im Bankensektor (insbesondere in den Vereinigten Staaten („USA“) und geopolitische Sorgen zurückzuführen waren. Während die US-Wirtschaft Anzeichen von Widerstandsfähigkeit zeigte, verzeichneten einige europäische Volkswirtschaften im Berichtszeitraum ein langsames Wachstum.

### Anhaltende Maßnahmen der Zentralbanken zur Bekämpfung der Inflation

Während die Inflation während des Berichtszeitraums weiterhin hoch blieb, hoben viele Zentralbanken die Zinssätze an, um die steigenden Preise einzudämmen. Die US-Notenbank Federal Reserve (die „Fed“) hob den Leitzins bei zehn aufeinanderfolgenden Sitzungen an, und zwar von März 2022 bis Mai 2023. Im Juni 2023 setzte die Fed dann die Zinsanhebung aus, um „weitere Informationen und ihre Auswirkungen auf die Geldpolitik zu beurteilen“. Indes hoben die britische Zentralbank Bank of England und die Europäische Zentralbank die Zinssätze zum 13. bzw. achten Mal in Folge zum Juni 2023 an. Im Gegensatz dazu behielt die japanische Zentralbank Bank of Japan ihre expansive Geldpolitik bei.

### Gemischte Renditen an den Finanzmärkten

Die Rendite der maßgeblichen 10-jährigen US-Staatsanleihen sank im Berichtszeitraum, wohingegen die Renditen 10-jähriger Anleihen in den meisten anderen Industrieländern stiegen. Insgesamt erzielte der globale Markt für Kreditanleihen positive Gesamtergebnisse. Globale Anleihen mit höherem Rating entwickelten sich schlechter als Anleihen mit niedrigerem Rating. Während sich die globalen Aktien im Höhenflug befanden, waren die Rohstoffpreise volatil und erzielten gemischte Renditen. Der US-Dollar verlor gegenüber dem Euro und dem britischen Pfund an Wert, gewann dagegen jedoch gegenüber dem japanischen Yen an Wert.

Angesichts der sich fortlaufend verändernden Bedingungen arbeiten wir weiterhin unermüdlich daran, uns auf den Märkten zu orientieren und die Vermögenswerte zu verwalten, die Sie uns anvertraut haben. Bitte sprechen Sie mit Ihrem Finanzberater über Ihre Ziele und besuchen Sie die Website [global.pimco.com](http://global.pimco.com), um sich über unsere neuesten Erkenntnisse zu informieren.

Mit freundlichem Gruß



Craig A. Dawson  
Vorsitzender

Gesamtergebnisse bestimmter Anlageklassen für den Berichtszeitraum bis zum 30. Juni 2023	
Anlageklasse (gemessen am, Währung)	Sechsmonatszeitraum
US-Large-Cap-Aktien (S&P 500 Index, USD)	16,89 %
Globale Aktien (MSCI World Index, USD)	15,09 %
Europäische Aktien (MSCI Europe Index, EUR)	11,12 %
Schwellenländeraktien (MSCI Emerging Markets Index, EUR)	4,89 %
Japanische Aktien (Nikkei 225 Index, JPY)	28,65 %
Lokale Anleihen von Schwellenländern (JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index, USD Unhedged)	7,79 %
Auslandsschulden von Schwellenländern (JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, USD Hedged)	3,81 %
Anleihen mit einem Rating unter dem Investment Grade (ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged)	5,45 %
Kreditanleihen mit Investment Grade (Bloomberg Global Aggregate Credit Index, USD Hedged)	3,00 %
Festverzinsliche Staatsanleihen in Lokalwährung der Investment-Grade-Länder (Bloomberg Global Treasury Index, USD Hedged)	3,13 %

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit bietet keine Garantie für künftige Ergebnisse. Sofern nichts Anderweitiges angegeben ist, spiegeln Indexrenditen die Wiederanlage etwaiger Ertragsausschüttungen und Kapitalgewinne wider; Gebühren, Maklerprovisionen und sonstige Anlagekosten bleiben jedoch unberücksichtigt. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

Aussagen zu Finanzmarktrends sind auf aktuellen Marktbedingungen begründet, die schwanken können. Es kann nicht garantiert werden, dass diese Anlagestrategien unter allen Marktbedingungen funktionieren oder für alle Anleger geeignet sind. Alle Anleger sollten insbesondere in Zeiten eines Marktabschwungs hinterfragen, ob sie auch langfristig anlegen können. Ausblick und Strategien können sich ohne Vorankündigung ändern.

## Wichtige Angaben zu den Fonds

Dieses Dokument darf nur mit dem aktuellen Prospekt von PIMCO Funds: Global Investors Series plc verwendet werden. Anleger sollten vor einer Anlage in den Fonds deren Anlageziele, Risiken, Gebühren und Auslagen sorgfältig prüfen. Diese und andere Informationen sind im Verkaufsprospekt enthalten. Bitte lesen Sie den Verkaufsprospekt sorgfältig, bevor Sie eine Anlage tätigen oder Gelder anweisen.

Nach unserer Überzeugung spielen Anleihe-Fonds in einem gut gefächerten Anlageportfolio eine wichtige Rolle. Es gilt jedoch zu beachten, dass in einem Umfeld, in dem die Zinssätze einer Aufwärtstendenz folgen können, steigende Zinsen einen negativen Einfluss auf die Wertentwicklung der meisten Anleihe-Fonds haben und die von einem Fonds gehaltenen Rentenpapiere voraussichtlich an Wert verlieren. Die Kursschwankungsintensität von Rentenpapieren kann in Zeiten steigender Zinsen ebenfalls zunehmen und dadurch zu erhöhten Verlusten für die Fonds führen. Anleihe-Fonds und einzelne Anleihen mit einer längeren Duration (Maß für die mittlere Restlaufzeit eines Wertpapiers) neigen zu stärkeren Reaktionen auf Zinssatzänderungen, was sie gewöhnlich schwankungsanfälliger macht als Wertpapiere oder Fonds mit kürzeren Durationen. Die längerfristige Wertentwicklung der meisten Anleihe-Fonds hat von den Kapitalgewinnen profitiert, die sich zum Teil aus einem längeren Zeitraum fallender Zinsen ergeben. Bei steigenden Zinsen ist nicht davon auszugehen, dass diese Kapitalgewinne wiederkehren.

Die Fonds können zusätzlich zu den vorstehend, im Verkaufsprospekt der Fonds und im Abschnitt „Finanzrisiken“ in den Erläuterungen zum Abschluss beschriebenen Risiken weiteren Risiken unterliegen. Bei einigen dieser Risiken kann es sich unter anderem um folgende handeln: Realzinsrisiko, Derivatrisiko, die mit kleinen Unternehmen, Auslandswertpapieren und Hochzinsspapieren verbundenen Risiken, die mit einem bestimmten Sektor einhergehenden Anlagerisiken und die Risiken in Verbindung mit einer Epidemie/Pandemie. Die Fonds dürfen zu Absicherungszwecken oder als Teil einer Anlagestrategie derivative Instrumente verwenden. Der Einsatz dieser Instrumente kann mit bestimmten Kosten und Risiken einhergehen, wie zum Beispiel Liquiditätsrisiko, Zinssatzrisiko, Marktrisiko, Kreditrisiko, Verwaltungsrisiko und dem Risiko, dass ein Fonds eine Position nicht dann glattstellen kann, wenn es für ihn am vorteilhaftesten wäre. Fonds, die in derivative Instrumente anlegen, können einen höheren Betrag als den in diese Instrumente angelegten Kapitalbetrag verlieren. Anlagen in Auslandswerten können Risiken bergen, die von den ausländischen wirtschaftlichen und politischen Entwicklungen abhängen. Dieses Risiko kann bei Anlagen in Schwellenmärkten steigen. Hochzinsanleihen erhalten grundsätzlich eine niedrigere Bonitätsbewertung als andere Anleihen. Anleihen mit niedrigerem Rating sind in der Regel in Bezug auf das Anleihekapital mit einem höheren Risiko behaftet als höher bewertete Anleihen. Kleinere Unternehmen können schwankungsanfälliger als größere Unternehmen und deshalb mit einem höheren Risiko verbunden sein. Auch die Konzentration von Anlagen auf einzelne Sektoren kann im Gegensatz zu einem diversifizierten Fonds mit einem zusätzlichen Risiko und einer zusätzlichen Volatilität einhergehen.

Einige Fonds können eine SGU-Anlagestrategie (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) verfolgen, gemäß derer Wertpapiere bestimmter Emittenten in der Regel aus anderen Gründen als der Wertentwicklung ausgewählt oder ausgeschlossen werden. Diese Strategie birgt das Risiko, dass sich die Wertentwicklung eines Fonds von ähnlichen Fonds, die keine SGU-Anlagestrategie verfolgen, unterscheidet. Diese Strategie könnte sich etwa auf das Engagement eines Fonds in bestimmten Bereichen oder Anlagearten auswirken und somit negative Folgen für die Wertentwicklung eines Fonds mit sich bringen. Es gibt keine Garantie dafür, dass die vom Anlageberater angewendeten Faktoren die Meinungen eines bestimmten Anlegers widerspiegeln; diese vom Anlageberater angewendeten Faktoren können von denjenigen abweichen, die ein bestimmter Anleger bei der Beurteilung der SGU-Praktiken eines Emittenten für relevant hält. Zukünftige SGU-Entwicklungen und -Regulierungen können die Umsetzung der Anlagestrategie eines Fonds beeinflussen. Darüber hinaus können sich Kosten aus SGU-bezogenen Due Diligence-Prüfungen, vermehrten Berichterstattungen und der Inanspruchnahme externer SGU-Datenanbieter ergeben.

Die Klassifizierung der Portfoliopositionen eines Fonds in diesem Bericht erfolgt gemäß den Vorschriften für die Finanzberichterstattung. Die Einstufung einer bestimmten Portfolioposition im Abschnitt mit der Aufstellung des Wertpapierbestands in diesem Bericht kann von der Einstufung abweichen, die für die Compliance-Berechnungen eines Fonds verwendet wird. Dies gilt unter anderem für diejenigen, die jeweils im Verkaufsprospekt, in den Anlagezielen oder in aufsichtsrechtlichen und anderen Anlagebeschränkungen und -richtlinien des Fonds verwendet werden, welche gegebenenfalls auf anderen Klassifizierungen in Bezug auf Anlageklassen, Sektoren oder geografische Regionen beruhen können. Alle Fonds werden bezüglich der Einhaltung der im Verkaufsprospekt sowie in maßgeblichen Vorschriften enthaltenen Anforderungen separat überwacht. In der Aufstellung des Wertpapierbestands können bestimmte Portfoliobestände zusammengefasst werden, wenn die Anlagen dieselben Attribute (Anleihezins und Fälligkeitstermine) aufweisen.

Die geografischen Klassifizierungen von Wertpapieren in diesem Bericht richten sich nach dem Gründungsland des jeweiligen Unternehmens. Unter bestimmten Umständen kann das Gründungsland eines Wertpapiers vom Land, in dem es wirtschaftlich engagiert ist, abweichen.

Bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investieren kann, stützen sich gegebenenfalls in bestimmter Weise auf den London Interbank Offered Rate („LIBOR“). Der LIBOR ist ein durchschnittlicher Zinssatz, den die ICE Benchmark Administration bestimmt und den sich Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel berechnen. Angesichts der schrittweisen Einstellung der Nutzung des LIBOR müssen sich die entsprechenden Fonds auf einen anderen Vergleichsindex umstellen (z. B. des Secured Overnight Financing Rate (SOFR), der den USD-LIBOR ersetzen soll, und mit dem die Kosten von Übernachtskrediten in Form von mit US-Schatzpapieren besicherten Pensionsgeschäften gemessen wird). Die möglichen Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR auf einen Fonds oder auf bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investiert, lassen sich gegebenenfalls nur schwer ermitteln, und sie können abhängig von diesen Faktoren unterschiedlich ausfallen: Der Übergang kann außerdem zu einer Verringerung des Werts bestimmter von einem Fonds gehaltener Anlagen oder zu einer Verringerung der Wirksamkeit damit verbundener Fondstransaktionen wie z.B. Absicherungen führen. Derartige Folgen des Übergangs weg vom LIBOR sowie andere unvorhergesehene Auswirkungen könnten dazu führen, dass ein Fonds Verluste erleidet.

Die Überblicksseiten der einzelnen Fonds in diesem halbjährlichen Bericht bieten eine Tabelle zur Nettowertentwicklung, in der die Wertentwicklung – davon ausgehend, dass alle Dividenden und Kapitalgewinnausschüttungen wiederangelegt wurden – gemessen wird. In den Renditen nicht berücksichtigt ist der Abzug von Steuern, die ein Anteilinhaber zahlen würde auf: (i) Ausschüttungen des Fonds; oder (ii) die Rücknahme von Fondsanteilen. In der Tabelle zur Nettowertentwicklung wird die Wertentwicklung jedes Fonds mit der Wertentwicklung eines breit angelegten Wertpapiermarktindex (Vergleichsindex) verglichen. Die frühere Wertentwicklung jedes Fonds vor und nach Steuern ist nicht unbedingt ein Indikator dafür, wie sich der Fonds in der Zukunft entwickeln wird. Anlagen in einem Fonds gelten nicht als Bankeinlagen und werden nicht von einer behördlichen Stelle verbürgt oder versichert. Der Wert der und die Einkünfte aus den Anteilen am Fonds können steigen oder sinken; eventuell erhalten Sie nicht den ursprünglich in den Fonds investierten Betrag zurück.

## Wichtige Angaben zu den Fonds (Forts.)

---

PIMCO Funds: Global Investors Series plc wird vertrieben von PIMCO Europe Ltd., 11 Baker Street, London W1U 3AH, Vereinigtes Königreich; PIMCO Europe GmbH, Seidlstraße 24-24a, 80335 München, Deutschland; PIMCO Asia Pte Ltd., 8 Marina View #30-01, Asia Square Tower 1, Singapur 018960, PIMCO Asia Limited, Suite 2201, 22nd Floor, Two International Finance Centre, 8 Finance Street, Central Hong Kong und PIMCO Australia Pty Ltd., Level 19, 5 Martin Place, Sydney, New South Wales 2000, Australien; [www.pimco.com](http://www.pimco.com).

Definierte Begriffe, die in diesem Halbjahresbericht verwendet werden und nicht anderweitig definiert sind, haben die im Prospekt der Gesellschaft genannte Bedeutung.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,79 %)	(2,81 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,79 %)	(2,79 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2021)	(0,93 %)	(13,20 %)
Investor, ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020)	(0,91 %)	(7,98 %)
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(1,03 %)	(3,27 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 01. Jul. 2020)	(1,22 %)	(6,90 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(1,23 %)	(3,66 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 2021)	(0,91 %)	(11,14 %)
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Mrz. 2021)	(1,01 %)	(11,15 %)
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(1,09 %)	(3,64 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,44 %)	(2,16 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index	1,99 %	(3,02 %) <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(2,14 %)	(12,77 %)
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2020)	(2,20 %)	(8,77 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (AUD Hedged)	0,76 %	(9,00 %) <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	(2,96 %)	(9,94 %)
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	(2,98 %)	(9,94 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	(3,41 %)	(10,74 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	(3,41 %)	(10,74 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (CHF Hedged)	(0,18 %)	(10,23 %)
<b>Auf CNH lautende Klassen</b>		
Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Okt. 2020)	(2,49 %)	(7,64 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (CNH Hedged)	0,38 %	(7,61 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	(2,04 %)	(9,16 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	(2,06 %)	(9,13 %)
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Sep. 2020)	(2,35 %)	(9,93 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	(2,47 %)	(9,94 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	(2,64 %)	(9,98 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (EUR Hedged)	0,61 %	(10,06 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jul. 2021)	(1,28 %)	(12,55 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Mai 2021)	(1,36 %)	(12,88 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (GBP Hedged)	1,37 %	(13,11 %) <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,81 %)	(3,66 %)
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,96 %)	(3,71 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (HKD Unhedged)	2,40 %	(3,05 %)
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(1,41 %)	(12,13 %)
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020)	(1,65 %)	(8,21 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(1,86 %)	(4,02 %)
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(1,92 %)	(4,02 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (SGD Hedged)	1,27 %	(3,57 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er in einen Mix aus festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten, die wirtschaftlich mit asiatischen Ländern, ausgenommen Japan, verbunden sind, sowie verbundenen Derivaten auf diese Wertpapiere investiert. Vom Fonds gekaufte Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) sind von Moody's mindestens mit C oder von S&P oder Fitch gleichwertig bewertet (oder weisen, falls sie kein Rating haben, nach Meinung der Anlageberatungsgesellschaft eine vergleichbare Qualität auf). Ausgenommen davon sind hypothekarisch gesicherte Wertpapiere, für die es kein vorgeschriebenes Mindest-Kreditrating gibt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Auswahl taktischer Unternehmensanleihen aus Nicht-Schwellenländern trug zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Die Untergewichtung der Positionierung in US-Duration trug ebenfalls zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen während des Berichtszeitraums stiegen.
- » Es gab ansonsten keine anderen Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag leisteten.
- » Die Titelauswahl im chinesischen Immobiliensektor war der relativen Wertentwicklung dagegen abträglich.
- » Die Untergewichtung des Engagements in Staatsanleihen aus den Schwellenländern Asiens schmälerte die relative Wertentwicklung, insbesondere aufgrund der Untergewichtung von sri-lankischen Staatsanleihen.
- » Die Untergewichtung der Allokation in Quasi-Staatsanleihen aus den Schwellenländern Asiens beeinträchtigte die relative Wertentwicklung.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	—	(0,50 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung 04. Sep. 2020)	1,34 %	(4,02 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	—	(0,50 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung 04. Sep. 2020)	0,81 %	(4,86 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2010)	0,97 %	2,28 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung 01. Dez. 2020)	1,59 %	(4,25 %)
JPMorgan Asia Credit Index <sup>3</sup>	2,92 %	3,10 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	—	(0,90 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Mrz. 2021)	0,13 %	(7,13 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	—	(1,00 %)
E Class EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2021)	(0,36 %)	(7,91 %)
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>	1,65 %	(6,14 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2011)	(1,34 %)	2,81 %
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Unhedged) <sup>3</sup>	0,68 %	4,13 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 13. Aug. 2021)	0,70 %	(7,82 %)
JPMorgan Asia Credit Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>	2,38 %	(6,55 %)
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 04. Sep. 2020)	1,26 %	(4,47 %)
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2011)	1,25 %	0,91 %
JPMorgan Asia Credit Index (HKD Unhedged) <sup>3</sup>	3,41 %	2,03 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	0,61 %	(4,12 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	0,26 %	(4,91 %)
JPMorgan Asia Credit Index (SGD Hedged) <sup>3</sup>	2,29 %	(3,82 %)

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Asia Strategic Interest Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 31. Mai 2016: [90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % 1-Monats-USD-Libor] \* [JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)] / [3-Monats-USD-Libor]; ab 01. Juni 2016: JPMorgan Asia Credit Index

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Asia Strategic Interest Bond Fund strebt die Erwirtschaftung attraktiver und stabiler Erträge an. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Fonds kann bis zu 50 % of seines Gesamtvermögens in hoch verzinsliche Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) investieren. Der Fonds konzentriert seine Anlagen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) in Asien, ausgenommen Japan, anlegt. Er kann jedoch bis zu ein Drittel seines Gesamtvermögens in andere Renteninstrumente (wie im Verkaufsprospekt definiert) investieren, darunter auch Papiere von staatlichen Emittenten und Unternehmen außerhalb Asiens, ausgenommen Japan.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement in Unternehmensanleihen aus Asien ohne China/Hongkong trug zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Das Engagement in Staatsanleihen von Pakistan und Sri Lanka förderte ebenfalls die absolute Wertentwicklung.
- » Auch das Engagement in asiatische Quasi-Staatsanleihen trug zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Das Engagement in Unternehmensanleihen aus China/Hongkong schmälerte jedoch die absolute Wertentwicklung, insbesondere aufgrund eines Engagements in chinesischen Immobilien.
- » Das Engagement in US-Duration schmälerte die absolute Wertentwicklung, da die Zinsen während des Berichtszeitraums stiegen.



Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	(1,18 %)	4,35 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2014)	(1,16 %)	3,42 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2014)	(1,35 %)	3,02 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	(1,36 %)	3,03 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(1,40 %)	3,76 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(1,45 %)	3,75 %
Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 12. Aug. 2022)	(1,40 %)	(3,34 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	(1,61 %)	3,11 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	(1,62 %)	2,48 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(1,63 %)	2,88 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	(1,31 %)	3,37 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(1,82 %)	2,39 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2013)	(0,80 %)	4,82 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>2</sup>	2,40 %	1,26 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	(2,11 %)	0,64 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Aug. 2015)	(1,51 %)	3,60 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,70 %	1,45 % <sup>2</sup>
<b>Auf BRL lautende Klassen</b>		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jan. 2018)	11,84 %	(1,39 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (BRL Hedged) <sup>3</sup>	15,87 %	(0,85 %)
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	(1,57 %)	1,40 %
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) <sup>4</sup>	2,25 %	1,51 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(3,18 %)	2,14 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Jun. 2014)	(3,56 %)	0,03 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>5</sup>	0,61 %	(0,69 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(2,28 %)	2,60 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(2,27 %)	2,61 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	(2,24 %)	1,51 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2016)	(2,37 %)	1,96 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(2,51 %)	2,08 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	(2,72 %)	1,42 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(2,68 %)	0,35 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	(2,31 %)	1,27 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(2,91 %)	0,39 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>6</sup>	1,34 %	(0,06 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(1,49 %)	3,38 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	(1,44 %)	3,45 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	(1,64 %)	(2,46 %)
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	(1,59 %)	2,06 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>7</sup>	2,06 %	0,77 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	(1,19 %)	1,28 %
3 Month HIBOR Index	2,20 %	1,63 %

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Capital Securities Fund strebt Engagements mit Fokus auf Capital Securities (wie im Verkaufsprospekt definiert) zusammen mit einer maximalen Gesamtrendite an, in Übereinstimmung mit der Kapitalerhaltung und umsichtigen Anlageverwaltung durch die Anlage in ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten bestehendes Portfolio (wie im Verkaufsprospekt definiert) und andere Wertpapiere, von denen gemäß den im Verkaufsprospekt des Fonds angegebenen Richtlinien mindestens 80 % in Capital Securities angelegt werden. Im Fonds werden ökologischen Merkmale beworben, jedoch kein nachhaltiges Anlageziel verfolgt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement in und die Titelauswahl vorrangiger Finanztitel trugen zur Wertentwicklung bei, da die Spreads schrumpften.
- » Die Titelauswahl bei Tier-2-Anleihen trug zur Wertentwicklung bei, da eine ausgewählte britische Bank ankündigte, dass sie ihre Legacy Tier-2-Anleihen zum nächsten Kündigungstermin zurücknehmen würde.
- » Das Engagement in AT1, die von einer Schweizer Bank begeben wurden, war der Wertentwicklung abträglich, da sie nach der Übernahme durch einen lokalen Wettbewerber abgeschrieben wurden.
- » Das Engagement in AT1 und insbesondere in britischen Banken schmälerte die Wertentwicklung, da der globale Bankenmarkt aufgrund einer Vertrauenskrise unter Druck geriet, die von kleineren regionalen US-Banken herrührte und sich bis nach Europa ausbreitete.
- » Das Engagement in einem ausgewählten nachrangigen Hybridemittenten außerhalb des Sektors Finanzen beeinträchtigte die Wertentwicklung.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum: (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(1,69 %)	(6,89 %)
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	(1,89 %)	1,22 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 12. Aug. 2022)	(1,92 %)	(3,98 %)
M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 23. Dez. 2013)	(2,06 %)	2,66 %
SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average <sup>a</sup>	1,82 %	1,22 % <sup>a</sup>

- <sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.
- <sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.
- <sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index
- <sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis zum 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR (CAD Hedged) Index; ab 01. Juli 2022: Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)
- <sup>5</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month USD LIBOR (Hedged to CHF) Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index
- <sup>6</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index
- <sup>7</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index
- <sup>8</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2020)	2,27 %	(3,66 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2023)	—	1,10 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2020)	2,46 %	(3,16 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)	3,28 %	(5,71 %) <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Apr. 2023)	—	(0,52 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (AUD Hedged)	2,35 %	0,59 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 13. Nov. 2020)	0,12 %	(6,29 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (CHF Hedged)	1,06 %	(8,52 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	1,05 %	(5,19 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Dez. 2020)	1,10 %	(5,89 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sept. 2020)	0,60 %	(6,03 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (EUR Hedged)	1,97 %	(7,32 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	1,72 %	(4,24 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2021)	1,72 %	(5,58 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (GBP Hedged)	2,73 %	(6,42 %) <sup>2</sup>
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2021)	1,11 %	(7,18 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	0,85 %	(8,65 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (SEK Hedged)	2,22 %	(9,11 %) <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	1,59 %	(4,77 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (SGD Hedged)	2,61 %	(6,73 %)

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Climate Bond Fund strebt optimale risikobereinigte Renditen bei umsichtiger Vermögensverwaltung an und berücksichtigt dabei langfristige klimabezogene Risiken und Chancen. Der Fonds verfolgt sein Anlageziel, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die schrumpfenden Spreads und der Carry in Unternehmensanleihen mit Investment Grade, insbesondere im Finanzsektor, trugen zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Die schrumpfenden Spreads und Titelauswahl bei Schuldtiteln aus Schwellenländern, insbesondere im Versorgungssektor, trugen zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Das Long-Engagement in Spreadrisiken hochverzinslicher Unternehmensanleihen, insbesondere im Sektor Automobil, war der absoluten Wertentwicklung zuträglich, da die Spreads schrumpften.
- » Das moderate Long-Engagement in US-Duration schmälerte die absolute Wertentwicklung, da die Renditen zurückgingen.
- » Das moderate Long-Engagement im vorderen und mittleren Bereich der britischen und europäischen Renditekurven belastete die absolute Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2006)	(8,91 %)	(0,76 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	(9,01 %)	(2,31 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	(9,33 %)	(2,09 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	(8,98 %)	(20,02 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return	(7,79 %)	(1,97 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2010)	(10,22 %)	(1,30 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	(10,71 %)	(3,84 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Hedged)	(9,19 %)	(2,37 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jun. 2021)	(10,94 %)	8,80 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Unhedged)	(9,86 %)	11,08 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2017)	(9,42 %)	2,83 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Hedged)	(8,38 %)	2,34 %
<b>Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Nov. 2022)	(13,82 %)	(18,14 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Unhedged)	(12,77 %)	(17,10 %)
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
E Class SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2021)	(9,90 %)	1,23 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (SGD Hedged)	(8,47 %)	5,60 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Commodity Real Return Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er in (börsennotierte oder im Freiverkehr (OTC) gehandelte) derivative Instrumente investiert. Hierbei kann es sich um Swaps, Futures, Optionen auf Futures und strukturierte Schuldverschreibungen sowie rohstoffindexgebundene Schuldverschreibungen handeln, die es ihm ermöglichen, ein Engagement in Indizes und Teilindizes (einschließlich unter anderem bei Indizes der Bloomberg Commodity-Indexfamilie) einzugehen, die sich auf Rohstoffe beziehen, die die Anforderungen der irischen Zentralbank erfüllen und gegebenenfalls von dieser freigegeben wurden. Nähere Einzelheiten zu den vom Fonds verwendeten Indizes sowie zu den Arten von Rohstoffen, auf die diese sich beziehen, sind auf Anfrage von der Anlageverwaltungsgesellschaft erhältlich. Diese Instrumente bieten ein Engagement gegenüber den Anlagerenditen der Rohstoffmärkte, ohne direkt in physische Rohstoffe zu investieren, und werden durch ein aktiv verwaltetes Portfolio mit internationalen Rentenwerten besichert (wie im Verkaufsprospekt definiert). Der Fonds kann außerdem in Stamm- und Vorzugsaktien sowie in wandelbare Wertpapiere von Emittenten in rohstoffbezogenen Branchen investieren.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Kurvenpositionierung in der britischen Breakeven-Inflationsrate, insbesondere eine Übergewichtung des 5-jährigen Bereichs der Kurve, trug zur Wertentwicklung bei, da die 5-jährigen britischen Breakeven-Inflationsraten stiegen.
- » Aktive Rohstoffstrategien, insbesondere eine Untergewichtung des Engagements im Teilssektor Erdgas, trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da der vom Bloomberg Natural Gas Subindex gemessene Teilssektor schlechter abschnitt als der breiter aufgestellte Bloomberg Commodity Index.
- » Das Engagement in hypotheckenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitle trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Spreads auf diese Wertpapiere schrumpften.
- » Die strukturelle Allokation auf globale kurzfristige inflationsgebundene Anleihen (ILB) als Sicherheiten zur Deckung des Rohstoffengagements des Fonds schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich globale kurzfristige TIPS gemessen am Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) schwächer entwickelten als die am ICE BofAML U.S. 3-Month Treasury Bill Index gemessenen 3-Monats-US-Schatzpapieren.
- » Die Untergewichtung des Engagements in nominalen japanischen Staatszinsen belastete die relative Wertentwicklung, da die nominalen Renditen in Japan zurückgingen.
- » Die Übergewichtung des Engagements in dänischen gedeckten Schuldverschreibungen war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich diese Wertpapiere unterdurchschnittlich entwickelten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	3,32 %	2,93 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	2,86 %	1,35 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>	2,40 %	1,13 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2012)	1,17 %	0,35 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>4</sup>	0,61 %	(0,66 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	2,04 %	1,58 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	1,64 %	(0,09 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>5</sup>	1,34 %	0,05 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

<sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month USD LIBOR (Hedged to CHF) Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index

<sup>5</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche langfristige Rendite erzielen. Der Fonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in Schuldtiteln mit Investment Grade begünstigte die Wertentwicklung, insbesondere das Engagement in Emittenten aus den Sektoren Banken, Immobilieninvestmentgesellschaften und Technologie, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verschmälerten.
- » Das Long-Engagement in Hochzinsanleihen begünstigte die Wertentwicklung, insbesondere das Engagement in Emittenten aus den Sektoren Bau und Unterhaltung, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verschmälerten.
- » Das Long-Engagement in ausgewählten lateinamerikanischen Währungen trug zur Wertentwicklung bei, da die Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert zulegten.
- » Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Renditen anstiegen.
- » Das Long-Engagement in ausgewählten verbrieften Vermögenswerten belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	3,10 %	5,04 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Sep. 2008)	3,05 %	5,02 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	2,94 %	2,03 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	2,94 %	2,03 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	2,82 %	3,02 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	2,19 %	(3,51 %)
BN Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Aug. 2022)	2,08 %	(3,59 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	2,62 %	4,04 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	2,57 %	4,12 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2011)	3,04 %	3,35 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Mai 2020)	3,03 %	(1,16 %)
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	2,60 %	2,88 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	2,64 %	2,00 %
N Retail, ausschüttend II (Auflegung 30. Okt. 2020)	2,67 %	(4,56 %)
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,47 %	1,31 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,43 %	1,31 %
Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	3,21 %	(3,59 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	3,11 %	(3,63 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged) <sup>3</sup>	3,96 %	4,90 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012)	1,76 %	1,98 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (AUD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (AUD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (AUD Hedged) <sup>3</sup>	2,98 %	3,01 %
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2019)	2,77 %	0,05 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (CAD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (CAD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (CAD Hedged) <sup>3</sup>	3,58 %	0,61 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	0,91 %	1,63 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	0,83 %	0,87 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Sept. 2019)	0,48 %	(4,57 %)
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,96 %	(5,79 %)
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,99 %	(5,75 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (CHF Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (CHF Hedged) und JPMorgan EMBI Global (CHF Hedged) <sup>3</sup>	1,71 %	1,80 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2007)	1,83 %	3,75 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Okt. 2007)	1,85 %	3,75 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2007)	1,66 %	3,53 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	1,65 %	0,62 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jul. 2007)	1,55 %	3,37 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jul. 2007)	1,34 %	2,99 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2009)	1,35 %	2,36 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,17 %	(0,60 %)
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,06 %	(0,61 %)

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Diversified Income Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio mit Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl bei Schuldtiteln mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, einschließlich des Engagements in ausgewählten Emittenten aus den Sektoren Bank und Transport, die überdurchschnittlich abschnitten.
- » Das taktische Engagement im Credit Derivative Index (CDX) begünstigte die Wertentwicklung, da es sich besser entwickelte als Baranleihen.
- » Die Titelauswahl bei Hochzinsanleihen war der Wertentwicklung abträglich, darunter die Übergewichtung einer ausgewählten europäischen Bank, die aufgrund einer Vertrauenskrise eine Underperformance aufwies, und die Übergewichtung eines Engagements in ausgewählten Emittenten im Sektor Medien, die eine Underperformance aufwiesen.
- » Die Titelauswahl in Schwellenländern, einschließlich des Engagements in ausgewählten chinesischen Immobilienentwicklern und in Schuldtiteln ausgewählter lateinamerikanischer Emittenten im Sektor Energie, da diese in den Erwartungen zurückblieben.
- » Das taktische Engagement in verbrieften Krediten schmälerte die Wertentwicklung, einschließlich des Engagements in hypothekenbesicherten Wertpapieren mit Agency-Schuldtiteln und ausgewählten hypothekenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere ausweiteten.



Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen  
Berichtszeitraum: (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,90 %	(5,25 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,92 %	(5,27 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (EUR Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (EUR Hedged) und JPMorgan EMBI Global (EUR Hedged) <sup>3</sup>	2,61 %	3,41 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2006)	2,60 %	4,70 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2006)	2,53 %	4,64 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	2,39 %	2,33 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,68 %	(4,30 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,68 %	(4,27 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (GBP Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (GBP Hedged) und JPMorgan EMBI Global (GBP Hedged) <sup>3</sup>	3,37 %	4,37 % <sup>2</sup>
<b>Auf JPY lautende Klassen</b>		
Administrative JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	0,12 %	(11,43 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (JPY Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (JPY Hedged) und JPMorgan EMBI Global (JPY Hedged) <sup>3</sup>	1,08 %	(8,91 %)
<b>Auf MXN lautende Klassen</b>		
Institutional MXN (Hedged), thesaurierend (Auflegung 09. Dez. 2020)	6,82 %	0,30 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (MXN Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (MXN Hedged) und JPMorgan EMBI Global (MXN Hedged) <sup>3</sup>	7,69 %	2,30 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,96 %	4,12 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Dez. 2020)	1,70 %	(7,60 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (SEK Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (SEK Hedged) und JPMorgan EMBI Global (SEK Hedged) <sup>3</sup>	2,86 %	3,78 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	2,41 %	(1,99 %)
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mai 2019)	2,18 %	(1,11 %)
E Class SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Okt. 2019)	2,08 %	(2,81 %)
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,48 %	(3,87 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (SGD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (SGD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (SGD Hedged) <sup>3</sup>	3,30 %	0,18 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Diversified Income Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 09. November 2015: jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit Component (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global; ab 10. November 2015: jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged)



# Diversified Income Duration Hedged Fund

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2011)	3,82 %	3,37 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	3,67 %	2,34 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2013)	3,42 %	1,95 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2011)	3,38 %	2,48 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged) <sup>3</sup>	5,02 %	3,26 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2011)	2,68 %	2,27 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	2,69 %	1,23 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	2,24 %	1,47 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Mai 2013)	2,19 %	0,06 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (EUR Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (EUR Hedged) und JPMorgan EMBI Global (EUR Hedged) <sup>3</sup>	3,81 %	2,32 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2011)	3,52 %	3,14 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2013)	3,49 %	1,91 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (GBP Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (GBP Hedged) und JPMorgan EMBI Global (GBP Hedged) <sup>3</sup>	4,51 %	3,06 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Diversified Income Duration Hedged Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 9. November 2015: Bogey 4309 (Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch High Yield BB-B Rated Developed Markets Constrained (USD Hedged), JPMorgan EMBI Global; ab 10. November 2015: Eine Mischung aus den folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged)

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Diversified Income Duration Hedged Fund versucht, in Übereinstimmung mit umsichtiger Anlageverwaltung die derzeitige Rendite zu maximieren, indem er mindestens 80 % seines Nettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio von variabel und flexibel verzinslichen Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) und Renteninstrumenten mit einer Duration von höchstens einem Jahr sowie fest verzinslichen Renteninstrumenten anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl bei Schuldtiteln mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, einschließlich der Übergewichtung des Engagements in einen ausgewählten Emittenten im Sektor Technologie, der überdurchschnittlich abschnitt, und der Untergewichtung des Engagements in einem ausgewählten Emittenten im Sektor Dienstleistungen, der unterdurchschnittlich abschnitt.
- » Das taktische Engagement im Credit Derivative Index (CDX) begünstigte die Wertentwicklung, da es sich besser entwickelte als Baranleihen.
- » Die Titelauswahl in Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, einschließlich des Engagements in ausgewählten chinesischen Immobilienentwicklern, da diese in den Erwartungen zurückblieben.
- » Die Titelauswahl bei Hochzinsanleihen war der Wertentwicklung abträglich, einschließlich der Übergewichtung des Engagements in einen ausgewählten Emittenten im Sektor Telekommunikation, der eine Underperformance aufwies.
- » Das taktische Engagement in verbrieften Krediten schmälerte die Wertentwicklung, einschließlich des Engagements in hypothekenbesicherten Wertpapieren mit Agency-Schuldtiteln und ausgewählten hypothekenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	3,34 %	2,20 %
E Class, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	2,94 %	1,40 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified	3,86 %	2,74 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	2,15 %	(0,30 %)
E Class EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,65 %	(1,20 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (EUR Hedged), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (EUR Hedged) und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (EUR Hedged)	2,51 %	(0,06 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	2,85 %	1,10 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (GBP Hedged), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (GBP Hedged) und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (GBP Hedged)	3,27 %	1,20 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Diversified Income ESG Fund ist es, die Erträge mit umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel des Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Anlagen mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen ökologische und soziale Merkmale zu bewerten (wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt) und einen Teil des Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine Übergewichtung von Schuldtiteln mit Investment Grade trug insbesondere in den ersten vier Monaten des Jahres zur Wertentwicklung bei, da sie sich im Vergleich zu Hochzins- und Schwellenmarktanleihen überdurchschnittlich entwickelte.
- » Es gab ansonsten keine anderen Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag zu diesem Fonds leisteten.
- » Die Titelauswahl in Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, einschließlich des Engagements in Schuldtiteln eines ausgewählten lateinamerikanischen Emittenten im Sektor Kosmetik, der in den Erwartungen zurückblieb.
- » Die Titelauswahl bei Hochzinsanleihen war der Wertentwicklung abträglich, einschließlich der Übergewichtung des Engagements in einen ausgewählten Emittenten im Sektor Gesundheitswesen, der eine Underperformance aufwies.
- » Das taktische Engagement in verbrieften Krediten schmälerte die Wertentwicklung, insbesondere in hypothekenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel, da sich die Spreads ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2008)	2,43 %	2,29 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Feb. 2010)	2,44 %	1,94 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	2,27 %	1,26 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	2,31 %	1,25 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	2,20 %	1,42 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2010)	2,09 %	0,89 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2010)	2,04 %	0,90 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	2,46 %	0,91 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	2,41 %	(0,34 %)
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,44 %	1,20 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021)	2,93 %	(2,88 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>1</sup>	2,40 %	0,85 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	2,14 %	2,74 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,70 %	1,62 %
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	2,18 %	0,62 %
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) <sup>3</sup>	2,25 %	1,36 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2010)	0,40 %	(0,03 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Apr. 2011)	0,00 %	(0,99 %)
ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>4</sup>	0,61 %	(0,39 %) <sup>5</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2009)	1,27 %	1,30 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Dez. 2009)	1,34 %	0,89 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2011)	1,09 %	0,15 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	0,99 %	0,32 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2009)	0,85 %	(0,01 %)
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Dez. 2010)	0,89 %	(0,35 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>6</sup>	1,34 %	0,10 % <sup>7</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2009)	2,07 %	1,55 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	2,09 %	1,17 %
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 2010)	1,61 %	0,52 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	2,06 %	0,67 % <sup>8</sup>
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Apr. 2011)	1,49 %	1,67 %
1 Month NIBOR Rate Index	1,64 %	1,36 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2011)	1,17 %	0,32 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (SEK Hedged) <sup>9</sup>	1,39 %	0,32 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1 Month USD LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

<sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis zum 30. Juni 2022: 1 Month LIBOR Index (CAD Hedged); ab 01. Juli 2022: Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)

<sup>5</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month CHF LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index

<sup>6</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index

<sup>7</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Dynamic Bond Fund beabsichtigt, einen höchstmöglichen langfristigen Gesamtertrag bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) unterschiedlicher Fälligkeiten anlegt. Der Fonds kann in sowohl festverzinsliche Wertpapiere mit Investment Grade-Rating als auch hochverzinsliche Titel investieren, wobei höchstens 40 % der Vermögenswerte in Wertpapiere angelegt werden können, die von Moody's niedriger als Baa bzw. von S&P niedriger als BBB bewertet werden bzw. die von Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben (oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind). Der Fonds kann bis zu 50 % seiner Vermögenswerte in festverzinsliche Wertpapiere investieren, die wirtschaftlich mit Schwellenländern verbunden sind.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in brasilianische Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die brasilianischen Zinsen fielen.
- » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in den brasilianischen Real trug zur Wertentwicklung bei, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.
- » Das Short-Engagement in polnische Zinsen war der Wertentwicklung abträglich, da die polnischen Zinsen fielen.
- » Das Long-Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(1,59 %)	2,21 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(1,66 %)	2,21 %
Investor, thesaurierend (Auflegung 14. Aug. 2020)	(1,82 %)	(3,04 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(2,16 %)	1,15 %
Class E, ausschüttend (Auflegung 10. Sep. 2020)	(2,15 %)	(3,50 %)
Class T, thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2016)	(2,34 %)	0,03 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Aug. 2019)	(1,21 %)	1,55 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>3</sup>	1,34 %	(0,16 %) <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
BM Retail AUD (Hedged) Income II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	(2,25 %)	(7,71 %)
M Retail AUD (Hedged) Income II (Auflegung: 08. Apr. 2021)	(1,70 %)	(7,19 %)
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,70 %	1,34 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	(2,52 %)	0,08 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>4</sup>	0,61 %	(0,49 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(0,95 %)	3,07 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	(0,96 %)	2,31 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>5</sup>	2,06 %	0,78 % <sup>2</sup>
<b>Auf ILS lautende Klassen</b>		
Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Sep. 2022)	(1,11 %)	(1,70 %)
SHIR Shekel Overnight Risk Free Rate	2,13 %	2,88 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(1,14 %)	(7,23 %)
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung 18. Dez. 2020)	(1,59 %)	(5,41 %)
SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average	1,82 %	1,41 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(0,37 %)	4,29 %
Institutional USD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2021)	(0,42 %)	(5,50 %)
Investor USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2021)	(0,45 %)	(5,36 %)
BM Retail USD (Hedged) Income II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	(1,34 %)	(6,30 %)
Class E USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	(0,78 %)	2,16 %
E Class USD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2021)	(0,90 %)	(5,63 %)
E Class USD (Hedged) Income II (Auflegung: 09. Sep. 2021)	(0,82 %)	(8,68 %)
H Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 05. Aug. 2020)	(0,42 %)	(1,65 %)
M Retail USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung 08. Jan. 2020)	(0,85 %)	0,33 %
T Class USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Sep. 2021)	(1,06 %)	(9,09 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>6</sup>	2,40 %	1,44 % <sup>2</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Dynamic Multi-Asset Fund strebt bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung die maximal mögliche Gesamtrendite an, indem er sich an einem breiten Spektrum von Vermögensklassen beteiligt. Hierzu zählen beispielsweise Aktientitel (wie im Verkaufsprospekt definiert), Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) und Währungen sowie mit Rohstoffen und dem Immobiliensektor zusammenhängende Instrumente (wobei jedoch keine Direktanlagen in Rohstoffe und Immobilien vorgenommen werden), die die im Verkaufsprospekt dargestellte Anlagepolitik des Fonds vorsieht. Im Fonds werden ökologischen Merkmale beworben, jedoch kein nachhaltiges Anlageziel verfolgt.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in ausgewählten Währungen von Schwellenländern trug zur Rendite bei, da die Währungen gegenüber dem Euro an Wert zulegte.
- » Das Long-Engagement in taiwanesischen Aktien trug zur Rendite bei, da die Kurse stiegen.
- » Das Long-Engagement in südkoreanischen Aktien trug zur Rendite bei, da die Kurse stiegen.
- » Das Short-Engagement in US-Aktien belastete die Rendite, da die Kurse stiegen.
- » Das Short-Engagement in europäischen Aktien belastete die Rendite, da die Kurse stiegen.
- » Das Long-Engagement in chinesischen Aktien belastete die Rendite, da die Kurse fielen.

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index

<sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month CHF LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index

<sup>5</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index

<sup>6</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1 Month USD LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 11. Dez. 2007)	9,42 %	2,10 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	9,46 %	1,90 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2010)	9,13 %	0,31 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	8,83 %	2,83 %
Class E, ausschüttend (Auflegung 08. Jul. 2010)	8,84 %	0,01 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	9,21 %	(1,21) %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	9,81 %	4,70 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	7,79 %	1,86 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	7,05 %	2,56 %
Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Jun. 2010)	6,94 %	2,00 %
Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	6,80 %	(0,28) %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	6,41 %	2,99 %
Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	6,46 %	2,79 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	5,45 %	3,71 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	3,52 %	5,22 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	1,99 %	4,93 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Local Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds legt grundsätzlich mindestens 80 % seiner Vermögenswerte in Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) an, die auf Währungen von Ländern mit Schwellenwertpapiermärkten lauten, die Terminkontrakte oder Derivate wie Optionen, Futures oder Swap-Vereinbarungen enthalten können.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Übergewichtung des Engagements in lokaler dominikanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen dominikanischen Renditen sanken.
- » Die Untergewichtung des Engagements in die türkische Lira trug zur Wertentwicklung bei, da die türkische Währung an Wert verlor.
- » Die Untergewichtung des Engagements in das ägyptische Pfund trug zur Wertentwicklung bei, da die ägyptische Währung an Wert verlor.
- » Das Altengagement in russischen Lokalwährungsanleihen war der Wertentwicklung abträglich, da der russische Rubel an Wert verlor.
- » Die Untergewichtung des Engagements in mexikanischer Duration in Landeswährung im langen Bereich schmälerte die Wertentwicklung, da die mexikanischen Renditen fielen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	9,56 %	15,80 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	9,56 %	15,81 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	9,28 %	15,40 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	9,37 %	15,44 %
E Class, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	8,93 %	14,70 %
E Class, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	9,02 %	14,75 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	10,03 %	18,50 %
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	8,87 %	14,99 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	7,19 %	7,40 %
Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	7,07 %	7,37 %
Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	6,89 %	7,00 %
Investor EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	6,89 %	7,02 %
E Class EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	6,61 %	6,40 %
E Class EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	6,65 %	6,39 %
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	6,50 %	6,67 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jun. 2023)	—	(0,70 %)
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	3,00 %	(0,62 %)

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Emerging Local Bond ESG Fund ist es, die Erträge mit umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds investiert normalerweise mindestens 80 % des Vermögens in festverzinsliche Anlagen, die auf Währungen von Ländern mit Wertpapiermärkten in Schwellenländern lauten. Der Fonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen ökologische und soziale Merkmale zu bewerten (wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt) und einen Teil des Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Übergewichtung des Engagements in lokaler dominikanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen dominikanischen Renditen sanken.
- » Die Untergewichtung des Engagements in die türkische Lira trug zur Wertentwicklung bei, da die türkische Währung an Wert verlor.
- » Die Übergewichtung des Engagements in die chilenische Durationskurve in Landeswährung im 10-Jahres-Bereich förderte die Wertentwicklung, da die chilenischen Renditen fielen.
- » Die Übergewichtung des Engagements in den malaysischen Ringgit schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung an Wert verlor.
- » Die Untergewichtung des Engagements in die mexikanische Durationskurve in Landeswährung im 5-Jahres-Bereich schmälerte die Wertentwicklung, da die mexikanischen Renditen fielen.



Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2001)	4,19 %	7,32 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 13. Dez. 2001)	4,15 %	6,70 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2002)	4,00 %	5,97 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 29. Mai 2003)	3,94 %	4,91 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	3,22 %	(2,47 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	3,72 %	3,61 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	3,71 %	3,77 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 17. Okt. 2002)	4,09 %	6,85 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 03. Sep. 2020)	4,03 %	(4,84 %)
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	3,72 %	2,26 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	3,76 %	1,48 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	4,56 %	6,85 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	3,81 %	6,59 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung: 19. Dez. 2012)	2,74 %	0,85 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (AUD Hedged)	2,80 %	1,73 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2005)	2,03 %	2,59 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (CHF Hedged)	1,58 %	2,76 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2002)	2,88 %	5,29 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Dez. 2010)	2,87 %	1,85 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	2,70 %	(4,89 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	2,46 %	2,31 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Hedged)	2,46 %	5,17 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2018)	1,87 %	2,56 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Unhedged)	1,55 %	2,44 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	3,66 %	4,98 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	3,73 %	4,00 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (GBP Hedged)	3,21 %	5,20 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2018)	3,54 %	0,46 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	3,11 %	2,71 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (SGD Hedged)	3,14 %	3,98 % <sup>2</sup>

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Bond Fund versucht, seine Gesamtrendite in Übereinstimmung mit einer umsichtigen Anlageverwaltung zu maximieren, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten anlegt, die wirtschaftlich an Länder mit aufstrebenden Wertpapiermärkten gebunden sind.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Übergewichtung des Engagements in ukrainische Staatsanleihen und Quasistaatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Übergewichtung des Engagements in nigerianische Staatsanleihen und Quasistaatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Übergewichtung des Engagements in srilankische Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Untergewichtung des Engagements in Spreads auf Spreads von Schwellenländern schmälerte die Wertentwicklung, da die Spreads schrumpften.
- » Die Übergewichtung des Engagements in ägyptische Staatsanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.



Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	4,31 %	2,99 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	4,37 %	(2,45 %)
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 10. Jun. 2019)	4,10 %	(2,94 %)
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	4,10 %	(2,95 %)
E Class, thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2021)	4,02 %	(8,79 %)
E Class, ausschüttend (Auflegung: 05. Feb. 2021)	3,86 %	(8,85 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2023)	—	3,90 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified <sup>3</sup>	3,91 %	3,46 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Apr. 2021)	2,04 %	(9,59 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (CHF Hedged) <sup>3</sup>	1,68 %	(9,25 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2013)	3,09 %	0,02 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2017)	3,06 %	(2,81 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2018)	2,59 %	(2,84 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (EUR Hedged) <sup>3</sup>	2,56 %	0,51 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2019)	3,84 %	(4,36 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Hedged) <sup>3</sup>	3,31 %	(4,64 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Dez. 2020)	(1,28 %)	(5,92 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Unhedged) <sup>3</sup>	(1,68 %)	(5,61 %)
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Mrz. 2014)	3,13 %	0,76 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (NOK Hedged) <sup>3</sup>	2,86 %	1,31 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Investor SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Feb. 2014)	3,06 %	(0,22 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	2,98 %	(12,16 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (SEK Hedged) <sup>3</sup>	2,82 %	0,55 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Emerging Markets Bond ESG Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 01. August 2019: JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, bereinigt um den Filter Socially Responsible Investment (SRI); ab 02. August 2019: JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Bond ESG Fund ist bestrebt, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen (durch die ausdrückliche Einbeziehung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmungsführungsfaktoren in den Anlageprozess, wie in der Ergänzung näher dargelegt) die maximal mögliche Rendite zu erzielen. Dazu werden mindestens 80 % des Vermögens in ein aktiv verwaltetes, diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Anlagen (wie im Prospekt angegeben) angelegt, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind. Die Beteiligung an solchen Emittenten lässt sich über die direkte Anlage in Rentenscheine (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder über den Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten (wie im Fondsnachtrag näher definiert) erreichen. Alle Wertpapiere werden gemäß dem internen verantwortungsbezogenen Auswahlverfahren der Anlageberatungsgesellschaft ausgewählt, das darauf ausgelegt ist, SGU-Faktoren (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) zu berücksichtigen, und das unter anderem ein ethisches Auswahlverfahren umfasst, das die sozial verantwortliche Anlageberatungsgesellschaft (wie im Prospekt angegeben) von Zeit zu Zeit vorgibt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Übergewichtung des Engagements in ukrainische Unternehmensanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Übergewichtung des Engagements in dominikanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze fielen.
- » Die Übergewichtung des Engagements in sri-lankische Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Untergewichtung des Engagements in Spreads auf Spreads von Schwellenländern schmälerte die Wertentwicklung, da die Spreads schrumpften.
- » Die Übergewichtung des Engagements in ägyptische Staatsanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

# Emerging Markets Corporate Bond Fund

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Nov. 2009)	1,81 %	3,39 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	1,37 %	1,52 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	3,27 %	4,69 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	(0,83 %)	(0,39 %)
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (CHF Hedged)	1,08 %	1,75 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Feb. 2010)	0,62 %	2,00 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mrz. 2010)	0,18 %	0,97 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (EUR Hedged)	1,97 %	3,23 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Corporate Bond Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den maximal möglichen Gesamtertrag erzielen, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Vermögens in einem aktiv verwalteten breit gefächerten Portfolio aus (im Verkaufsprospekt beschriebenen) Rentenwerten anlegt, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind, einschließlich Rentenwerten, die Emittenten von Industrieschuldverschreibungen begeben haben, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl bei ukrainischen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da die Kurse ausgewählter Wertpapiere stiegen.
- » Die Titelauswahl bei saudi-arabischen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da die Kurse ausgewählter Wertpapiere stiegen.
- » Die Titelauswahl bei brasilianischen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da die Kurse für einen ausgewählten Emittenten nachgaben.
- » Das Altengagement in russische Staatsanleihen war der relativen Wertentwicklung abträglich, da russische Unternehmensanleihen die Wertentwicklung des Index unterschritten.
- » Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmen war der Wertentwicklung abträglich, da ausgewählte Immobilienwerte unter Kursrückgängen litten.

# PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	5,86 %	2,00 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2022)	6,19 %	6,03 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged	5,80 %	(0,78 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	4,01 %	0,29 %
E Class EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2022)	3,53 %	(2,68 %)
50 % JPMorgan EMBI Global Index (EUR Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	3,96 %	(1,43 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Mrz. 2022)	3,52 %	(0,80 %)
50 % JPMorgan EMBI Global Index (GBP Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	2,61 %	(0,45 %)

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er in einen Mix aus festverzinslichen Wertpapieren (diese sind Darlehen ähnlich und zahlen feste oder variable Zinsen) von Unternehmen oder Regierungen, die wirtschaftlich mit Schwellenländern verbunden sind, verbundenen Derivaten auf diese festverzinslichen Wertpapiere sowie Schwellenmarktwährungen investiert.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Renditen einen Aufschwung erlebten.
- » Die Übergewichtung des Engagements in lokaler dominikanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen dominikanischen Renditen sanken.
- » Die Untergewichtung des Engagements in den südafrikanischen Rand trug zur Wertentwicklung bei, da die Währung an Wert verlor.
- » Die Übergewichtung des Engagements in den polnischen Zloty schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung an Wert zulegte.
- » Die Untergewichtung des Engagements in die tschechische Krone schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung an Wert zulegte.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	4,73 %	1,32 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	3,96 %	1,20 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2010)	2,91 %	2,80 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	2,40 %	2,26 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged)	1,70 %	2,82 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in Währungen von Schwellenländern oder Renteninstrumente (wie im Verkaufsprospekt definiert) investiert, die auf solche lauten. Bei der Auswahl von Ländern, die die Gesellschaft als Schwellenmärkte erachtet, verfügt die Anlageberatungsgesellschaft über einen breiten Spielraum. Die Anlageberatungsgesellschaft wählt die Zusammensetzung des Fonds nach Ländern und Währungen auf der Grundlage ihrer Bewertung von bestimmten Faktoren aus. Zu diesen Faktoren gehören Zinsprognosen, Inflationsraten, Devisenkurse, Geld- und Fiskalpolitik, Handels- und Leistungsbilanz, aktienmarktspezifische Faktoren und andere spezifische Faktoren, die der Anlageberatungsgesellschaft relevant erscheinen. Der Anlageschwerpunkt des Fonds wird wahrscheinlich auf Asien, Afrika, dem Nahen Osten, Lateinamerika und den aufstrebenden Ländern Europas liegen. Der Fonds kann in Instrumente investieren, deren Renditen auf den Renditen von Wertpapieren aus den Schwellenmärkten basieren, etwa derivative Instrumente, anstatt direkt in Wertpapiere oder Wertpapiere aus Schwellenmärkten zu investieren. Die durchschnittliche Duration des Portfolios dieses Fonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaft. Unter normalen Marktbedingungen wird davon ausgegangen, dass sie nicht länger als zwei Jahre ist. Der Fonds kann seine Vermögenswerte insgesamt in hochrentierliche Wertpapiere anlegen, wobei höchstens 15 % der Vermögenswerte in Wertpapiere angelegt werden können, die von Moody's oder S&P niedriger als B bewertet werden bzw. die von Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben (oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind).

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements in die türkische Lira trug zur Wertentwicklung bei, da die türkische Währung an Wert verlor.
- » Das nicht im Vergleichsindex enthaltene Engagement in lokaler dominikanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen dominikanischen Renditen sanken.
- » Die Übergewichtung des Engagements in den kolumbianischen Peso trug zur Wertentwicklung bei, da die kolumbianische Währung an Wert zulegte.
- » Die Untergewichtung des Engagements in lokaler polnischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.
- » Das nicht im Vergleichsindex enthaltene Engagement in brasilianischen Unternehmensanleihen beeinträchtigte die Wertentwicklung, da ausgewählte Wertpapiere Kursrückgänge verzeichneten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,49 %	(2,05 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,54 %	(2,05 %)
E Class, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,08 %	(2,91 %)
E Class, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,06 %	(2,93 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index	2,09 %	(4,80 %)
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Nov. 2021)	0,62 %	(4,31 %)
R Class AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	0,52 %	(3,16 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	1,13 %	(5,88 %) <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(0,66 %)	(4,50 %)
E Class CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(1,11 %)	(5,32 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(0,16 %)	(7,40 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	0,22 %	(3,82 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Mai 2021)	0,25 %	(3,96 %)
E Class EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jun. 2021)	(0,11 %)	(5,20 %)
E Class EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(0,20 %)	(4,67 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	0,74 %	(6,73 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,07 %	(2,74 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	1,51 %	(5,64 %)
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2023)	—	0,29 %
Bloomberg U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index	1,12 %	1,64 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 29. Okt. 2021)	0,36 %	(4,83 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2022)	0,11 %	(2,35 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (SEK Hedged) Index	0,99 %	(8,72 %) <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	0,98 %	(2,34 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	1,40 %	(5,22 %)

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO ESG Income Fund strebt hohe laufende Erträge an, die mit einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen vereinbar sind (durch die explizite Einbindung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmungsführungsfaktoren („SGU“) in den Anlageprozess, wie in der Ergänzung näher dargelegt). Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in Investitionskredite trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in Hochzinsanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Die Position in hypothekenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Spreads auf diese Wertpapiere schrumpften.
- » Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Renditen anstiegen.
- » Die Position in gewerblichen hypothekenbesicherten Wertpapieren und in solchen ohne Agency-Schuldtitel dämpften die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere ausweiteten.

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	2,18 %	3,28 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Jan. 2003)	2,09 %	2,92 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2002)	1,99 %	2,86 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,73 %	1,56 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	1,70 %	1,35 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	2,33 %	3,09 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2006)	1,26 %	1,69 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade (CHF Hedged) Index	1,44 %	1,73 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus auf Euro lautenden Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Im Fonds werden ökologischen Merkmale beworben, jedoch kein nachhaltiges Anlageziel verfolgt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements in Eurozonen-Duration (größtenteils aus dem kurzen und sehr langen Bereich der Kurve), und gleichzeitig eine Übergewichtung in der Mitte trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen im kurzen und sehr langen Bereich der Kurve anstiegen, während sie in der Mitte fielen.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Produkten, insbesondere in britischen Residential Mortgage-Backed Securitys und in europäischen hochwertigen besicherten Darlehensobligationen, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Titelauswahl bei vorrangigen Finanzwerten trug zur relativen Wertentwicklung bei, da das Engagement in Anleihen ausgewählter Finanz- und Makleremittenten eine Outperformance erzielte.
- » Die Titelauswahl bei nachrangigen Finanztiteln war der relativen Wertentwicklung abträglich, da das Engagement in einer ausgewählten Schweizer Bank eine Underperformance zeigte.
- » Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen einen Abstieg verzeichneten.
- » Das Long-Engagement in dänischen Hypotheken war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2008)	2,95 %	2,51 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	2,98 %	0,99 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2010)	2,50 %	1,05 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	3,03 %	(2,99 %)
H Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 07. Jun. 2019)	2,99 %	(3,00 %)
Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	2,10 %	2,35 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Credit Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds legt mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein breit gefächertes Portfolio von auf Euro lautenden Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten an. Diese enthalten direkte oder indirekte Beteiligungen an kreditnahen Rentenwerten oder derivativen Instrumenten, wie Optionen, Futures, Swaps oder Credit Default Swaps. Im Fonds werden ökologischen Merkmale beworben, jedoch kein nachhaltiges Anlageziel verfolgt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Makrostrategien und insbesondere die Positionierung in EUR- und USD-Duration trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze stiegen und sich beide Kurven weiter umkehrten.
- » Die Wertpapierauswahl bei Banken und Brokerage trug zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Schuldtiteln einer Schweizer Bank aufgrund einer Übernahme durch einen höher bewerteten Wettbewerber überdurchschnittlich abschnitt.
- » Die Untergewichtung von Staatsanleihen zu Beginn des Jahres trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor aufgrund der erhöhten Angebotserwartungen für 2023 eine Underperformance aufwies.
- » Das Engagement in dänischen gedeckten Schuldverschreibungen zu Beginn des Jahres war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Die Titelauswahl im Sektor Versorgung war der Wertentwicklung abträglich, da die Übergewichtung des Engagements in einem ausgewählten britischen Wasserversorger aufgrund von Bedenken hinsichtlich der Finanzlage des Unternehmens eine Underperformance aufwies.



Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	3,02 %	2,95 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	3,02 %	2,96 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2019)	2,92 %	(2,38 %)
Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Mai 2012)	2,83 %	2,54 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	2,56 %	2,03 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	2,59 %	2,03 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	2,39 %	(0,18 %)
Class T, ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	2,44 %	(0,18 %)
Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index	1,65 %	1,53 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Income Bond Fund beabsichtigt, seine laufenden Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Anleihen und anderen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von festverzinslichen Sektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft für gewöhnlich höhere Erträge einbringen. Im Fonds werden ökologischen Merkmale beworben, jedoch kein nachhaltiges Anlageziel verfolgt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in Schuldtiteln mit Investment Grade und hochverzinslichen Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in hypotheckenbesicherten US-Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel, europäischen Residential Mortgage-Backed Securitis und Collateralized Loan Obligations, trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in einen ausgewählten Korb von Währungen von Schwellenländern trugen zur Wertentwicklung bei, da sie gegenüber dem Euro an Wert zulegten.
- » Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.
- » Das Long-Engagement in Eurozonen-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die europäischen Zinsen anstiegen.
- » Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinsen einen Anstieg verzeichneten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Apr. 2006)	4,41 %	4,07 %
Bloomberg Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) + 15 Jahre Index <sup>2</sup>	3,66 %	3,00 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Long Average Duration Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. März 2011: Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond > 15 Years Index; 31. März 2011 bis 30. Januar 2012: Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond AAA rated > 15 Years Index; ab 31. Januar 2012: Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) + 15 Years Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Long Average Duration Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. Der Fonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt. Unter normalen Marktbedingungen leiten sich mindestens zwei Drittel der Duration des Fonds von Engagements bei auf Euro lautenden staatlichen und/oder regierungsnahen Rentenwerten ab.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements in Eurozonen-Duration (hauptsächlich im kurzen Bereich der Kurve) sowie die Instrumentenauswahl leisteten einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, da die Renditen der Eurozone im vorderen Bereich der Kurve anstiegen und in die Höhe schossen.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Produkten, insbesondere in britischen Residential Mortgage-Backed Securitys und in europäischen hochwertigen besicherten Darlehensobligationen, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Positionierung innerhalb Japans durch eine Untergewichtung in japanischer Duration und eine Übergewichtung des japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinssätze fielen und der Yen gegenüber dem US-Dollar (der Finanzierungswährung) an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement in dänischen Hypotheken waren der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2006)	1,61 %	1,06 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,25 %	0,29 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>3</sup>	1,34 %	0,76 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Short-Term Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Short-Term Fund ist bestrebt, bei Kapitalerhaltung und täglicher Liquidität höchstmögliche laufende Erträge zu erzielen. Der Fonds verfolgt sein Anlageziel, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Durationen anlegt, obwohl davon auszugehen ist, dass die durchschnittliche Portfolioduration anderthalb Jahre nicht überschreitet. Im Fonds werden ökologischen Merkmale beworben, jedoch kein nachhaltiges Anlageziel verfolgt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in europäischen Residential Mortgage-Backed Securitys und Collateralized Loan Obligations, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade begünstigte die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Die Titelauswahl in europäischen gedeckten Schuldverschreibungen wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.
- » Die Kurvenpositionierung in Eurozonen-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die europäischen Zinsen im vorderen Bereich anstiegen.
- » Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.
- » Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem Euro an Wert verlor.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	4,73 %	0,55 %
E Class, thesaurierend (Auflegung: 22. Dez. 2022)	4,20 %	4,20 %
E Class, ausschüttend (Auflegung: 17. Apr. 2023)	—	1,35 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	5,06 %	1,10 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	4,44 %	(0,83 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO European High Yield Bond Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hochverzinslichen Rentenpapieren, die von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Moody's oder Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind. Unter normalen Marktbedingungen kann der Fonds bis zu 20 % seines Vermögens in hochverzinsliche Rentenpapiere investieren, die von S&P niedriger als CCC bewertet werden oder von Moody's oder Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl im Sektor Gesundheitswesen trug zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung ausgewählter Emittenten eine Outperformance erzielte, wohingegen die Untergewichtung eines ausgewählten Emittenten eine Underperformance aufwies.
- » Die Titelauswahl im Sektor Automobil trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung ausgewählter Emittenten überdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl im Finanzen und Versicherungen trug zur Wertentwicklung bei, da sich ausgewählte Emittenten unterdurchschnittlich entwickelten.
- » Die Titelauswahl im Sektor Bankwesen war der Wertentwicklung abträglich, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere in einer ausgewählten Schweizer Bank unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl im Sektor Chemie war der Wertentwicklung abträglich, da die Übergewichtung eines ausgewählten Emittenten zurückblieb.

# PIMCO European Short-Term Opportunities Fund

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2011)	0,45 %	0,84 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mrz. 2013)	0,32 %	(0,55 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	0,42 %	(1,20 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>3</sup>	1,35 %	1,05 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 29. September 2012: PIMCO European Advantage Government 1-3 Year Bond Index; 30. September 2012 bis 16. Januar 2020: Bloomberg Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index; ab 17. Januar 2020: Euro Short-Term Rate (ESTER) Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem 30. Juni 2011 berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO European Short-Term Opportunities Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein breit gefächertes Portfolio von auf paneuropäische Währungen (d.h. die verschiedenen Währungen Europas) lautenden Renteninstrumenten mit unterschiedlichen Laufzeiten. Die durchschnittliche Portfolioduration des Fonds bewegt sich normalerweise zwischen 0 und 5 Jahren, je nach der Prognose der Anlageverwaltungsgesellschaften für den Zinssatz.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in europäischen Residential Mortgage-Backed Securitics und Collateralized Loan Obligations, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in vorrangigen Finanztiteln war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Es gibt ansonsten keine anderen Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag zum Fonds leisteten.
- » Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.
- » Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinsen einen Anstieg verzeichneten.
- » Das Long-Engagement in dänischen gedeckten Schuldverschreibungen war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 09. Jun. 2009)	1,81 %	2,17 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	2,14 %	1,70 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Aug. 2011)	(0,22 %)	1,06 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (CHF, Partially Hedged) (London Close)	0,05 %	0,58 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Mai 2010)	0,70 %	1,99 %
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mai 2010)	0,26 %	0,99 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (EUR, Partially Hedged) (London Close)	1,03 %	1,59 % <sup>2</sup>
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2012)	3,99 %	3,43 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (NOK, Partially Hedged) (London Close)	4,37 %	3,02 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Advantage Fund versucht, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung höchstmögliche langfristigen Erträge zu erzielen, indem er 80 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die wirtschaftlich mit mindestens drei Ländern verbunden sind (darunter dürfen sich die USA befinden).

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements in US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Finanztiteln war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Das ausgewählte Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Untergewichtung des Engagements in europäischen Peripherieländern, insbesondere italienischen Staatsanleihen, schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads gegenüber deutschen Bundesanleihen verengten.
- » Eine Untergewichtung von Unternehmensanleihen mit Investment Grade außerhalb des Finanzsektors schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Die Übergewichtung des Engagements in britischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen anstiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 1998)	2,97 %	4,78 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2001)	2,94 %	4,44 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 1999)	2,78 %	4,26 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	2,78 %	4,08 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Jun. 2004)	2,68 %	3,74 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	2,50 %	3,21 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	2,49 %	3,17 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	2,87 %	4,10 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	2,78 %	(1,67 %)
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	2,49 %	0,52 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,26 %	0,96 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,32 %	0,97 %
Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	3,01 %	(2,71 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	2,94 %	(2,75 %)
W Class Income II (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	1,50 %
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index <sup>3</sup>	2,96 %	4,06 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 13. Dez. 2002)	1,45 %	3,64 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 23. Mär. 2006)	1,41 %	3,19 %
Class E (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 19. Mai 2010)	1,04 %	1,20 %
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 19. Mai 2010)	0,98 %	1,20 %
H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 26. Feb. 2021)	1,35 %	(7,75 %)
Bloomberg Global Aggregate (USD Unhedged) Index <sup>3</sup>	1,43 %	2,82 % <sup>2</sup>
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	2,57 %	0,76 %
Bloomberg Global Aggregate (CAD Hedged) Index <sup>3</sup>	2,64 %	0,60 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2003)	0,80 %	2,24 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	0,79 %	2,28 %
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Jun. 2011)	0,61 %	1,24 %
E Class CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2018)	0,34 %	(2,20 %)
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,93 %	(4,79 %)
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,83 %	(4,82 %)
Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index <sup>3</sup>	0,75 %	1,46 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2003)	1,71 %	3,22 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Apr. 2005)	1,72 %	3,05 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Feb. 2005)	1,52 %	2,70 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,25 %	2,24 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	1,26 %	(0,87 %)
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2012)	1,26 %	0,02 %
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,52 %	0,65 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,08 %	(0,72 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,73 %	(4,26 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,66 %	(4,26 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index <sup>3</sup>	1,66 %	2,37 % <sup>2</sup>

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf führende Weltwährungen lauten.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements im vorderen Bereich der US-Renditekurve trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze anstiegen.
- » Die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Finanztiteln war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in hypothekenbesicherten US-Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel, Residential Mortgage-Backed Securitys und europäische besicherte Hypothekenverpflichtungen, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Untergewichtung des Engagements in japanischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen einen Abstieg verzeichneten.
- » Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Die Übergewichtung des Engagements in britischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen anstiegen.



Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen  
Berichtszeitraum: (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	(0,70 %)	2,38 %
Bloomberg Global Aggregate (EUR Unhedged) Index <sup>3</sup>	(0,78 %)	1,89 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2003)	2,47 %	4,21 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2004)	2,48 %	4,20 %
Investor GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Apr. 2005)	2,32 %	3,56 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,48 %	(3,26 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,58 %	(3,24 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index <sup>3</sup>	2,43 %	3,41 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 09. Mrz. 2018)	(4,03 %)	0,45 %
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index <sup>3</sup>	(4,03 %)	0,23 %
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	2,94 %	0,63 %
Bloomberg Global Aggregate (HKD Unhedged) Index <sup>3</sup>	3,38 %	1,22 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	1,91 %	4,18 %
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Jul. 2006)	1,74 %	4,14 %
W Class NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 13. Apr. 2021)	1,96 %	(4,64 %)
Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index <sup>3</sup>	2,02 %	3,33 % <sup>2</sup>
<b>Auf NZD lautende Klassen</b>		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Nov. 2004)	2,73 %	6,08 %
Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index <sup>3</sup>	2,73 %	5,20 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Nov. 2004)	1,81 %	3,37 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2021)	1,56 %	(6,55 %)
Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index <sup>3</sup>	1,88 %	2,46 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Aug. 2009)	2,33 %	4,13 %
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	1,05 %
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	0,70 %
W Class SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	1,12 %
Bloomberg Global Aggregate (SGD Hedged) Index <sup>3</sup>	2,32 %	2,68 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. November 2000: JPMorgan GBI Global Index Hedged in USD; ab 01. Dezember 2000: Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	2,64 %	1,30 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung 03. Apr. 2020)	2,63 %	(1,14 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2018)	2,48 %	0,74 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	2,11 %	(0,43 %)
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	2,96 %	1,17 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	2,07 %	1,33 %
Bloomberg Global Aggregate Index (AUD Hedged)	2,07 %	0,68 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	0,44 %	(1,25 %)
E Class CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sept. 2022)	0,10 %	(3,30 %)
Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index	0,75 %	(1,41 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	1,28 %	(0,76 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	1,32 %	(0,76 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 09. Feb. 2017)	1,01 %	(1,62 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index	1,66 %	(0,89 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 29. Nov. 2021)	(1,02 %)	(8,02 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Unhedged) Index	(0,78 %)	(7,87 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2020)	2,10 %	(2,61 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	2,18 %	0,27 %
Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index	2,43 %	0,14 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 04. Aug. 2022)	(4,36 %)	(8,18 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index	(4,03 %)	(8,10 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Dez. 2020)	(2,88 %)	(2,71 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index	(2,58 %)	(1,99 %)
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	1,58 %	0,41 %
Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index	2,02 %	0,35 %
<b>Auf NZD lautende Klassen</b>		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Apr. 2017)	2,45 %	1,03 %
Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index	2,73 %	1,00 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Mai 2021)	1,51 %	(5,73 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mai 2023)	—	(0,19 %)
Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index	1,88 %	(5,19 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond ESG ist bestrebt, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen (durch die explizite Einbindung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmungsführungsfaktoren in den Anlageprozess, wie in der Ergänzung näher dargelegt) die maximal mögliche Rendite zu erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf führende Weltwährungen lauten.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements im vorderen Bereich der US-Kurve trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze anstiegen.
- » Die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Finanztiteln war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Die Positionierung auf der Kurve innerhalb der Eurozone, nämlich eine Untergewichtung im vorderen Bereich, wo die Zinssätze anstiegen, und eine Übergewichtung im 10-jährigen Bereich, wo die Zinssätze fielen, trugen zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Die Untergewichtung des Engagements in japanischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen einen Abstieg verzeichneten.
- » Die Untergewichtung des Engagements in chinesischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen einen Abstieg verzeichneten.
- » Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2003)	3,49 %	4,23 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 09. Nov. 2005)	3,46 %	4,27 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2006)	3,32 %	3,86 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Sep. 2004)	3,23 %	3,86 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	3,07 %	3,37 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	3,38 %	0,87 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Okt. 2019)	3,77 %	(0,22 %)
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index <sup>1</sup>	3,61 %	3,34 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 04. Okt. 2016)	0,31 %	(2,47 %)
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Unhedged) Index <sup>3</sup>	0,83 %	(2,12 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2006)	2,31 %	3,45 %
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (EUR Hedged) Index <sup>3</sup>	2,36 %	2,35 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Ex-US Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 19. Januar 2016: FTSE World Government Bond Ex-U.S. Index (USD Hedged); ab 20. Januar 2016: Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond Ex-US Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens 70 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten anlegt, die ihren eingetragenen Geschäftssitz oder ihre überwiegende Geschäftstätigkeit außerhalb der USA haben und mindestens drei Länder außerhalb der USA repräsentieren.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements in US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Finanztiteln war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in Collateralized US-Loan Obligations sowie US-amerikanische und britischen Residential Mortgage-Backed Securitys ohne Agency-Schuldtitle, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Eine Untergewichtung von Unternehmensanleihen mit Investment Grade außerhalb des Finanzsektors schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Die Übergewichtung des Engagements in britischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen anstiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	6,23 %	5,35 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	6,08 %	3,50 %
Class E, thesaurierend (Auflegung 22. Jun. 2009)	5,60 %	3,86 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Jan. 2011)	5,64 %	2,40 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	6,15 %	0,09 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	6,12 %	0,08 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 06. Jul. 2016)	6,73 %	6,68 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged	9,49 %	7,68 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	5,22 %	4,44 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Jun. 2009)	4,54 %	2,95 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 24. Jun. 2011)	4,65 %	1,36 %
60 % MSCI All Country World Index EUR Hedged/40 % Bloomberg Global Aggregate EUR Hedged	8,34 %	6,57 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2010)	6,10 %	3,72 %
60 % MSCI All Country World Index GBP Hedged/40 % Bloomberg Global Aggregate GBP Hedged	9,08 %	5,94 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Global Core Asset Allocation Fund strebt bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung die maximal mögliche Gesamtrendite an, indem er sich an einem breiten Spektrum von Vermögensklassen beteiligt, einschließlich Aktien, Rentenwerte, Rohstoffe und Immobilien (wie im Fondsnachtrag beschrieben). Der Fonds kann (gemäß dem Verkaufsprospekt) auch in andere PIMCO-Fonds und andere Organismen für gemeinsame Anlagen anlegen.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement in ausgewählten Schwellenmarktwährungen, insbesondere die Übergewichtung des Engagements im brasilianischen Real und mexikanischen Peso sowie die Untergewichtung des Engagements im chinesischen Yuan trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da der brasilianische Real und der mexikanische Peso gegenüber dem US-Dollar an Wert gewannen, der chinesische Yuan gegenüber dem US-Dollar dagegen an Wert verlor.
- » Das Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen und solchen mit Investment Grade, insbesondere die Übergewichtung und die Titelauswahl bei Finanzwerten, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere im Berichtszeitraum positive Renditen verzeichneten.
- » Die Untergewichtung des Engagements in US-Aktien schmälerte die relative Wertentwicklung, da die US-Aktien im Berichtszeitraum positive Renditen verzeichneten.
- » Das Engagement in Schwellenmarktaktien, insbesondere eine ausgewählte Positionierung in der Kategorie zyklische Konsumgüter in chinesischen Aktien, schmälerte die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere negative Renditen verzeichneten.
- » Die Untergewichtung des Engagements in Aktien der Eurozone schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Aktien der Eurozone im Berichtszeitraum positive Renditen verzeichneten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	4,70 %	5,71 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	4,79 %	5,71 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	4,51 %	3,51 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	4,43 %	5,21 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2015)	4,47 %	3,96 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	3,74 %	(0,23 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	4,24 %	4,67 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	4,25 %	4,74 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	4,66 %	5,67 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2013)	4,62 %	3,68 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	4,18 %	4,06 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	4,35 %	2,81 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	4,63 %	3,84 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	4,02 %	2,51 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	4,08 %	2,51 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD <sup>1</sup>	5,10 %	6,06 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Feb. 2010)	2,58 %	3,74 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	2,43 %	2,32 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into CHF <sup>1</sup>	2,84 %	4,11 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2008)	3,42 %	4,29 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	3,40 %	4,55 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2011)	3,24 %	3,07 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	2,97 %	3,53 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2016)	3,00 %	0,84 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into EUR <sup>1</sup>	3,76 %	4,72 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	4,21 %	3,92 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	4,14 %	5,28 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009)	3,76 %	5,09 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into GBP <sup>1</sup>	4,50 %	5,47 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2016)	3,61 %	2,59 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into SGD <sup>1</sup>	4,45 %	3,97 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global High Yield Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 31. März 2014: ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield, BB-B Rated, Constrained Index; seit dem 01. April 2014: ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global High Yield Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hoch verzinslichen Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf wichtige Währungen lauten, die von Moody's mit niedriger als Baa oder von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Fitch ein gleichwertiges Rating erhalten haben.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Übergewichtung und die Titelauswahl in den Sektoren Glücksspiel und Hotellerie trugen zur Wertentwicklung bei, da die Sektoren den Gesamtmarkt aufgrund der starken Verbrauchernachfrage nach Freizeit- und Unterhaltungsdienstleistungen übertrafen.
- » Die Titelauswahl im Sektor nicht zyklische Konsumgüter trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung eines ausgewählten Emittenten unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl in den Sektoren Finanzen und Versicherungen war der Wertentwicklung abträglich, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere in einer ausgewählten Schweizer Bank unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Übergewichtung und die Titelauswahl in den Chemiewerten beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der Sektor hinter dem Gesamtmarkt zurückblieb, während die Übergewichtung eines ausgewählten Emittenten eine Underperformance aufwies.
- » Die Titelauswahl in den Sektoren Medien, Unterhaltung und Verlagswesen war der Wertentwicklung abträglich, da die Übergewichtung ausgewählter Emittenten hinter den Erwartungen zurückblieb.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	3,44 %	4,12 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jul. 2003)	3,38 %	4,34 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2005)	3,25 %	3,72 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	3,19 %	4,36 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	3,17 %	4,20 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	3,07 %	4,20 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2008)	2,99 %	3,98 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	2,96 %	3,13 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	3,36 %	4,08 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	3,35 %	0,47 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	2,96 %	1,40 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	2,95 %	1,53 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,30 %	1,90 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,28 %	1,91 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,73 %	0,61 %
Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	3,48 %	(3,93 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	3,37 %	(3,92 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	3,00 %	3,65 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 02. Aug. 2013)	3,91 %	1,27 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 06. Sep. 2016)	3,85 %	0,09 %
H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 26. Feb. 2021)	3,72 %	(7,37 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Unhedged)	3,42 %	1,20 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Apr. 2020)	2,53 %	(1,61 %)
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	2,36 %	(0,54 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (AUD Hedged)	2,03 %	0,35 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2009)	1,22 %	1,90 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Feb. 2015)	1,24 %	(0,72 %)
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mai 2011)	1,01 %	0,75 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	0,94 %	2,67 %
Administrative CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2013)	0,94 %	(0,36 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mrz. 2012)	0,81 %	(0,06 %)
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,21 %	(6,03 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)	0,74 %	2,27 % <sup>2</sup>
<b>Auf CZK lautende Klassen</b>		
Institutional CZK (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2015)	4,26 %	1,14 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CZK Hedged)	3,81 %	1,33 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2003)	2,08 %	3,37 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2008)	2,09 %	3,27 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2006)	1,96 %	2,83 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	2,00 %	3,25 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	1,87 %	2,98 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	1,94 %	2,98 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,66 %	2,22 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Sep. 2010)	1,71 %	0,99 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Investment Grade Credit Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Unternehmens-Rentenpapieren mit Investment Grade-Qualität (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Makrostrategien und insbesondere die Durationspositionierung in Industrieländern begünstigten die Wertentwicklung.
- » Die Übergewichtung und die Titelauswahl im Sektor Transport trugen zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung ausgewählter Emittenten aufgrund einer anhaltenden Zunahme der Reiseaktivitäten eine Outperformance erzielte.
- » Die Titelauswahl in Finanzgesellschaften trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung ausgewählter Emittenten gegenüber dem Gesamtmarkt überdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl im Sektor Bankwesen war der Wertentwicklung abträglich, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere in einer ausgewählten Schweizer Bank unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl in den Auslandsschulden von Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, da ausgewählte alte russische Positionen zurückblieben.



Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen  
Berichtszeitraum: (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,93 %	0,35 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,46 %	(1,13 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,17 %	(5,52 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,11 %	(5,52 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)	1,64 %	2,65 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2012)	1,65 %	2,38 %
Class E EUR (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	1,22 %	(0,08 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Unhedged)	1,17 %	2,50 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Sep. 2005)	2,88 %	3,75 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Jul. 2008)	2,86 %	3,88 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	2,70 %	3,89 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jan. 2009)	2,63 %	3,71 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mrz. 2009)	2,47 %	3,39 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,76 %	1,22 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,94 %	(4,53 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,85 %	(4,51 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)	2,42 %	3,18 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	3,58 %	0,14 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	3,37 %	(0,24 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) Index, lautend auf HKD	3,41 %	1,17 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jan. 2012)	2,38 %	2,78 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (NOK Hedged)	2,01 %	2,59 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Dez. 2009)	2,30 %	2,87 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2012)	1,97 %	0,33 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)	1,89 %	2,45 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	2,73 %	1,58 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	2,57 %	(0,11 %)
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Sept. 2017)	2,53 %	(0,52 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jul. 2012)	2,38 %	1,35 %
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 13. Okt. 2020)	2,75 %	(4,65 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SGD Hedged)	2,31 %	2,19 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.



Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	2,59 %	1,39 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 19. Jul. 2019)	2,59 %	(0,68 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mai 2021)	2,45 %	(5,86 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	2,19 %	(3,53 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	2,17 %	(3,53 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Jun. 2019)	2,88 %	0,05 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	3,00 %	1,21 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	0,43 %	(1,21 %)
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	0,42 %	(4,83 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	0,00 %	(5,71 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(0,04 %)	(5,69 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)	0,74 %	(1,42 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	1,36 %	(0,68 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	1,43 %	(4,29 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2023)	—	0,50 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Jan. 2023)	—	0,44 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	0,96 %	(5,16 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	0,85 %	(5,19 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)	1,64 %	(0,89 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	2,11 %	0,29 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 1. Mai 2019)	2,09 %	(0,78 %)
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	1,65 %	(4,32 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)	2,42 %	0,12 % <sup>2</sup>
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Nov. 2022)	1,48 %	5,23 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Nov. 2019)	1,22 %	(3,47 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)	1,89 %	(3,03 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Investment Grade Credit ESG Fund ist bestrebt, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen (durch die explizite Einbindung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmungsführungsfaktoren in den Anlageprozess, wie in der Ergänzung näher dargelegt) die maximal mögliche Rendite zu erzielen. Der Fonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Unternehmensanleihen mit Investment Grade (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl in Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung des Engagements in den SGU-Anleihen ausgewählter Staaten, regierungsnaher Unternehmen und Emittenten von Unternehmensanleihen überdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl im Sektor Automobil trug zur Wertentwicklung bei, da sich das Engagement in SGU-Anleihen ausgewählter Automobilzulieferer überdurchschnittlich entwickelte.
- » Makrostrategien und insbesondere die Durations- und Kurvenpositionierung in den USA belasteten die Wertentwicklung.
- » Die Titelauswahl im Sektor Bankenwesen war der Wertentwicklung abträglich, da das Engagement in ausgewählten vor- und nachrangigen Anleihen aufgrund der allgemeinen Volatilität im Sektor Bankenwesen eine Underperformance aufwies.
- » Die Übergewichtung von Immobilienfonds belastete die Wertentwicklung, da der Sektor aufgrund von Bedenken bzgl. der Auswirkungen höherer Zinssätze und strafferer Finanzbedingungen hinter dem Gesamtmarkt zurückblieb.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	1,27 %	1,92 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 05. Okt. 2016)	1,14 %	2,16 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,83 %	1,00 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	1,54 %	1,94 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(0,81 %)	(0,22 %)
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (CHF Hedged)	(0,60 %)	(0,26 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,10 %	0,27 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jan. 2017)	0,08 %	0,41 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(0,32 %)	(0,62 %)
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (EUR Hedged)	0,32 %	0,30 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	0,83 %	1,46 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,80 %	1,20 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (GBP Hedged)	1,07 %	1,22 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Sep. 2022)	0,70 %	1,30 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (SGD Hedged)	0,97 %	1,03 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Low Duration Real Return Fund versucht, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung eine höchstmögliche reale Rendite zu erzielen, indem er mindestens 70 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus inflationsgekoppelten Rentenpapieren unterschiedlicher Laufzeiten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, welche von Regierungen, ihren Vertretungen oder Behörden und Unternehmen ausgegeben wurden. Inflationsindexierte Anleihen sind festverzinsliche Wertpapiere, die so strukturiert sind, dass sie Schutz vor Inflation bieten. Im Fonds werden ökologischen Merkmale beworben, jedoch kein nachhaltiges Anlageziel verfolgt.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung des Engagements in auf Euro lautenden Derivaten, insbesondere Zinsswaps und Optionen, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Swapsätze stiegen.
- » Die Untergewichtung im Engagement bei nominalen US-Staatszinsen begünstigte die relative Wertentwicklung, da die nominalen US-Renditen anstiegen.
- » Das Engagement in hypotheckenbesicherten Wertpapieren (MBS) mit Agency-Schuldtiteln, insbesondere Residential MBS (RMBS), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die RMBS-Spreads verengten.
- » Die Untergewichtung im Engagement bei nominalen japanischen Staatszinsen belastete die relative Wertentwicklung, da die nominalen Renditen in Japan zurückgingen.
- » Die Kurvenpositionierung in italienischen nominalen Zinssätzen für Staatsanleihen, insbesondere die Untergewichtung des Engagements im 10-jährigen Bereich der Kurve, war der relativen Wertentwicklung abträglich, da der 10-jährige Bereich der Kurve zurückging.
- » Die Übergewichtung des Engagements in den japanischen Yen, die durch eine Untergewichtung des US-Dollars finanziert wurde, war der relativen Wertentwicklung abträglich, da der Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	1,67 %	4,06 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	1,70 %	3,70 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mrz. 2004)	1,44 %	3,53 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	1,51 %	3,95 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2004)	1,42 %	3,27 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,19 %	2,92 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	1,15 %	2,82 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2004)	1,58 %	3,86 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,52 %	1,76 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	1,72 %	3,85 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 01. Sep. 2017)	2,56 %	0,00 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Unhedged Index	2,59 %	(0,22 %)
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2008)	(0,53 %)	1,80 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(0,43 %)	0,04 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	(0,66 %)	2,23 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond CHF Hedged Index	(0,53 %)	1,49 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	0,39 %	3,07 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	0,41 %	2,61 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2004)	0,24 %	2,60 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(0,06 %)	1,86 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond EUR Hedged Index	0,36 %	2,82 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	1,19 %	4,01 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Apr. 2005)	1,11 %	3,57 %
Class R GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,99 %	1,08 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond GBP Hedged Index	1,13 %	3,83 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Feb. 2008)	1,01 %	3,10 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond SGD Hedged Index	1,04 %	2,96 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Real Return Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Realrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus inflationsgekoppelten Rentenpapieren unterschiedlicher Laufzeiten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, welche von Regierungen, ihren Vertretungen oder Behörden und Unternehmen ausgegeben wurden. Im Fonds werden ökologischen Merkmale beworben, jedoch kein nachhaltiges Anlageziel verfolgt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung im Engagement bei nominalen deutschen Staatszinsen begünstigte die relative Wertentwicklung, da die nominalen deutschen Renditen anstiegen.
- » Die Untergewichtung des Engagements in auf Euro lautenden Derivaten, insbesondere Zinsswaps und Optionen, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Swapsätze stiegen.
- » Das Engagement in hypotheckenbesicherten Wertpapieren (MBS) mit Agency-Schuldtiteln, insbesondere Residential MBS (RMBS), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die RMBS-Spreads verengten.
- » Die Untergewichtung im Engagement bei nominalen japanischen Staatszinsen belastete die relative Wertentwicklung, da die nominalen Renditen in Japan zurückgingen.
- » Die Kurvenpositionierung in italienischen nominalen Zinssätzen für Staatsanleihen, insbesondere die Untergewichtung des Engagements im 10- und 12-jährigen Bereich der Kurve, war der relativen Wertentwicklung abträglich, da der 10- und 12-jährige Bereich der Kurve zurückging.
- » Die Übergewichtung des Engagements in den japanischen Yen, die durch eine Untergewichtung des US-Dollars finanziert wurde, war der relativen Wertentwicklung abträglich, da der Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,29 %	4,74 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,26 %	4,74 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2015)	3,12 %	3,38 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2013)	3,17 %	3,56 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 13. Feb. 2017)	2,99 %	2,52 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,96 %	4,22 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,84 %	3,81 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,85 %	3,80 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2018)	3,16 %	2,62 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	3,16 %	2,62 %
Class R, thesaurierend (Auflegung 07. Nov. 2019)	3,14 %	1,37 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2015)	3,16 %	3,28 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 18. Okt. 2014)	2,62 %	2,27 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,57 %	2,28 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,60 %	5,31 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index	2,09 %	1,18 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jan. 2018)	2,36 %	1,49 %
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	2,14 %	1,45 %
Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	2,05 %	2,43 %
Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Feb. 2017)	1,86 %	1,39 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Okt. 2015)	2,56 %	3,80 %
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	1,13 %	0,71 % <sup>2</sup>
<b>Auf BRL lautende Klassen</b>		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Feb. 2016)	16,56 %	6,53 %
Bloomberg Global Aggregate (BRL Hedged) Index	6,33 %	7,24 %
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Apr. 2016)	2,94 %	3,25 %
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2018)	2,94 %	2,42 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index (CAD Hedged)	1,74 %	0,31 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Dez. 2014)	1,08 %	1,35 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	1,03 %	1,07 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,56 %	0,74 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,70 %	0,75 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(0,16 %)	(0,88 %) <sup>2</sup>
<b>Auf CNH lautende Klassen</b>		
Investor RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2018)	1,61 %	2,96 %
Class E RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung 22. Mai 2013)	1,34 %	4,60 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CNH Hedged) Index	0,46 %	3,23 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,98 %	3,15 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,95 %	3,13 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	1,89 %	1,77 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2015)	1,85 %	1,17 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2015)	1,77 %	1,22 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend A (Auflegung: 16. Dez. 2015)	1,88 %	1,36 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Income Fund ist bestrebt, unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung hohe laufende Erträge zu erzielen, wobei das sekundäre Ziel der langfristige Kapitalzuwachs ist. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in Schuldtiteln mit Investment Grade und hochverzinslichen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement bei ausgewählten Währungen von Schwellenländern war der Wertentwicklung zuträglich, da die Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert gewannen.
- » Die Auswahl in lokalen Schuldtiteln aus Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da der Kurs der zugrunde liegenden Wertpapiere zulegte.
- » Das Long-Engagement bei US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.
- » Das Long-Engagement in den japanischen Yen und die norwegische Krone schmälerte die Wertentwicklung, da die Währungen gegenüber dem US-Dollar nachgaben.
- » Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinsen einen Abstieg verzeichneten.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen  
Berichtszeitraum: (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Aug. 2015)	1,68 %	1,12 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	1,66 %	0,87 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,45 %	2,22 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,57 %	2,22 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 31. Aug. 2018)	1,56 %	(0,16 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II Q (Auflegung: 30. Sep. 2019)	1,56 %	(1,00 %)
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Aug. 2017)	1,55 %	(0,61 %)
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	1,85 %	1,48 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,36 %	0,45 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,36 %	0,45 %
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	0,74 %	(0,33 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2019)	2,80 %	1,40 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	2,73 %	3,23 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	2,60 %	(0,20 %)
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Sept. 2016)	2,45 %	1,56 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	2,31 %	0,82 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,65 %	3,71 %
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	1,51 %	0,57 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	3,70 %	3,79 %
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Apr. 2017)	3,41 %	2,43 %
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 04. Feb. 2013)	3,30 %	3,20 %
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	2,51 %	1,38 % <sup>2</sup>
<b>Auf JPY lautende Klassen</b>		
Institutional JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mrz. 2023)	—	0,80 %
Investor JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jun. 2023)	—	0,40 %
Class E JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung 01. Sep. 2017)	0,00 %	(0,70 %)
Class E JPY (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Dez. 2022)	(0,01 %)	(0,81 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index	(0,90 %)	(1,98 %) <sup>2</sup>
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2017)	2,17 %	1,62 %
Bloomberg U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index	1,12 %	(0,28 %)
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 14. Jul. 2020)	2,66 %	1,43 %
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2015)	2,63 %	3,47 %
Investor SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 07. Feb. 2020)	2,44 %	0,24 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	2,48 %	2,00 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,34 %	4,01 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Feb. 2013)	2,13 %	2,87 %
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	1,40 %	1,05 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	2,99 %	(1,42 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 03. Mrz. 2023)	—	1,97 %
E Class Income (Auflegung: 29. Jan. 2021)	2,48 %	(2,31 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index	2,09 %	(5,11 %)
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
E Class AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	1,56 %	(3,23 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	1,13 %	(6,10 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
E Class EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)	1,09 %	(4,19 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	0,74 %	(6,77 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
E Class GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)	1,91 %	(3,01 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	1,51 %	(5,70 %)
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
E Class HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	2,84 %	(1,90 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	2,51 %	(4,69 %)

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Income Fund II ist bestrebt, durch eine umsichtige Anlageverwaltung hohe laufende Erträge zu erzielen, wobei das sekundäre Ziel der langfristige Kapitalzuwachs ist. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement bei ausgewählten Währungen von Schwellenländern war der Wertentwicklung zuträglich, da die Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert gewannen.
- » Das Long-Engagement in Schuldtiteln mit Investment Grade und hochverzinslichen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in europäischen Residential und Commercial Mortgage Backed Securitys trug zur Wertentwicklung bei, da die Spreads schrumpften.
- » Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.
- » Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinsen einen Anstieg verzeichneten.
- » Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar nachgab.



# Inflation Multi-Asset Fund

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	0,54 %	1,09 %
Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 22. Mrz. 2022)	0,32 %	(7,06 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	0,10 %	(0,09 %)
E Class, ausschüttend II (Auflegung: 02. Aug. 2022)	0,08 %	(5,56 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	0,53 %	(5,00 %)
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 02. Aug. 2022)	0,05 %	(5,61 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (USD Hedged) <sup>3</sup>	0,81 %	1,05 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
E Class AUD (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2022)	(0,11 %)	(6,60 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (AUD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (AUD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (AUD Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (AUD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (AUD Hedged) <sup>3</sup>	0,36 %	(5,01 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2021)	(0,95 %)	(4,08 %)
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	(1,40 %)	(0,87 %)
Class E EUR (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	(1,41 %)	(0,87 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (EUR Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (EUR Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (EUR Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (EUR Hedged) <sup>3</sup>	(0,95 %)	0,55 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Mai 2014)	(1,22 %)	1,42 %
E Class GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2022)	(1,59 %)	(7,40 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (GBP Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (GBP Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (GBP Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (GBP Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (GBP Hedged) <sup>3</sup>	(1,20 %)	1,36 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 22. Feb. 2022)	0,08 %	(4,98 %)
E Class SGD (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2022)	(0,21 %)	(6,60 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (SGD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (SGD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (SGD Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (SGD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (SGD Hedged) <sup>3</sup>	0,38 %	(5,48 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Inflation Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 31. März 2017: 45 % Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Partial Hedged), 30 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD), 15 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % Bloomberg Gold Total Return Index; 01. April 2017 bis 12. April 2022: 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return; ab 13. April 2022: 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (USD Hedged)

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Inflation Multi-Asset Fund (ehemals Inflation Strategy Fund) ist bestrebt, den realen Kapitalwert durch eine umsichtige Anlageverwaltung zu erhalten. Der Fonds wird aktiv verwaltet und legt primär in ein diversifiziertes Portfolio an, das aus inflationsgekoppelten Anlagen besteht. Der Fonds ist bestrebt, sein Anlageziel durch eine Kombination aus globalen inflationsgekoppelten Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert), Schwellenmarktanleihen und -währungen, Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren sowie mit Rohstoffen und dem Immobiliensektor zusammenhängenden Instrumenten zu erreichen. Engagements in solchen Anlagen können durch direkte Anlagen oder die Verwendung von Finanzderivaten erreicht werden, wie im Verkaufsprospekt näher erläutert. Der Fonds verfolgt in Übereinstimmung mit seinen Anlagerichtlinien eine Multi-Asset-Anlagestrategie. Das Ziel der Strategie besteht darin, im Laufe der Zeit den Erhalt des Realkapitals zu erreichen, indem die Allokation zu verschiedenen inflationsgekoppelten Anlageklassen durchgeführt wird. Im Rahmen dieser Anlagestrategie wird die Anlageberatungsgesellschaft eine globale Prognose für Zinsen und Inflationsraten für die verschiedensten Volkswirtschaften sowie einen integrierten Anlageprozess, wie im Verkaufsprospekt beschrieben, verwenden.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die taktische Untergewichtung von Rohstoffen förderte die relative Wertentwicklung, da die Rohstoffpreise zurückgingen.
- » Die Kurvenpositionierung in auf Euro lautenden Derivaten, insbesondere die Untergewichtung des Engagements in Zinsswaps im 2-jährigen Bereich der Swapkurve, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Swapsätze im 2-jährigen Bereich der Kurve anstiegen.
- » Die Untergewichtung im Engagement bei nominalen deutschen Staatszinsen begünstigte die relative Wertentwicklung, da die nominalen deutschen Renditen anstiegen.
- » Die Untergewichtung im Engagement bei nominalen japanischen Staatszinsen belastete die relative Wertentwicklung, da die nominalen Renditen in Japan zurückgingen.
- » Die Titelauswahl in Immobilieninvestmentgesellschaften beeinträchtigte die relative Wertentwicklung.
- » Die Übergewichtung des Engagements in den japanischen Yen, die durch eine Untergewichtung des US-Dollars finanziert wurde, war der relativen Wertentwicklung abträglich, da der Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.



Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	0,83 %	2,23 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	0,83 %	2,22 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2004)	0,68 %	1,91 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 03. Jul. 2003)	0,74 %	1,80 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2004)	0,56 %	1,71 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	0,41 %	1,08 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	0,40 %	1,38 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Nov. 2009)	0,77 %	1,23 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	0,71 %	0,44 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,67 %	0,48 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index	0,97 %	1,73 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2012)	(0,31 %)	(0,28 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(0,37 %)	1,28 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jul. 2009)	(0,76 %)	(0,41 %)
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (EUR Hedged)	(0,23 %)	0,72 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	0,41 %	(0,33 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2010)	0,37 %	0,88 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (GBP Hedged)	0,50 %	0,43 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Average Duration Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement in ausgewählten Positionen an verbrieften Krediten, insbesondere Collateralized Loan Obligations (CLO), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in den brasilianischen Real trug zur Wertentwicklung bei, da der Real gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.
- » Das ausgewählte Engagement in hochverzinsliche Unternehmensanleihen, insbesondere im Sektor Finanzen, war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da die Spreads schrumpften.
- » Die Untergewichtung der Credit-Default-Swap-Indizes von Unternehmensanleihen mit Investment Grade war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads von Unternehmensanleihen mit Investment Grade verengten.
- » Die Untergewichtung in japanischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen einen Abstieg verzeichneten.
- » Die Übergewichtung des Engagements in hypothekenbesicherten Wertpapieren (MBS) mit Agency-Schuldtiteln schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads in diesem Sektor erweiterten.

## Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	2,01 %	1,68 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2021)	1,95 %	(2,38 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	1,94 %	1,70 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	0,80 %	0,05 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021)	0,84 %	(4,07 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	0,33 %	(0,85 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (EUR Hedged)	0,72 %	0,05 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	1,58 %	0,97 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021)	1,52 %	(2,91 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (GBP Hedged)	1,47 %	0,98 % <sup>2</sup>
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2017)	1,06 %	0,28 %
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (NOK Hedged)	1,03 %	0,54 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

### Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Unternehmens-Rentenpapieren mit Investment Grade-Qualität (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

### Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Wertpapierauswahl bei Banken trug zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Schuldtiteln einer ausgewählten Schweizer Bank aufgrund einer Übernahme durch einen höher bewerteten Wettbewerber überdurchschnittlich abschnitt.
- » Die Titelauswahl in Finanzgesellschaften trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung ausgewählter Emittenten gegenüber dem Gesamtmarkt überdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Untergewichtung regierungsnaher Unternehmen trug zur Wertentwicklung bei, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Makrostrategien und insbesondere die Kurvenpositionierung in den USA belasteten die Wertentwicklung.
- » Die Titelauswahl im Sektor Lebensmittel war der Wertentwicklung abträglich, da die Übergewichtung eines ausgewählten US-Emittenten zurückblieb.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,67 %	2,42 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,63 %	2,43 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,15 %	1,54 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Sep. 2018)	3,13 %	1,52 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung 03. Sep. 2020)	3,56 %	1,64 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Jan. 2022)	3,55 %	(0,05 %)
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index	1,15 %	1,06 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	2,52 %	0,35 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2021)	2,48 %	(1,82 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,99 %	(0,54 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	2,01 %	(0,53 %)
Class Z EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2020)	2,74 %	1,57 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (EUR Hedged)	(0,06 %)	(0,94 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,18 %	1,34 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,26 %	1,35 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (GBP Hedged)	0,69 %	0,15 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 14. Okt. 2020)	3,06 %	1,57 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (SGD Hedged)	0,57 %	(1,28 %)

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Income Fund strebt unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung attraktive Erträge an. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in Schultiteln mit Investment Grade und hochverzinslichen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in hypotheckenbesicherten europäischen und US-Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Das Long-Engagement bei ausgewählten Währungen von Schwellenländern war der Wertentwicklung zuträglich, da die Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert gewannen.
- » Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinsen einen Anstieg verzeichneten.
- » Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.
- » Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar nachgab.

# Low Duration Opportunities Fund

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	2,28 %	1,55 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019)	2,25 %	0,41 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021)	2,60 %	(2,94 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>1</sup>	2,40 %	1,43 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	1,15 %	(0,42 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Apr. 2018)	1,11 %	(1,16 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2018)	0,99 %	(1,57 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017)	0,79 %	(1,97 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>4</sup>	1,34 %	(0,16 %) <sup>3</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	1,85 %	0,60 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	1,77 %	(0,30 %)
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>5</sup>	2,06 %	0,77 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1 Month USD LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

<sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index

<sup>5</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Opportunities Fund (ehemals Global Libor Plus Bond Fund) beabsichtigt, einen höchstmöglichen langfristigen Gesamtertrag bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) unterschiedlicher Fälligkeiten anlegt. Der Fonds strebt Renditen an, die mittel- bis langfristigen ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (ein Maß der Rendite von Geldmarktpapieren) übersteigen. Hierfür investiert er auf Basis der Beurteilung globaler festverzinslicher Anlagen durch die Anlageberatungsgesellschaft flexibel in eine Vielzahl festverzinslicher Anlagen.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in brasilianische Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die brasilianischen Zinsen fielen.
- » Das Long-Engagement in den brasilianischen Real trug zur Wertentwicklung bei, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Das Long-Engagement in Collateralized Loan Obligations („CLO“) mit AAA-Rating leistete einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere negative Renditen verbuchten.
- » Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.
- » Das Long-Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Das Short-Engagement in polnische Zinsen war der Wertentwicklung abträglich, da die polnischen Zinsen fielen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,52 %	0,50 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,43 %	0,48 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index	2,40 %	3,78 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	0,31 %	(1,90 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	0,27 %	(1,89 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER)	1,35 %	1,68 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,02 %	(0,50 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,02 %	(0,53 %)
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	2,06 %	3,09 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Opportunities ESG Fund ist bestrebt, die maximal mögliche langfristige Rendite bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erzielen. Der Fonds verfolgt dieses Anlageziel, indem er unter normalen Bedingungen mindestens zwei Drittel des Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Anlagen mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Die durchschnittliche Portfolioduration dieses Fonds bewegt sich normalerweise zwischen 1 negativen bis 5 positiven Jahren, je nach der Prognose der Anlageverwaltungsgesellschaften für den Zinssatz. Der Fonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen ökologische und soziale Merkmale zu bewerten (wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt) und einen Teil des Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Long-Engagement in Investitionskredite trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Die Position bei hypothekenbesicherten Wertpapieren mit Agency-Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, insbesondere gegen Ende des Halbjahres, da sich die Spreads im Mai und Juni verengten.
- » Das Long-Engagement in Euro-Duration trug zur Wertentwicklung bei, insbesondere die Kurvenpositionierung, da sich die europäische Renditekurve weiter umkehrte.
- » Das Long-Engagement bei US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.
- » Das Short-Engagement in den Euro schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar nachgab.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	4,13 %	0,67 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	4,11 %	0,66 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	3,61 %	(0,51 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	4,66 %	7,63 %
Alerian MLP Index	9,70 %	(1,20 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	2,77 %	(1,36 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	2,75 %	(1,35 %)
Alerian MLP Index EUR (Hedged)	8,23 %	(2,91 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	3,65 %	(1,12 %)
Alerian MLP Index GBP (Hedged)	8,97 %	(2,79 %)

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Die vom Fonds angestrebte „Gesamtrendite“ besteht aus Ertrag und Kapitalzuwachs. Der Fonds ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er unter normalen Umständen zwei Drittel seines Nettovermögens entweder direkt oder indirekt in ein Portfolio aus Aktien anlegt, die verbunden sind mit (i) börsengehandelten Partnerships, die auch als Master Limited Partnerships („MLPs“) bezeichnet werden, (ii) den General Partners, die Eigentümer oder Manager von MLPs sind, (iii) Spin-Offs (Unternehmen, die nach Beteiligungsverkäufen oder Umstrukturierungen von den MLPs oder General Partner ausgegliedert werden) von MLPs, (iv) Unternehmen, die aufgrund dessen, dass sie in derselben Industrie tätig sind oder mit MLPs konkurrieren, MLPs ähnlich sind, (v) andere juristische Person, die ggf. nicht als börsengehandelte Partnership strukturiert sind, jedoch im Midstream-Energiesektor tätig sind (die Transportkomponente des Energieinfrastruktursektors wie Pipelines, Bahn und Öl sowie Öltanker) und (vi) Zweckgesellschaften (d. h. juristische Personen, die für einen bestimmten Zweck errichtet wurden, die ggf. als Anlagevehikel verwendet werden, um Zugang zu hier beschriebenen Anlagen zu erlangen). Der Fonds kann in diese Instrumente entweder auf dem Sekundärmarkt oder während einer Neuemission anlegen.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement bei Aktien von Midstream-Energieunternehmen begünstigte die absolute Rendite, da der Sektor positive Renditen verzeichnete.
- » Die Titelauswahl im Sektor Nicht-Basiskonsumgüter trug zur relativen Rendite bei, da sich die Position des Fonds in diesem Sektor überdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl bei Verflüssigungsunternehmen trug zur relativen Rendite bei, da sich die Position des Fonds in diesem Sektor überdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Untergewichtung von Marketing- und Vertriebsunternehmen trug zu den relativen Renditen bei, da der Sektor negative Renditen erzielte.
- » Die Titelauswahl im Teilsektor für Erdgasbeförderung in Pipelines war den relativen Renditen abträglich, da sich die Position des Fonds in diesem Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Untergewichtung des Teilsektors für Erdgasbeförderung in Pipelines belastete die relativen Renditen, da der Teilsektor eine Outperformance erzielte und sich die Position des Fonds in diesem Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,23 %	1,47 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,35 %	1,49 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2017)	2,14 %	0,83 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,13 %	1,13 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,03 %	0,98 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,86 %	0,58 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,87 %	0,57 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mai 2020)	2,22 %	0,35 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>	2,40 %	1,73 % <sup>2</sup>
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Jun. 2021)	2,05 %	(2,68 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (CAD Hedged) <sup>3</sup>	2,13 %	1,74 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,21 %	(1,02 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2017)	(0,12 %)	(2,42 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (CHF Hedged) <sup>3</sup>	0,30 %	(0,79 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,15 %	(0,54 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,11 %	(0,54 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,66 %	(1,44 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>	1,25 %	(0,27 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,88 %	0,48 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,92 %	0,47 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>	1,96 %	0,76 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Mortgage Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Mortgage Opportunities Fund beabsichtigt, einen höchstmöglichen langfristigen Ertrag bei gleichzeitiger umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Nettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus mit Hypotheken verbundenen festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) investiert, zu denen unter anderem Agency- und Non-Agency-RMBS und CMBS sowie Wertpapiere zur Übertragung von Kreditrisiken zählen können.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement in vorrangigen forderungsbesicherten Wertpapieren (ABS) begünstigte die Wertentwicklung, da die Anlageklasse positive Renditen erzielte.
- » Das Engagement in vorrangigen Residential Mortgage-Backed Securitys (RMBS) kam der Wertentwicklung zugute, da sich die Spreads verschmälerten.
- » Das Engagement in vorrangigen Collateralized Loan Obligations (CLO) trug zur Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse eine positive Rendite verzeichnete.
- » Die „Relative Value“-Strategien mit MBS mit Agency-Schuldtiteln belasteten die Wertentwicklung, da sich die Spreads leicht ausweiteten
- » Das Engagement in US-Zinsen belastete die Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.
- » Positionen in hypotheckenbesicherten Wertpapieren (MBS) mit strukturierten Agency-Schuldtiteln, insbesondere endfällige Positionen, schmälerten die Wertentwicklung, da der Sektor negative Renditen erzielte.



Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	16,81 %	7,18 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2001)	16,81 %	8,41 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Jan. 1999)	16,61 %	6,68 %
BE Retail, thesaurierend (Auflegung: 28. Apr. 2022)	15,59 %	0,09 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	16,27 %	8,58 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	16,67 %	9,36 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	16,60 %	6,78 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	15,35 %	10,98 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 02. Aug. 2017)	14,81 %	7,62 %
S&P (EUR Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	14,97 %	10,64 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2021)	16,05 %	(0,10 %)
S&P (GBP Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	15,69 %	2,04 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Apr. 2022)	16,21 %	1,51 %
S&P 500 (SGD Hedged) Index (Net Total Return)	17,65 %	3,70 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der StocksPLUS™ Fund ist bestrebt, eine bessere Rendite als die Entwicklung der Gesamtrendite von Standard & Poor's 500 Composite Stock Price Index („S&P 500“) zu erzielen. Dazu wendet der Fonds eine gesellschaftseigene Portfolioverwaltungsstrategie an, die ein aktiv verwaltetes Portfolio festverzinslicher Wertpapiere (wie im Verkaufsprospekt angegeben) mit einem Engagement in den S&P 500 verbindet. Der Fonds darf unbeschränkt in Aktien und Wertpapiere anlegen, die sich in Aktien wandeln lassen.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement des Fonds bei mit dem S&P 500 Index verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 Net Total Return Index eine Rendite in Höhe von 16,60 % verbuchte.
- » Die Alpha-Anleihestrategie des Fonds trug zur Rendite bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
  - » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Rendite bei, die Positionen wurden erhöht und der Wert dieser Anleihen stieg anschließend.
  - » Die Position bei hypotheckenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitle trugen zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen zulegte.
  - » Das Long-Engagement in US-Zinssätzen waren der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze anstiegen.
  - » Das Short-Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019)	17,20 %	12,47 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	16,60 %	12,51 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2021)	16,65 %	0,10 %
S&P (GBP Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	15,69 %	2,04 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er die unternehmenseigene Portfoliomanagementstrategie der Anlageberatungsgesellschaft verfolgt, die als „StocksPLUS“ bekannt ist (sie kombiniert ein aktiv verwaltetes, aus Renteninstrumenten bestehendes Portfolio mit Engagements in Aktienwerten). Renteninstrumente sind Darlehen ähnlich und zahlen feste oder variable Zinsen.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement des Fonds bei mit dem S&P 500 Index verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 Net Total Return Index eine Rendite in Höhe von 16,60 % verbuchte.
- » Die Alpha-Anleihestrategie des Fonds trug zur Rendite bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
  - » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen stieg.
  - » Die Positionen bei Collateralized Loan Obligations trugen zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen zulegte.
  - » Das Long-Engagement in US-Zinssätzen waren der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze anstiegen.
  - » Das Long-Engagement in hypotheckenbesicherten Wertpapieren mit Agency-Sicherungen schmälerte die Wertentwicklung, da die ausgewählten Anleihen an Wert verloren.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	3,38 %	2,86 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	2,93 %	3,34 %
Class E, ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	2,91 %	3,33 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index <sup>3</sup>	2,53 %	3,55 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	2,19 %	2,86 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	1,87 %	1,92 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	1,81 %	1,92 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,62 %	0,75 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,67 %	0,77 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (EUR Hedged)/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>	1,27 %	2,19 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jul. 2022)	2,98 %	1,88 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (GBP Hedged)/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>	2,05 %	(2,52 %)

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Strategic Income Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 26. Juli 2016: 75 % Bloomberg Global Aggregate Index Hedged USD/25 % MSCI All Country World Index; 27. Juli 2016 bis 28. Juli 2022: 75 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index; ab 29. Juli 2022: 75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Strategic Income Fund strebt unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung attraktive laufende Erträge an. Das sekundäre Anlageziel besteht im langfristigen Kapitalzuwachs. Der Fonds verwendet eine globale Multi-Sektor-Strategie, mit der der Gesamtrendite-Anlageprozess und die Philosophie der Anlageverwaltungsgesellschaften mit der Ertragsmaximierung kombiniert werden sollen. Die Portfoliokonstruktion beruht auf dem Prinzip der Diversifizierung in die verschiedensten internationalen Renten- und Aktienwerte.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

**Paket mit festverzinslichen Anlagen:**

- » Die Positionen in Hochzinsanleihen trugen zur Wertentwicklung bei, da die Spreads auf diese Wertpapiere schrumpften.
- » Die Positionen in Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Das Long-Engagement in russischen lokalen Staatsanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere an Wert gewannen.
- » Das Long-Engagement in den brasilianischen Real war der Wertentwicklung zuträglich, da die Währung gegenüber dem US-Dollar nachgab.
- » Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinsen einen Abstieg verzeichneten.
- » Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.
- » Die Positionen bei hypotheckenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel schmälerten die absolute Wertentwicklung, da diese Wertpapiere an Wert verloren.
- » Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

**Paket mit Aktien:**

- » Die Titelauswahl im Sektor Finanzen trug zur relativen Rendite bei, da sich die Positionen des Fonds im Sektor Finanzen besser entwickelten als die des Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Sektor Energie trug zur relativen Rendite bei, da sich die Positionen des Fonds im Sektor Energie besser entwickelten als die des Vergleichsindex.
- » Die Untergewichtung des Engagements und die Titelauswahl im Sektor Versorgung trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und sich die Positionen des Fonds im Sektor Versorgung besser entwickelten als die des Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Sektor Basiskonsumgüter belastete die relative Rendite, da sich die Positionen des Fonds im Sektor Basiskonsumgüter schlechter entwickelten als die des Vergleichsindex.
- » Die Übergewichtung des Engagements und die Titelauswahl im Sektor Gesundheitswesen belasteten die relative Rendite, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und sich die Positionen des Fonds im Sektor Gesundheitswesen schlechter entwickelten als die des Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Sektor Industrie belastete die relative Rendite, da sich die Positionen des Fonds im Sektor Industrie schlechter entwickelten als die des Vergleichsindex.

**Taktisches Paket**

- » Es gab ansonsten keine Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag zu diesem Fonds leisteten.
- » Das Engagement in den Sektor Immobilien belastete die Rendite, da der Sektor negative Renditen verzeichnete.

# Total Return Bond Fund

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 1998)	2,15 %	4,35 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2000)	2,17 %	4,32 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Jan. 1999)	1,96 %	3,79 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2000)	1,98 %	3,75 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2003)	1,91 %	2,88 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2022)	1,90 %	(2,20) %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,69 %	2,61 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	1,71 %	2,52 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	2,07 %	3,51 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	2,09 %	0,38 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	1,53 %	(0,08) %
Bloomberg U.S. Aggregate Index	2,09 %	3,94 % <sup>2</sup>
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Mai 2013)	1,82 %	0,84 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CAD Hedged) Index	1,74 %	1,02 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	0,00 %	(0,18) %
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	(0,21) %	(0,52) %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Sept. 2012)	(0,48) %	(1,71) %
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(0,16) %	(0,16) % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2003)	0,83 %	2,48 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	0,83 %	2,38 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2004)	0,66 %	1,99 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2009)	0,65 %	0,64 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	0,36 %	1,57 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	0,37 %	(0,82) %
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,65 %	(0,70) %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,23 %	(1,76) %
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	0,74 %	2,06 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2002)	(0,07) %	2,98 %
E Class EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Mrz. 2021)	(0,52) %	(2,27) %
Bloomberg U.S. Aggregate Index (EUR Unhedged) Index	(0,13) %	2,65 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Mrz. 2010)	1,63 %	1,66 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	1,71 %	3,21 %
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	1,51 %	2,82 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	2,14 %	0,31 %
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	2,51 %	1,39 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jan. 2011)	1,48 %	1,71 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	0,39 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	1,02 %	2,08 %
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	1,40 %	2,61 % <sup>2</sup>

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Total Return Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die taktische US-Durationspositionierung, insbesondere eine Übergewichtung des mittleren Bereichs der Renditekurve, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen im Q1 2023 einen Verlust verzeichneten.
- » Die Positionen in hypothekenbesicherten Wertpapieren (MBS) ohne Agency-Schuldtitel und anderen verbrieften Vermögenswerten trugen besonders in Q2 zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Auswahl in Unternehmensanleihen mit Investment Grade, insbesondere eine Bevorzugung von Finanzwerten, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Spreads im Q2 2023 schrumpften.
- » Die Zinsstrategien in der Eurozone, insbesondere eine Tendenz, einen steileren Verlauf der Kurve zu erzielen, schmälerten die relative Wertentwicklung, da sich die Kurve abflachte.
- » Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Renditen zurückgingen.

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(1,88 %)	2,87 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(2,12 %)	(7,70 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(2,46 %)	1,75 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	(1,97 %)	(0,70 %)
Z Class, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2021)	(1,25 %)	6,64 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>	2,40 %	1,51 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(2,92 %)	1,15 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(3,09 %)	(9,00 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Jun. 2015)	(3,46 %)	0,05 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>	1,25 %	(0,18 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2022)	(2,23 %)	(3,40 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(2,27 %)	(7,94 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>	1,96 %	2,63 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO TRENDS Managed Future Strategy Fund strebt positive risikobereinigte Renditen unter umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er unter normalen Umständen in Derivate auf Zinsen, Währungen, hypothekarisch besicherte Wertpapiere (wie im Verkaufsprospekt des Fonds dargestellt), Schuldtitel, Aktienindizes, volatilitätsbezogene Instrumente (einschließlich u.a. Futures auf volatilitätsbezogene Indizes) und rohstoffbezogene Instrumente (wie im Verkaufsprospekt des Fonds dargestellt) investiert.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Der PIMCO GIS TRENDS Managed Futures Strategy Fund strebt positive, risikobereinigte Renditen im Einklang mit einer umsichtigen Anlageverwaltung an, indem er eine quantitative Handelsstrategie verfolgt, die darauf abzielt, die an den globalen Finanzmärkten beobachtete Beständigkeit von Kurstrends (nach oben und/oder unten) zu erfassen. Die Anlagestrategie des Fonds stellt eine Kombination aus Finanzterminkontrakten und Derivaten dar, die darauf ausgelegt sind, ein Engagement in globalen Preistrends auf den Finanzmärkten zu ermöglichen. Innerhalb der Allokationen der Strategie werden die Kontrakte entweder Long- oder Short-Positionen basierend auf verschiedenen Merkmalen hinsichtlich ihrer Kurse aufweisen.
- » Die Positionierung in kanadischen, chilenischen und ungarischen Zinssätzen belastete die Wertentwicklung aufgrund von Kursumschwüngen.
- » Die Positionierung im thailändischen Baht, in der indischen Rupie und in der indonesischen Rupiah belastete die Wertentwicklung aufgrund von Kurswenden.
- » Die Long-Positionen im mexikanischen und im kolumbianischen Peso trugen zur Wertentwicklung bei, da die Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert zulegten. Die Short-Positionen im chinesischen Yuan trugen zur Wertentwicklung bei, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Die Long-Positionen in japanischen, europäischen und US-amerikanischen Aktienindizes trugen aufgrund von Kurssteigerungen zur Wertentwicklung bei.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2007)	(1,47 %)	3,82 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2016)	(1,44 %)	(0,54 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2019)	(1,29 %)	(4,62 %)
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	(1,06 %)	3,60 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der UK Corporate Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds legt mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf GBP lautenden festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten an. Dabei handelt es sich um direkte Beteiligungen an festverzinslichen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder derivativen Instrumenten, wie insbesondere Optionen, Futures, Swaps oder Credit Default Swaps.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl im Sektor Einzelhandel trug zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung ausgewählter Emittenten aufgrund einer Steigerung der Profitabilität eine Outperformance erzielte.
- » Die Titelauswahl im Sektor Immobilienfonds trug zur Wertentwicklung bei, da die Untergewichtung eines ausgewählten Emittenten aufgrund von Bedenken bzgl. der Auswirkungen höherer Zinssätze und strafferer Finanzbedingungen hinter dem Gesamtmarkt zurückblieb.
- » Makrostrategien und insbesondere eine Übergewichtung der britischen Duration belasteten die Wertentwicklung, da die Zinssätze aufgrund einer unerwartet hohen Inflation und steigender Leitzinsen abverkauft wurden.
- » Die Titelauswahl in den Sektoren Bankwesen und Brokerage war der Wertentwicklung abträglich, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere in einer ausgewählten Schweizer Bank unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Übergewichtung des Engagements in der Versorgung beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.

Gesamterrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	(3,05 %)	3,64 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Aug. 2008)	(3,02 %)	4,54 %
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index <sup>3</sup>	(1,62 %)	3,29 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den UK Long Term Corporate Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. März 2013: Markt iBoxx Sterling Non-Gilts 10+ Index; ab 31. März 2013: ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der UK Long Term Corporate Bond Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Pfund Sterling lautenden Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Untergewichtung von verbrieften Wertpapieren, die sich unterdurchschnittlich entwickelten, trug zur Wertentwicklung bei.
- » Die Titelauswahl im Sektor Einzelhandel trug zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung eines ausgewählten Emittenten aufgrund angekündigter Einsparmaßnahmen zwecks Steigerung der Profitabilität eine Outperformance erzielte.
- » Die Titelauswahl in den Sektoren Bankwesen und Brokerage war der Wertentwicklung abträglich, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere in einer ausgewählten Schweizer Bank unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Makrostrategien und insbesondere eine Übergewichtung der britischen Duration belasteten die Wertentwicklung, da die Zinssätze aufgrund einer unerwartet hohen Inflation und einer wiederholten Zinsanpassung abverkauft wurden.
- » Die Titelauswahl im Sektor Immobilien war der Wertentwicklung abträglich, da das Engagement in einen ausgewählten Emittenten von Immobilieninvestmentfonds aufgrund von Druck auf die Vermögenswerte und negativen Ratings eine Underperformance aufwies.



Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Mai 1998)	5,36 %	5,43 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	5,28 %	5,74 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 1999)	5,16 %	5,08 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 14. Jan. 1999)	5,20 %	5,06 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	4,87 %	4,16 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	4,90 %	4,24 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	5,26 %	6,45 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	5,35 %	0,07 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 11. Jan. 2012)	4,89 %	3,83 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,23 %	3,84 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 29. Jun. 2016)	5,58 %	4,52 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index <sup>3</sup>	5,42 %	5,64 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	4,03 %	4,77 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	4,01 %	4,00 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Feb. 2003)	3,86 %	4,69 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	3,54 %	3,01 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>	4,02 %	5,44 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	4,81 %	5,38 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	4,82 %	2,59 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>	4,78 %	5,86 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den US High Yield Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 31. März 2015: ICE BofA Merrill Lynch US High Yield, BB-B Rated, Constrained Index; seit dem 01. April 2015: ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US High Yield Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hoch verzinslichen Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die von Moody's mit Baa oder von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl in den Sektoren Glücksspiel und Hotellerie trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor und die Übergewichtung ausgewählter Emittenten den Gesamtmarkt aufgrund der starken Verbrauchernachfrage nach Freizeit- und Unterhaltungsdienstleistungen übertrafen.
- » Die Titelauswahl im Sektor Dienstleistungen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung ausgewählter Emittenten überdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl im Sektor Gesundheitswesen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung ausgewählter Emittenten überdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl in den Sektoren Medien, Unterhaltung und Verlagswesen war der Wertentwicklung abträglich, da die Übergewichtung ausgewählter Emittenten hinter den Erwartungen zurückblieb.
- » Die Untergewichtung und die Titelauswahl im Einzelhandel beeinträchtigten die Wertentwicklung, da der Sektor den Gesamtmarkt übertraf, während die Übergewichtung eines ausgewählten Emittenten eine Underperformance aufwies.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	3,89 %	1,36 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	3,96 %	1,36 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	3,44 %	(2,79 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	3,46 %	(0,45 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	3,81 %	0,90 %
Bloomberg U.S. Credit Index	3,13 %	1,35 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	2,60 %	(0,81 %)
Bloomberg U.S. Credit Index (EUR Hedged)	1,70 %	(0,86 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 15. Sep. 2016)	3,35 %	0,13 %
Bloomberg U.S. Credit Index (GBP Hedged)	2,49 %	0,16 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US Investment Grade Corporate Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein breit gefächertes Portfolio von auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit Investment Grade (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Diese enthalten Beteiligungen an kreditnahen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder derivativen Instrumenten, wie Optionen, Terminkontrakte oder Credit Default Swaps, wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben.

## Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Wertpapierauswahl bei Banken und Brokerage trug zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Schudttiteln eines ausgewählten europäischen Emittenten aufgrund einer Übernahme durch einen höher bewerteten Wettbewerber überdurchschnittlich abschnitt.
- » Makrostrategien und insbesondere die US-Durationspositionierung sowie das Engagement in lokalen Zinssätzen von Schwellenländern leisteten einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung.
- » Die Titelauswahl im Sektor Versorgung trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung eines ausgewählten Emittenten überdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Übergewichtung und die Titelauswahl im Bereich Finanzen „Sonstiges“ beeinträchtigten die Wertentwicklung, da eine ausgewählte Übergewichtung des US-Spezialkreditgebers aufgrund der allgemein schwachen US-Finanzwerte zurückblieb.
- » Das Engagement in verbrieften Produkten schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte forderungsbesicherte und gewerbliche hypothekebesicherte Wertpapiere zurückblieben.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum:

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	2,55 %	1,71 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2020)	2,65 %	1,44 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	2,36 %	1,36 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	2,37 %	1,32 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	2,50 %	1,46 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 07. Aug. 2014)	2,77 %	2,18 %
FTSE 3-Month Treasury Bill Index	2,39 %	1,08 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	1,51 %	0,08 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Jun. 2016)	1,26 %	(0,47 %)
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged)	1,10 %	(0,60 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2023)	—	0,50 %
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (GBP Hedged)	1,81 %	0,38 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US Short-Term Fund ist bestrebt, bei Kapitalerhaltung und täglicher Liquidität höchstmögliche laufende Erträge zu erzielen. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten, die von Organisationen des öffentlichen und privaten Sektors in den USA und außerhalb der USA ausgegeben werden. Die durchschnittliche Duration des Portfolios dieses Fonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaften. Es wird nicht davon ausgegangen, dass sie länger als ein Jahr ist. Der Fonds wird seine Wertentwicklung auf einen Vergleichszinssatz des FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index beziehen. Bei dem FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert.

Kommentare zum Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Übergewichtung des Engagements bei Finanzwerten mit Investment Grade und nachrangigen Finanzwerten trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Untergewichtung des Engagements in US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Die Übergewichtung des Engagements in Collateralized Loan Obligations war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.
- » Die Untergewichtung der Credit-Default-Swap-Indizes von Unternehmensanleihen mit Investment Grade war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads von Unternehmensanleihen mit Investment Grade verengten.
- » Die Auswahl von hypotheckenbesicherten Wertpapieren mit Agency-Schuldtiteln schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Spreads schrumpften.

## Beschreibungen der Vergleichsindizes

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
<b>1 Month NIBOR Rate Index</b>	Der 1 Month NIBOR (Norwegian Interbank Offered Rate) Index ist ein durchschnittlicher Zinssatz, der von der Norges Bank bestimmt wird. Er leitet sich vom Zinssatz eines vergleichbaren Darlehens am US-Dollarmarkt zuzüglich des Zinssatzdifferentials zwischen dem norwegischen Krone und dem US-Dollar am Devisenterminmarkt ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index, JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified; alle abgesichert in USD</b>	Der Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Rentenmärkte von Industrieländern. Der ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index bildet die Wertentwicklung von Unternehmensanleihen mit einem Rating unter Investment Grade nach, die in Industrieländern ansässig sind und ein Rating von BB1 bis B3 aufweisen, basierend auf einem Durchschnitt von Moody's, S&P und Fitch. Der Index passt die Wertpapiergewichtungen an, um die Gesamtrisikoscores für Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („SGU“) des Index aufzuwerten. Der JP Morgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified bildet die Gesamttrenden von auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumenten nach, die von staatlichen und quasi-staatlichen Emittenten aus Schwellenländern begeben werden und die Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungsfaktoren in die Indexaufbau einbeziehen.
<b>Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged)</b>	Der Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (USD Hedged) bietet ein weites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Rentenmärkte von Industrieländern. ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Währungsverbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index beinhaltet auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautenden Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P, sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2 %-Deckelung entsprechend proportional. Vor dem 25. September 2009 waren die ICE BofA Merrill Lynch-Indizes als Merrill-Lynch-Indizes bekannt. Der JPMorgan EMBI Global (USD Hedged) bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbrieft Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>3 Month HIBOR Index</b>	Der 3 Month HIBOR (Hong Kong Interbank Offered Rate) Index ist ein Referenzzinssatz, der den durchschnittlichen Zinssatz abbildet, zu dem eine Reihe von Banken, die von der Hong Kong Association of Banks bestimmt wurden, bereit sind, sich untereinander unbesicherte Kredite zu verschiedenen Laufzeiten zu gewähren.
<b>45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (USD Hedged)</b>	Der Vergleichsindex ist eine Mischung aus: 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30 Year Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (USD Hedged) Mit dem Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index wird die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen aus Industrieländern gemessen. Er ist nach Marktkapitalisierung gewichtet und umfasst Laufzeiten bis zu 30 Jahren. Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 24 Schwellenmarktländern nach. Der Bloomberg Commodity Total Return Index spiegelt die Rendite vollständig besicherter Positionen in den zugrundeliegenden Rohstoffterminkontrakten einiger physischer Rohstoffe wider. Der Index wurde als hoch liquider und diversifizierter Vergleichsindex für Rohstoffe als Vermögensklasse geschaffen. Der FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der darauf ausgelegt ist, die Wertentwicklung börsennotierter Immobilienunternehmen weltweit abzubilden. Der Bloomberg Gold Subindex Total Return Index spiegelt die Rendite vollständig besicherter Positionen in den zugrundeliegenden Rohstoffterminkontrakten wider. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht anlegen.
<b>50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged</b>	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 50 % JPMorgan EMBI Global Index/50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged). Der JPMorgan EMBI Global Index bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbrieft Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen und Eurobonds. Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged)</b>	Der Vergleichsindex besteht aus einer Mischung von 60 % MSCI All Country World Index (ACWI) und 40 % Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index. Der MSCI All Country World Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der zur Messung Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrie- und Schwellenländern gedacht ist. Der Index besteht aus 47 Länderindizes, von denen 23 Indizes von Industrieländern und 23 Indizes von Schwellenländern sind. Der Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

<b>Offizieller Name des Vergleichsindex</b>	<b>Beschreibung des Index</b>
<b>75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index</b>	Der MSCI ACWI High Dividend Yield Index basiert auf dem MSCI ACWI (EUR Hedged), dessen Hauptindex, und beinhaltet Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung aus 23 Industrie- und 24 Schwellenländern. Der Index soll die Wertentwicklung von Aktien im Hauptindex (mit Ausnahme von REIT) mit höheren Dividendenerträgen und Qualitätsmerkmalen als durchschnittliche Dividendenrenditen widerspiegeln, die sowohl nachhaltig als auch beständig sind. Im Index gibt es auch Qualitätsprüfungen; er prüft die Wertentwicklung der letzten 12 Monate, um Aktien mit sich möglicherweise verschlechternden Fundamentaldaten auszulassen, die ihn zwingen könnten, Dividenden zu kürzen oder zu senken. Der Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf Dollar lauten. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatsstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. Diese Hauptsektoren unterteilen sich in spezifischere Indizes, die regelmäßig berechnet und veröffentlicht werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Alerian MLP Index</b>	Der Alerian MLP Index ist der führende Maßstab für Master Limited Partnership (MLPs) aus dem Energiesektor mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung. Es handelt sich um einen um Streubesitz bereinigten, marktkapitalisierungsgewichteten Index, der 50 führende Unternehmen umfasst.
<b>Bloomberg AusBond Bank Bills Index</b>	Der Bloomberg AusBond Bank Bills Index ist ein nicht verwalteter Index, der die Gesamtertragsleistung australischer Geldmarktpapiere abbildet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg Commodity Index Total Return</b>	Der Bloomberg Commodity Index Total Return ist ein nicht verwalteter Index aus Terminkontrakten auf eine Reihe physischer Rohstoffe. Der Index wurde als hoch liquider und diversifizierter Vergleichsindex für Rohstoffe als Vermögensklasse geschaffen. Die Futures-Engagements der Benchmark sind durch US-Schatzwechsel besichert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index</b>	Der Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index repräsentiert die Komponente Euro Aggregate 1-10 Year des Bloomberg Pan-European Aggregate Index. Der Bloomberg Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index</b>	Der Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index ist die Anleihekomponekte des Bloomberg Euro-Aggregate Index. Der Bloomberg Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) + 15 Jahre Index</b>	Der Bloomberg Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) + 15 Jahre Index repräsentiert Staatsanleihen aus Deutschland, Frankreich und den Niederlanden mit einer Laufzeit von über 15 Jahren und ist Komponente des Bloomberg Euro-Aggregate Index. Dieser besteht wiederum aus Anleihen, die in Euro oder Altwährungen von 17 Mitgliedstaaten der Europäischen Währungsunion (EWU) begeben wurden. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen.
<b>Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index</b>	Der Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)</b>	Beim Bloomberg Global Aggregate Credit Index 1-5 Years Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht verwalteten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade mit einer Laufzeit von mindestens einem 1 Jahr und weniger als 5 Jahren bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatsstitel und verbrieft Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade.



## Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
<b>Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)</b>	Beim Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit-Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht verwalteten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbrieft Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index</b>	Der Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Der Index enthält auch Eurodollar- und Euro-Yen-Unternehmensanleihen, kanadische Staats-, Agency- und Unternehmenswertpapiere sowie auf USD lautende 144A-Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating.
<b>Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)</b>	Der Bloomberg MSCI Green Bond Index, USD Hedged bietet Anlegern ein objektives und robustes Maß für den globalen Markt für festverzinsliche Wertpapiere, die zur Finanzierung von Projekten mit direktem Umweltnutzen ausgegeben werden. Es wird eine unabhängige, analysegestützte Methodik verwendet, um indexfähige grüne Anleihen zu bewerten und sicherzustellen, dass sie die etablierten Green-Bond-Prinzipien einhalten, und um die Anleihen nach der umweltfreundlichen Verwendung ihrer Erlöse zu klassifizieren. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg U.S. Aggregate Index</b>	Der Bloomberg U.S. Aggregate Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf Dollar lauten. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. Diese Hauptsektoren unterteilen sich in spezifischere Indizes, die regelmäßig berechnet und veröffentlicht werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index</b>	Der Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind, auf US-Dollar lauten und eine Laufzeit zwischen ein und drei Jahren haben. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg U.S. Credit Index</b>	Bei dem Bloomberg U.S. Credit Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der aus öffentlich begebenen Schuldverschreibungen von Unternehmen und bestimmten nicht US-amerikanischen Emittenten sowie besicherten Anleihen besteht, die bestimmten Anforderungen in Bezug auf Laufzeit, Liquidität und Qualität entsprechen. Um für den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen bei der SEC registriert sein. Dieser Index wurde zuvor als Bloomberg Credit Investment Grade Index bezeichnet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index</b>	Mit dem Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index wird die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen gemessen. Der Index umfasst von den folgenden Ländern emittierte, inflationsgekoppelte Schuldtitel: Australien, Kanada, Frankreich, Schweden, das Vereinigte Königreich und die USA. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)</b>	Bei dem Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) handelt es sich um einen Index, der die Wertentwicklung der weltweiten Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen mit einer Laufzeit von mindestens 1 Jahr und weniger als 5 Jahren misst. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)</b>	Mit dem Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) werden die Finanzierungskosten von allgemeinen Übernacht-Sicherheiten in kanadischen Dollar gemessen, wobei Staatsanleihen und Anleihen der kanadischen Regierung als Sicherheit für Pensionsgeschäfte eingesetzt werden.
<b>Euro Short-Term Rate (ESTER) Index</b>	ESTER spiegelt die Kosten für unbesicherte Euro-Übernachtkredite von Banken im Euroraum wider. ESTER wird an jedem Tag veröffentlicht, an dem das Trans-European Automated Real-time Gross Settlement Express Transfer-Zahlungssystem (oder ein Nachfolgesystem) für die Abwicklung von Zahlungen in Euro geöffnet ist. ESTER beruht auf Transaktionen, die am vorangegangenen Geschäftstag (dem Stichtag „T“) mit einer Fälligkeit von T+1 durchgeführt und abgewickelt wurden und von denen angenommen wird, dass sie zu marktüblichen Bedingungen ausgeführt wurden, so dass sie die Marktzinsen unverzerrt widerspiegeln.
<b>FTSE 3-Month Treasury Bill Index</b>	Bei dem FTSE 3-Month Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht verwalteten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der US-Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>FTSE Euro Broad Investment-Grade Index</b>	Bei dem FTSE Euro Broad Investment Grade Index handelt es sich um einen Index des auf Euro basierenden Rentenmarkts der Kategorie Investment Grade, der institutionellen Anlegern (in Euro) zugänglich ist. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index</b>	Bei dem ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index handelt es sich um einen nicht verwalteten Index, der US Treasuries (ausgenommen inflationsbesicherte Wertpapiere und STRIPS) mit mindestens 1 Milliarde USD umlaufendem Nennwert und einer Restlaufzeit bis zur endgültigen Fälligkeit von mindestens einem und weniger als drei Jahren enthält. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged)</b>	Der ICE BofA Merrill Lynch 3-Month US Treasury Bill Index (EUR Hedged) umfasst eine einzige Emission, die zu Monatsbeginn gekauft und für einen vollen Monat gehalten wird. Am Monatsende wird diese Emission verkauft und in eine neu ausgewählte Emission angelegt. Die bei der Neugewichtung am Monatsende jeweils gewählte Emission ist der ausstehende Schatzwechsel, dessen Fälligkeitstermin am nächsten am Datum der Neugewichtung liegt, wobei er jedoch nicht mehr als drei Monate nach diesem Datum liegen darf. Um für die Wahl berücksichtigt zu werden, muss eine Emission am oder vor dem Neugewichtungsdatum am Monatsende abgewickelt worden sein. Der Index hält zwar oft den im Rahmen der jüngsten 3-Monats-Auktion ausgegebenen Schatzwechsel, es kann jedoch auch ein älterer 6-Monats-Wechsel gewählt werden.

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	Der Index ist so konzipiert, dass er die Wertentwicklung von auf EUR und GBP lautenden Unternehmensanleihen mit einem Rating unterhalb von Investment Grade abbildet, die auf den Eurobond-, GBP- oder EUR-Inlandsmärkten öffentlich begeben wurden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einem Durchschnitt aus Moody's, S&P sowie Fitch verfügen. Das Engagement gegenüber einzelnen Emittenten im Index ist auf 3 % beschränkt. Nähere Einzelheiten zum Index, einschließlich einer aktuellen Beschreibung seiner Duration, sind auf Anfrage von der Anlageberatungsgesellschaft erhältlich.
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD	Der ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieländern nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Währungsverbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index beinhaltet auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautenden Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P, sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2 %-Deckelung entsprechend proportional. Vor dem 25. September 2009 waren die ICE BofA Merrill Lynch-Indizes als Merrill-Lynch-Indizes bekannt.
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	Der ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index besteht aus auf Pfund Sterling lautenden Anleihen der Kategorie Investment Grade; ausgenommen sind auf Sterling lautende, von der britischen Regierung begebene Anleihen. Alle im Index vertretenen Anleihen müssen von mindestens einer der großen Ratingagenturen als Anlagen von Investment-Grade eingestuft werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	Der ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index bildet die Wertentwicklung von auf Pfund Sterling lautenden erstklassigen öffentlichen Schuldtiteln von Unternehmens- und quasistaatlichen Emittenten sowie Emittenten außerhalb des Vereinigten Königreichs ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA Merrill Lynch U.S. High Yield Constrained Index	Der ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index bildet die Wertentwicklung von auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade ab, die am US-Inlandsmarkt öffentlich emittiert werden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen Wertpapiere über ein Rating unterhalb von Investment Grade (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch) und ein Risikoland mit Investment Grade-Rating (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch für auf Fremdwährung lautende Staatsanleihen mit langer Laufzeit) verfügen.
ICE BofA SARON Overnight Rate Index	Der ICE BofA SARON Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der SORAN bis zu einer angegebenen Laufzeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert mit genau der angegebenen Laufzeit und einem Kupon in Höhe des Fixing-Kurses dieses Tages. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird.
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index	Der ICE BofA SOFR Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der SOFR bis zu einer angegebenen Laufzeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert mit genau der angegebenen Laufzeit und einem Kupon in Höhe des Fixing-Kurses dieses Tages. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	Der ICE BofA SONIA Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der SONIA bis zu einer angegebenen Laufzeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert mit genau der angegebenen Laufzeit und einem Kupon in Höhe des Fixing-Kurses dieses Tages. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird.
JPMorgan Asia Credit Index	Mit dem JPMorgan Asia Credit Index wird die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan gemessen. Der Index bietet eine Vergleichsindex für Anlagemöglichkeiten in auf USD lautenden festverzinslichen Anlagen, die von staatlichen, quasi-staatlichen und halbstaatlichen Emittenten aus Asien (ohne Japan) begeben werden.
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	Bei dem JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) handelt es sich um eine besondere, gewichtete Version des CEMBI-Index. Er beschränkt den Anteil der Indexländer mit umfangreicheren Industrieschuldverschreibungen, indem er nur einen bestimmten Anteil des aktuell bankfähigen Nennwerts der Schulden dieser Länder einbezieht. Der CEMBI Diversified führt zu gut verteilten, ausgeglicheneren Gewichtungen für die im Index enthaltenen Länder. Die vom CEMBI Diversified abgedeckten Länder sind mit den vom CEMBI abgedeckten identisch. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 22 Schwellenmarktländern mit mindestens 10 Milliarden USD Außenhandel nach. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldsinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden.
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	Der JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified bildet die Gesamterträge von auf US-Dollar lautenden Schuldsinstrumenten nach, die von staatlichen und quasi-staatlichen Emittenten aus Schwellenländern begeben werden und die Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungsfaktoren in die Indexaufbau einbeziehen.



## Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	Der JPMorgan ESG GBI-EM Global Diversified (JESG GBI-EM) bildet die Wertentwicklung von Anleihen nach, die von Regierungen von Schwellenländern begeben werden und auf die lokale Währung des Emittenten lauten. Der Index wendet eine Bewertungs- und Prüfmethode für Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (SGU) an, um Emittenten mit einem höheren Ranking bei SGU-Kriterien und Green-Bond-Emissionen zu bevorzugen und Emittenten mit einem niedrigeren Ranking unterzugewichten oder zu entfernen.
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
JPMorgan JACI Composite Total Return (EUR Hedged)	Mit dem JP Morgan Asia Credit Index (EUR Hedged) wird die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan gemessen. Der Index bietet eine Vergleichsindex für Anlagemöglichkeiten in auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Anlagen, die von staatlichen, quasi-staatlichen und halbstaatlichen Emittenten aus Asien (ohne Japan) begeben werden.
JPMorgan JACI Non-Investment Grade	Der JPMorgan JACI Non-IG umfasst festverzinsliche, auf US-Dollar lautende Hochzinsanleihen, die von Staaten, quasi-staatlichen Stellen, Banken und Unternehmen in Asien begeben wurden. Der bestehende JACI Non-IG enthält sowohl fest- als auch variabel verzinsliche Anleihen, die von in Asien ansässigen Körperschaften begeben wurden und einen ausstehenden Nennbetrag von mindestens 150 Mio. USD sowie eine Restlaufzeit von mehr als einem Jahr aufweisen.
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	Der PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) ist ein diversifizierter globaler Index, der ein breites Spektrum von Gelegenheiten bei internationalen Rentenpapieren und Sektoren, von Industrieländern zu Schwellenmärkten, nominalem zu realem Vermögen, sowie von Barmitteln zu derivativen Instrumenten abdeckt. Abweichend von den herkömmlichen Indizes, die häufig aus Anleihen bestehen, die entsprechend ihrer Marktkapitalisierung gewertet werden, verwendet der GLADI eine BIP-Gewichtung, die sich auf schneller wachsende Gebiete der Welt konzentriert und so dem Index einen auf die Zukunft ausgerichteten Charakter verleiht. Die GLADI-Methode von PIMCO ist geistiges Eigentum, das durch das US-Patent Nr. 8.306.892 geschützt ist. GLOBAL ADVANTAGE und GLADI sind Markenzeichen von Pacific Investment Management Company LLC.
S&P 500 Index	Der S&P 500 ist ein nicht gemanagter Marktindex, der allgemein als repräsentativ für den Aktienmarkt insgesamt gilt. Der Index konzentriert sich auf das Large Cap-Segment des US-Aktienmarkts. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
SHIR Shekel Overnight Risk Free Rate	Dieser Index speichert den Schekel-Übernachtzinssatz und entspricht dem Zinssatz der Bank of Israel. Außer an Tagen, an denen der SHIR nicht veröffentlicht wird, ist sein Wert derselbe wie am letzten Tag seiner Veröffentlichung. Der Kurs der Bank of Israel wird vom Monetary Committee der Bank of Israel acht Mal im Jahr festgelegt, in der Regel montags um 16:00 Uhr. Die Daten der Veröffentlichung und des Antrags der Zinssätze der Bank of Israel werden jährlich auf der Website der Bank of Israel veröffentlicht. Der SHIR wird täglich bis 11:00 Uhr auf der Website der Bank of Israel veröffentlicht, außer an Samstagen, Sonntagen und zusätzlichen Daten, die jährlich auf der Website der Bank of Israel veröffentlicht werden. Diese Daten werden regelmäßig aktualisiert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average	Der Singapore Overnight Rate Average (SORA) ist der volumengewichtete durchschnittliche Zinssatz für Kreditgeschäfte auf dem unbesicherten Tagesgeldmarkt im SGD in Singapur.

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

## Finanzstatus

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.458.996	\$ 2.652.171	\$ 281.696	\$ 276.959
Investmentfonds	271.904	239.979	20.835	29.746
Pensionsgeschäfte	7.016	20.572	347	820
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	32.729	54.267	3.452	3.700
Zahlungsmittel	2.118	0	511	546
Einlagen bei Kontrahenten	23.599	34.314	2.463	2.017
Forderungen aus Einkünften	47.232	48.231	4.467	3.836
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	18.600	9.689	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	38	5.111	71	119
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	19.571	14.965	2.203	1.946
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>2.863.203</b>	<b>3.088.210</b>	<b>325.734</b>	<b>319.689</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(15.108)	(27.401)	(1.473)	(1.065)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(9.208)	(3.578)	(500)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(5.497)	(11.061)	(89)	(76)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(1.533)	(1.671)	(168)	(164)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(31)	(41)	0	0
Überziehungskredit	0	(13.527)	0	0
Zu zahlende Dividende	(186)	(161)	(1)	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(26.849)	(25.632)	(1.658)	(1.842)
Einlagen von Kontrahenten	(8.620)	(23.746)	(2.026)	(2.555)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(67.032)</b>	<b>(106.818)</b>	<b>(5.915)</b>	<b>(5.702)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 2.796.171</b>	<b>\$ 2.981.392</b>	<b>\$ 319.819</b>	<b>\$ 313.987</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 5.571.381	\$ 6.129.600	\$ 249.473	\$ 248.281	\$ 1.389.961	\$ 1.750.918	\$ 90.030	\$ 80.195
142	140	0	0	123	120	9.730	9.649
25.100	10.172	34.000	36.800	2.394	59.113	13.153	6.910
0	0	0	0	0	0	0	0
76.310	107.561	7.671	8.236	30.742	45.313	2.113	2.563
753	2.624	1.803	1.484	3.138	4.491	181	177
74.364	110.882	3.962	8.041	50.334	39.055	1.687	1.533
52.834	66.969	2.397	2.192	4.373	4.250	877	1.002
10.122	33.701	0	0	251	50.448	6	206
0	0	0	0	89.717	206.413	17.215	1.296
1.327	3.060	111	363	722	5.062	37	138
29.148	54.526	2.233	1.167	5.966	17.822	254	1.075
0	0	0	0	0	0	0	0
5.841.481	6.519.235	301.650	306.564	1.577.721	2.183.005	135.283	104.744
(86.968)	(86.485)	(3.233)	(5.599)	(50.389)	(50.044)	(1.132)	(2.137)
0	0	0	0	0	0	0	0
(2.600)	(1)	(544)	0	0	0	(300)	(304)
0	0	0	0	(179.499)	(288.321)	(32.545)	(3.587)
(2.370)	(7.922)	(2.263)	(193)	(4.480)	(3.460)	(51)	(50)
(4.402)	(4.729)	(138)	(145)	(870)	(1.261)	(87)	(89)
(253.383)	(578.475)	0	0	(339.254)	(425.302)	0	0
0	0	0	0	(23.081)	(17.959)	0	0
(203)	(237)	(7)	(24)	(9)	(15)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.217)	(906)	(372)	(157)	(285)	(336)	0	0
(16.273)	(77.568)	(179)	(3.321)	(4.962)	(18.239)	(1.062)	(833)
(24.063)	(41.321)	(5.390)	(4.470)	(1.726)	(8.191)	(310)	(591)
0	0	0	0	0	0	0	0
(391.479)	(797.644)	(12.126)	(13.909)	(604.555)	(813.128)	(35.487)	(7.591)
\$ 5.450.002	\$ 5.721.591	\$ 289.524	\$ 292.655	\$ 973.166	\$ 1.369.877	\$ 99.796	\$ 97.153

## Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 6.106.201	\$ 6.620.617	\$ 359.563	\$ 401.584
Investmentfonds	795.982	876.630	51.387	55.806
Pensionsgeschäfte	1.236.637	1.746.323	107.366	102.832
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	152.168	132.621	31.613	19.178
Zahlungsmittel	2.539	0	65	513
Einlagen bei Kontrahenten	212.801	282.594	28.166	20.323
Forderungen aus Einkünften	82.191	83.844	4.825	5.122
Forderungen aus verkauften Anlagen	36.373	51.445	1.251	1.998
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	403.838	248.272	23.627	19.854
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	6.266	5.685	39	98
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	95.166	113.759	21.012	19.031
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>9.130.162</b>	<b>10.161.790</b>	<b>628.914</b>	<b>646.339</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(151.381)	(150.759)	(8.987)	(5.030)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(8.728)	(586.220)	0	(940)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(868.173)	(549.539)	(53.598)	(39.365)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(5.225)	(7.240)	(205)	(2.623)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(6.860)	(8.022)	(381)	(438)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(63.195)	(6.646)	(368)	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(148)	(148)	(1)	(2)
Überziehungskredit	0	(3.465)	0	0
Zu zahlende Dividende	(5.802)	(3.841)	(1.408)	(870)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(34.281)	(62.209)	(35.405)	(29.190)
Einlagen von Kontrahenten	(43.652)	(31.905)	(6.994)	(3.197)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(1.187.445)</b>	<b>(1.409.994)</b>	<b>(107.347)</b>	<b>(81.655)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 7.942.717</b>	<b>\$ 8.751.796</b>	<b>\$ 521.567</b>	<b>\$ 564.684</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Diversified Income ESG Fund		Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 44.287	\$ 9.978	\$ 3.011.520	\$ 2.712.201	€ 4.246.875	€ 4.130.924	\$ 2.549.023	\$ 1.772.984
5.064	0	336.750	348.722	419.861	504.414	269.736	131.643
7.400	0	555.858	1.145.692	329.566	124.604	0	0
0	0	0	0	0	0	19.027	7.054
1.079	60	144.276	74.933	117.828	234.476	139.995	315.328
509	108	6.281	7.730	13.209	38.251	38.890	35.990
695	113	71.278	96.997	169.395	395.426	46.277	51.091
610	112	17.860	16.752	18.832	5.003	50.874	35.522
0	0	12.924	7.837	1.663	9.331	1.618	26.063
197	603	689.297	454.635	592.089	0	0	0
0	0	1.939	2.056	1.137	2.321	3.236	4.086
37	27	51.889	69.677	88.263	165.342	41.366	102.125
0	0	0	0	0	0	0	17
59.878	11.001	4.899.872	4.937.232	5.998.718	5.610.092	3.160.042	2.481.903
(1.391)	(73)	(121.129)	(160.788)	(98.515)	(236.948)	(125.287)	(313.285)
0	0	(82.313)	(82.152)	0	0	0	0
0	0	(1.263)	(557.164)	0	(21.731)	(26.546)	(28.070)
(396)	(1.000)	(1.246.477)	(607.223)	(1.520.012)	0	0	0
(43)	0	(1.993)	(600)	(12.243)	(13.813)	(399)	(665)
(34)	(6)	(2.661)	(2.772)	(4.392)	(5.575)	(2.131)	(1.496)
0	0	(217)	(2.164)	0	(17.828)	(150.013)	(85.313)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	0	(64)	(68)	(30)	(33)	(611)	(206)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(1.234)	(680)	(319)	0	0	0
(14)	(68)	(14.522)	(28.530)	(47.082)	(115.772)	(23.381)	(83.123)
(10)	0	(60.706)	(11.490)	(57.914)	(83.222)	(46.231)	(50.077)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.889)	(1.147)	(1.532.579)	(1.453.631)	(1.740.507)	(494.922)	(374.599)	(562.235)
\$ 57.989	\$ 9.854	\$ 3.367.293	\$ 3.483.601	€ 4.258.211	€ 5.115.170	\$ 2.785.443	\$ 1.919.668

## Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Emerging Local Bond ESG Fund		Emerging Markets Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 7.580	\$ 6.270	\$ 3.348.247	\$ 3.267.661
Investmentfonds	0	0	30.285	52.797
Pensionsgeschäfte	0	0	0	9.160
Einlagen bei Kreditinstituten	54	4	24.740	2.227
Finanzderivate	229	269	76.871	69.071
Zahlungsmittel	143	127	6.357	4.943
Einlagen bei Kontrahenten	60	39	22.310	49.025
Forderungen aus Einkünften	135	122	59.573	52.462
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	0	9.003	400
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	34.093	26.106
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	0	0	4.214	714
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	30	11	16.555	25.590
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>8.231</b>	<b>6.842</b>	<b>3.632.248</b>	<b>3.560.156</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(210)	(215)	(48.881)	(49.305)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(126)	0	(37.127)	(10.331)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	(58.022)	(49.405)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	0	0	(4.783)	(13.371)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(4)	(4)	(2.440)	(2.521)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(110)	0	(54.912)	(75.356)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(10)	(2)	(15)	(12)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(280)	(276)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(19)	(12)	(4.716)	(15.372)
Einlagen von Kontrahenten	(60)	0	(31.425)	(38.228)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(539)</b>	<b>(233)</b>	<b>(242.601)</b>	<b>(254.177)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 7.692</b>	<b>\$ 6.609</b>	<b>\$ 3.389.647</b>	<b>\$ 3.305.979</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.



Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 2.242.384	\$ 2.422.256	\$ 138.695	\$ 143.387	\$ 205.639	\$ 181.600	\$ 17.353	\$ 15.264
0	0	15.721	16.518	12.618	14.797	1.960	2.058
90.940	44.661	3.949	8.386	939	706	150	2.766
17.905	1.659	1.140	0	1.619	137	153	78
61.429	56.599	3.855	4.439	31.819	34.841	1.329	4.060
1.589	2.605	231	262	190	1.447	94	185
20.189	25.425	1.722	1.839	9.662	10.495	273	282
33.927	37.299	1.933	1.915	2.286	1.549	126	87
37.854	215	466	1	19.074	207	5	1
3.487	4.814	2.559	1.285	0	0	0	0
10.806	10.705	0	55	3	0	10	11
9.457	10.516	1.704	984	7.351	5.129	106	254
0	0	0	0	0	0	0	0
2.529.967	2.616.754	171.975	179.071	291.200	250.908	21.559	25.046
(33.210)	(23.713)	(1.644)	(618)	(24.089)	(31.528)	(946)	(3.067)
(551)	0	0	0	0	0	0	0
(49.523)	(3.745)	(1.192)	(2.163)	(19.808)	0	0	(109)
(6.478)	(7.710)	(5.626)	(2.563)	0	0	0	0
(2.617)	(461)	(60)	(10)	(15)	(586)	(11)	(5)
(1.746)	(1.929)	(161)	(172)	(85)	(64)	(23)	(25)
(36.961)	(38.840)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	(1)	0	0	0	(8)	0	(1)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.780)	(2.167)	0	0	0	0	0	0
(5.266)	(9.012)	(1.696)	(1.872)	(11.195)	(10.037)	(225)	(631)
(29.501)	(36.701)	(1.863)	(2.687)	(5.440)	(3.554)	(271)	(271)
0	0	0	0	0	0	0	0
(167.634)	(124.279)	(12.242)	(10.085)	(60.632)	(45.777)	(1.476)	(4.109)
\$ 2.362.333	\$ 2.492.475	\$ 159.733	\$ 168.986	\$ 230.568	\$ 205.131	\$ 20.083	\$ 20.937

## Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO ESG Income Fund		Euro Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 316.722	\$ 254.108	€ 1.600.490	€ 1.747.790
Investmentfonds	0	0	132.603	181.654
Pensionsgeschäfte	31.800	44.400	104.244	11.515
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	6.458	5.555	34.165	49.805
Zahlungsmittel	850	1.533	4.760	3.052
Einlagen bei Kontrahenten	4.337	2.737	51.066	59.589
Forderungen aus Einkünften	1.664	1.372	8.624	8.903
Forderungen aus verkauften Anlagen	349	80	2.764	13.467
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	80.076	78.252	201.972	168.280
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	676	221	208	932
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	4.896	4.814	21.575	105.486
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>447.828</b>	<b>393.072</b>	<b>2.162.471</b>	<b>2.350.473</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(6.257)	(4.277)	(34.899)	(122.819)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(441)	(2.630)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(22.288)	(707)	0	(95)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(157.506)	(141.114)	(344.659)	(264.938)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(101)	(12)	(648)	(405)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(134)	(118)	(768)	(807)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(10)	(12)	(5)	(5)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(1)	(1)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(2.431)	(3.190)	(12.388)	(41.188)
Einlagen von Kontrahenten	(3.967)	(3.050)	(15.543)	(6.941)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(193.136)</b>	<b>(155.111)</b>	<b>(408.910)</b>	<b>(437.198)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 254.692</b>	<b>\$ 237.961</b>	<b>€ 1.753.561</b>	<b>€ 1.913.275</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
€ 528.695	€ 491.678	€ 1.389.763	€ 1.100.441	€ 441.943	€ 103.959	€ 199.083	€ 330.698
51.452	50.689	124.045	134.815	11.160	4.940	0	0
28.577	44.621	122.674	120.458	7.333	1.500	9.531	14.100
0	0	0	0	0	0	0	0
8.106	9.083	33.023	26.003	1.386	3.789	3.282	5.409
3.510	12.028	10.479	7.361	278	397	395	896
10.762	26.366	48.778	47.460	6.017	4.382	4.613	6.396
4.409	4.187	7.767	8.869	3.284	1.039	862	1.735
6.412	2.447	5.106	53.521	0	0	0	63
19.416	1.073	550.730	117.074	10.758	6.332	0	0
174	242	3.708	1.107	155.112	51	35	550
6.051	33.489	18.857	19.325	1.238	16.625	407	5.754
0	0	0	0	0	0	0	0
667.564	675.903	2.314.930	1.636.434	638.509	143.014	218.208	365.601
(3.786)	(13.081)	(29.615)	(27.457)	(1.023)	(18.830)	(1.162)	(2.312)
0	0	0	0	0	0	0	0
(11.362)	(7.404)	(3.667)	(22.578)	(138.012)	0	0	0
(31.466)	(13.488)	(984.881)	(208.728)	(47.356)	(11.721)	0	0
(30)	(85)	(1.480)	(1.033)	(129)	0	(1.223)	(1.514)
(233)	(252)	(1.149)	(1.244)	(49)	(46)	(61)	(105)
(549)	0	(8.856)	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(17)	(17)	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(9.188)	(29.619)	(9.312)	(18.036)	(1.975)	(2.369)	(1.463)	(6.452)
(1.011)	(1.966)	(13.783)	(4.361)	0	0	(940)	(2.123)
0	0	0	0	0	0	0	0
(57.625)	(65.895)	(1.052.760)	(283.454)	(188.544)	(32.966)	(4.849)	(12.506)
€ 609.939	€ 610.008	€ 1.262.170	€ 1.352.980	€ 449.965	€ 110.048	€ 213.359	€ 353.095

## Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	€ 203.864	€ 157.222	€ 145.291	€ 193.346
Investmentfonds	11.682	8.700	11.875	18.800
Pensionsgeschäfte	3.200	3.700	295	4.400
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	2.412	2.007	1.608	7.774
Zahlungsmittel	1.561	3.440	224	640
Einlagen bei Kontrahenten	4.006	2.986	2.542	4.772
Forderungen aus Einkünften	2.358	1.897	954	1.077
Forderungen aus verkauften Anlagen	1	32	2.489	1.622
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	13.480	12.293
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	137	71	132	293
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	1.253	1.485	3.078	4.861
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>230.474</b>	<b>181.540</b>	<b>181.968</b>	<b>249.878</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(1.400)	(1.105)	(4.435)	(8.310)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(888)	(4.181)	(613)	(590)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA- Anlagen	0	0	(27.026)	(23.393)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(77)	(1)	(467)	(111)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(49)	(13)	(51)	(66)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(837)	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(2.280)	(2.078)	(671)	(5.044)
Einlagen von Kontrahenten	(270)	0	(827)	(1.192)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilhaber</b>	<b>(5.801)</b>	<b>(7.378)</b>	<b>(34.090)</b>	<b>(38.706)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilhaber</b>	<b>€ 224.673</b>	<b>€ 174.162</b>	<b>€ 147.878</b>	<b>€ 211.172</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Global Advantage Fund		Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 518.780	\$ 443.632	\$ 14.608.940	\$ 11.361.097	\$ 3.663.093	\$ 2.913.880	\$ 880.157	\$ 737.412
21.489	18.242	1.249.595	1.120.979	0	5.649	50.080	47.322
2.347	1.408	721.100	1.346.970	206.285	1.157.847	1.874	1.625
0	0	0	0	0	0	0	0
21.498	25.927	664.136	518.391	179.715	94.009	48.176	35.105
3.640	3.907	40.094	32.207	11.702	8.552	6.153	5.507
17.835	15.524	391.910	478.539	81.892	125.721	27.630	39.796
2.996	2.702	54.450	51.007	14.180	10.094	3.825	3.559
8.571	9.551	296.314	279.220	31.129	26.307	16.485	15.805
187.611	96.161	5.312.529	4.755.367	694.836	450.850	338.294	255.052
1	3	57.121	77.660	10.249	3.518	900	460
13.448	22.907	326.798	658.178	88.034	164.909	26.115	56.123
0	0	0	0	0	0	0	0
798.216	639.964	23.722.987	20.679.615	4.981.115	4.961.336	1.399.689	1.197.766
(23.470)	(21.316)	(570.797)	(859.558)	(88.084)	(151.501)	(36.366)	(63.177)
(28.873)	(28.813)	(722.957)	(721.316)	(124.257)	(119.122)	(78.766)	(76.200)
(8.453)	(8.457)	(297.938)	(930.760)	(42.977)	(622.586)	(15.636)	(15.641)
(310.625)	(140.479)	(9.067.703)	(6.231.107)	(1.205.227)	(792.022)	(497.245)	(282.153)
(6)	(35)	(22.823)	(13.836)	(3.872)	(10.843)	(385)	(75)
(241)	(250)	(6.072)	(5.736)	(1.366)	(1.314)	(330)	(342)
0	(1.504)	(1.895)	(1.682)	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(26)	(17)	(173)	(137)	(3)	(3)	(6)	(7)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(922)	(736)	(1.740)	(399)	0	0
(11.607)	(23.802)	(168.589)	(407.767)	(68.428)	(125.388)	(24.910)	(41.421)
(3.300)	(4.832)	(251.408)	(86.868)	(100.327)	(31.968)	(15.469)	(2.728)
0	0	0	0	0	0	0	0
(386.601)	(229.505)	(11.111.277)	(9.259.503)	(1.636.281)	(1.855.146)	(669.113)	(481.744)
\$ 411.615	\$ 410.459	\$ 12.611.710	\$ 11.420.112	\$ 3.344.834	\$ 3.106.190	\$ 730.576	\$ 716.022

## Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		Global High Yield Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 524.174	\$ 473.435	\$ 2.913.163	\$ 2.850.786
Investmentfonds	236.945	251.489	130.837	201.583
Pensionsgeschäfte	18.513	18.536	3.895	11.412
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	41.444	29.087	36.787	36.885
Zahlungsmittel	3.006	12.189	1.899	26
Einlagen bei Kontrahenten	29.989	40.674	14.859	28.611
Forderungen aus Einkünften	2.518	1.307	40.703	40.375
Forderungen aus verkauften Anlagen	627	4.838	214	23
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	118.316	90.163	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	376	270	3.600	7.615
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	17.143	35.050	1.437	788
Sonstige Aktiva	0	0	30	223
<b>Summe Aktiva</b>	<b>993.051</b>	<b>957.038</b>	<b>3.147.424</b>	<b>3.178.327</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(16.921)	(43.855)	(20.345)	(20.824)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(13.091)	(1.870)	(20.661)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(257.057)	(117.381)	0	0
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(526)	(10.695)	(3.938)	(13.817)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(747)	(793)	(1.829)	(1.960)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	(11.985)	(10.397)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(3)	(3)	(25)	(123)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(40)	(40)	(4.628)	(4.126)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(20.493)	(18.837)	(1.405)	(3.436)
Einlagen von Kontrahenten	(15.586)	(13.488)	(12.772)	(20.776)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(324.464)</b>	<b>(206.962)</b>	<b>(77.588)</b>	<b>(75.459)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 668.587</b>	<b>\$ 750.076</b>	<b>\$ 3.069.836</b>	<b>\$ 3.102.868</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 9.186.690	\$ 9.778.544	\$ 2.107.775	\$ 1.489.771	\$ 1.697.365	\$ 1.661.693	\$ 3.401.577	\$ 3.391.396
1.057.482	1.038.326	0	0	189	12.424	10.161	7.043
559.532	75.423	2.319	15.240	7.529	1.053	2.272	2.245
0	0	0	0	0	0	0	0
184.520	212.298	38.604	33.293	33.448	50.766	80.580	106.832
36.381	20.756	2.422	2.079	952	9.404	7.461	8.086
182.567	275.295	34.187	30.302	24.344	18.687	49.098	46.251
96.791	90.845	18.073	11.400	4.175	2.931	9.842	7.667
15.683	34.506	14.790	52.816	11.846	94.773	311	68.378
616.216	1.919.603	140.883	135.728	65.224	72.965	151.581	191.920
7.650	30.854	1.256	1.945	311	574	926	4.737
140.862	180.542	3.565	13.422	14.572	12.290	16.010	27.734
0	0	0	0	0	0	0	0
12.084.374	13.656.992	2.363.874	1.785.996	1.859.955	1.937.560	3.729.819	3.862.289
(202.313)	(293.790)	(21.813)	(17.969)	(30.763)	(29.733)	(74.956)	(93.426)
0	(136.255)	(31.398)	(5.887)	0	0	0	0
(23.751)	0	(3.691)	(8.117)	0	(30.524)	0	0
(1.235.486)	(2.481.720)	(287.441)	(202.456)	(130.717)	(132.585)	(303.432)	(325.573)
(14.213)	(32.381)	(518)	(188)	(2.188)	(2.607)	(2.782)	(3.628)
(5.637)	(5.738)	(826)	(605)	(686)	(735)	(1.339)	(1.447)
0	(4.154)	(151.412)	(75.928)	(408.892)	(261.713)	(791.310)	(796.152)
0	0	(30.833)	(75.925)	(9.212)	(79.599)	0	(9.519)
(299)	(339)	(137)	(124)	(2)	(2)	(41)	(51)
0	0	0	0	0	0	0	0
(8.969)	(6.988)	(1.221)	(692)	(1.752)	(446)	(6.199)	(2.363)
(69.607)	(82.017)	(4.982)	(13.852)	(13.375)	(18.182)	(21.429)	(35.345)
(31.248)	(75.269)	(10.253)	(14.363)	(9.211)	(17.059)	(17.662)	(22.923)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.591.523)	(3.118.651)	(544.525)	(416.106)	(606.798)	(573.185)	(1.219.150)	(1.290.427)
\$ 10.492.851	\$ 10.538.341	\$ 1.819.349	\$ 1.369.890	\$ 1.253.157	\$ 1.364.375	\$ 2.510.669	\$ 2.571.862



## Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Income Fund		Income Fund II	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 79.018.485	\$ 67.246.471	\$ 94.891	\$ 56.970
Investmentfonds	2.484.042	2.081.428	7.607	1.740
Pensionsgeschäfte	2.090.601	3.421.698	0	0
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	5.006.709	5.163.114	1.651	718
Zahlungsmittel	45.836	89.931	827	644
Einlagen bei Kontrahenten	1.978.585	1.852.978	1.682	1.022
Forderungen aus Einkünften	404.136	354.824	615	384
Forderungen aus verkauften Anlagen	64.631	60.282	4	5
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	28.213.137	21.347.671	8.406	8.075
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	106.957	88.371	743	4.020
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	1.569.675	1.235.828	889	637
Sonstige Aktiva	92	236	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>120.982.886</b>	<b>102.942.832</b>	<b>117.315</b>	<b>74.215</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(3.761.324)	(3.649.860)	(1.393)	(406)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(70.650)	(734.103)	(378)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(146.308)	(205.883)	0	(182)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(49.488.695)	(37.310.306)	(16.684)	(15.917)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(40.562)	(145.081)	(20)	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(49.052)	(45.253)	(100)	(48)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(8.320)	(15.867)	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(5.655)	(4.925)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(3.122)	(2.737)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(2.452.308)	(2.473.835)	(761)	(1.036)
Einlagen von Kontrahenten	(429.323)	(374.655)	(260)	0
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	(2)	(3)
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(56.455.319)</b>	<b>(44.962.505)</b>	<b>(19.598)</b>	<b>(17.592)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 64.527.567</b>	<b>\$ 57.980.327</b>	<b>\$ 97.717</b>	<b>\$ 56.623</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Inflation Multi-Asset Fund		Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 293.906	\$ 320.121	\$ 1.153.664	\$ 1.235.606	\$ 821.335	\$ 691.422	\$ 1.708.028	\$ 1.213.608
63.568	68.975	84.133	85.631	6.316	643	145.966	106.140
4.101	40.720	0	956	563	1.604	326.492	98.831
0	0	0	0	0	0	0	0
10.980	14.716	6.520	7.284	13.215	13.518	100.490	79.359
1.115	0	259	2.692	308	390	3.660	6.374
8.501	8.179	13.041	24.403	9.733	10.136	44.502	34.272
697	688	8.329	6.394	7.517	5.082	7.169	7.264
9	13	697	723	0	202	8.771	2.215
49.198	10.546	389.587	380.707	44.465	69.997	999.381	367.632
47	100	100	976	247	2.763	1.399	2.070
5.757	7.201	7.778	7.914	4.269	11.170	23.725	21.540
0	0	0	0	0	0	0	0
437.879	471.259	1.664.108	1.753.286	907.968	806.927	3.369.583	1.939.305
(11.987)	(10.695)	(12.193)	(14.403)	(8.857)	(11.395)	(62.272)	(64.082)
0	0	(49.879)	(76.949)	0	(14.029)	0	(5.209)
0	(2.206)	(39)	(2.924)	(2.499)	(1.062)	(9.143)	(9.219)
(92.814)	(43.111)	(466.010)	(427.587)	(89.713)	(97.540)	(1.778.081)	(724.143)
(1.057)	(1.769)	(2.697)	(1.987)	(1.045)	(422)	(550)	(185)
(339)	(445)	(409)	(495)	(348)	(289)	(719)	(565)
0	0	(221.985)	(144.857)	0	(12.776)	0	0
0	0	(19.674)	(4.077)	0	(1.409)	0	0
(3)	(5)	(9)	(10)	0	0	(24)	(24)
0	(980)	0	0	0	0	0	0
0	0	(27)	(13)	(41)	(20)	(547)	(247)
(4.797)	(6.644)	(1.876)	(3.315)	(1.852)	(4.014)	(42.165)	(28.430)
(2.704)	(2.326)	(3.298)	(3.911)	(5.396)	(9.222)	(20.697)	(22.821)
0	0	0	0	0	0	0	0
(113.701)	(68.181)	(778.096)	(680.528)	(109.751)	(152.178)	(1.914.198)	(854.925)
\$ 324.178	\$ 403.078	\$ 886.012	\$ 1.072.758	\$ 798.217	\$ 654.749	\$ 1.455.385	\$ 1.084.380

## Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Low Duration Opportunities Fund		Low Duration Opportunities ESG Fund	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.055.335	\$ 1.216.746	\$ 5.400	\$ 5.070
Investmentfonds	108.526	133.056	0	0
Pensionsgeschäfte	94.887	118.800	0	0
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	53.359	55.664	40	22
Zahlungsmittel	2.982	3.357	152	122
Einlagen bei Kontrahenten	36.099	57.806	50	31
Forderungen aus Einkünften	6.895	7.718	24	16
Forderungen aus verkauften Anlagen	6.071	12.795	49	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	382.392	282.511	1.029	274
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	22	542	0	0
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	27.076	45.871	34	51
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>1.773.644</b>	<b>1.934.866</b>	<b>6.778</b>	<b>5.586</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(65.611)	(109.833)	(48)	(67)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(45.584)	(94.108)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(4.371)	(12.575)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(517.783)	(347.541)	(1.694)	(545)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(486)	(139)	0	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(403)	(542)	(2)	(2)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(8)	(8)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(996)	(1.377)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(6.836)	(19.443)	(17)	(44)
Einlagen von Kontrahenten	(10.189)	(3.519)	0	0
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(652.267)</b>	<b>(589.085)</b>	<b>(1.761)</b>	<b>(658)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 1.121.377</b>	<b>\$ 1.345.781</b>	<b>\$ 5.017</b>	<b>\$ 4.928</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 86.230	\$ 106.959	\$ 1.421.861	\$ 1.724.999	\$ 1.011.424	\$ 711.694	\$ 7.486	\$ 7.750
9.353	11.833	24	23	163.028	92.742	1.117	904
840	811	4.008	17.318	651.113	156.445	4.018	1.374
0	0	0	0	0	0	0	0
2.338	1.447	28.831	44.003	77.353	12.661	995	258
442	552	112	167	776	2.178	14	11
0	2.870	11.095	11.602	60.486	85.945	299	861
121	104	4.632	4.660	3.960	2.660	25	21
0	13	26.202	1.901	12	255	0	0
0	0	1.219.745	1.781.393	83.136	0	2.003	1.240
44	59	486	412	1.989	1.226	0	0
0	0	2.808	17.755	8.958	33.144	196	115
0	0	0	0	1	0	0	0
99.368	124.648	2.719.804	3.604.233	2.062.236	1.098.950	16.153	12.534
(357)	(237)	(12.291)	(17.225)	(9.682)	(30.319)	(144)	(293)
0	0	(390.149)	(518.212)	0	0	(339)	(583)
0	(2.379)	(189.373)	(194.452)	(1.295)	(37.060)	0	(583)
0	0	(1.138.427)	(1.654.287)	(185.803)	0	(3.439)	(1.310)
(81)	(834)	(79)	(596)	(1.980)	(1.097)	0	0
(86)	(109)	(407)	(547)	(1.018)	(656)	(6)	(6)
0	0	(345.192)	(316.493)	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(9)	(8)	(9)	(5)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(24)	(21)	0	0	0	0
0	0	(8.285)	(18.210)	(24.067)	(15.583)	(298)	(231)
(1.753)	(952)	(15.232)	(35.034)	(34.423)	(5.491)	(380)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(2.277)	(4.511)	(2.099.468)	(2.755.085)	(258.277)	(90.211)	(4.606)	(3.006)
\$ 97.091	\$ 120.137	\$ 620.336	\$ 849.148	\$ 1.803.959	\$ 1.008.739	\$ 11.547	\$ 9.528

## Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 597.009	\$ 610.560	\$ 5.534.034	\$ 4.770.861
Investmentfonds	23.276	29.661	260.029	292.421
Pensionsgeschäfte	2.001	781	1.321	170.895
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	50.874	53.205	58.332	110.789
Zahlungsmittel	622	4.623	14.565	15.733
Einlagen bei Kontrahenten	11.635	11.922	95.186	120.293
Forderungen aus Einkünften	2.935	2.787	30.502	25.541
Forderungen aus verkauften Anlagen	6.251	4.738	3.813	51.883
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	313.035	224.967	1.761.849	2.180.028
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	250	385	2.493	12.045
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	14.397	14.864	49.719	77.114
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>1.022.285</b>	<b>958.493</b>	<b>7.811.843</b>	<b>7.827.603</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(38.322)	(36.766)	(83.466)	(106.644)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(8.958)	(13.092)	(68.600)	(68.457)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(32)	(741)	(2.498)	(6.344)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(484.953)	(367.853)	(3.274.412)	(3.304.650)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(679)	(539)	(2.603)	(3.734)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(505)	(585)	(2.665)	(2.652)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	(9.407)	(1.745)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	(7.982)	(76.810)
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(14)	(17)	(215)	(210)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(167)	(186)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(21.250)	(21.409)	(23.821)	(72.167)
Einlagen von Kontrahenten	(5.636)	(10.934)	(9.638)	(33.287)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(560.349)</b>	<b>(451.936)</b>	<b>(3.485.474)</b>	<b>(3.676.886)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 461.936</b>	<b>\$ 506.557</b>	<b>\$ 4.326.369</b>	<b>\$ 4.150.717</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
\$ 237.254	\$ 335.879	£ 345.995	£ 372.745	£ 289.477	£ 309.110	\$ 1.868.312	\$ 1.895.465
30.015	41.693	208	5.370	0	0	67.844	39.162
4.583	27.452	13.102	177	1.922	269	10.034	9.269
0	600	0	0	0	0	0	0
68.482	42.556	3.019	4.161	4.623	8.017	10.846	12.684
2.862	3.994	530	1.084	572	0	576	550
29.400	28.858	3.217	7.199	4.147	14.086	17.435	10.449
2.063	1.601	4.552	4.405	5.276	4.594	29.928	31.884
0	134	2	1.522	0	0	35	3.204
78.701	25.221	1.866	0	0	0	0	0
18	11.015	91	61	0	0	2.730	1.390
26.120	17.270	6.430	7.000	2.394	15.391	2.247	270
0	0	0	0	0	0	22	186
479.498	536.273	379.012	403.724	308.411	351.467	2.010.009	2.004.513
(55.552)	(44.109)	(3.004)	(1.718)	(1.799)	(3.697)	(2.128)	(1.517)
(31.575)	0	0	0	0	0	0	0
(73)	(523)	(1.698)	0	0	0	(5.603)	(4.262)
(49.182)	(30.301)	(6.493)	0	0	0	0	0
(239)	(3.552)	(178)	(70)	(3)	0	(6.335)	(2.743)
(310)	(453)	(104)	(127)	(113)	(131)	(1.114)	(1.173)
0	0	(25.054)	0	(2.915)	0	(9.486)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	0	0	0	0	0	(76)	(148)
0	0	0	0	0	(2.154)	0	0
(539)	(317)	(1.895)	(1.865)	(415)	(371)	(40)	(20)
(21.978)	(16.064)	(5.751)	(10.440)	(5.213)	(19.583)	(2.839)	(1.779)
(17.685)	(5.030)	0	(331)	(41)	(511)	(4.787)	(7.949)
0	0	0	0	0	0	0	0
(177.134)	(100.349)	(44.177)	(14.551)	(10.499)	(26.447)	(32.408)	(19.591)
\$ 302.364	\$ 435.924	£ 334.835	£ 389.173	£ 297.912	£ 325.020	\$ 1.977.601	\$ 1.984.922

## Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 384.707	\$ 346.399	\$ 2.175.664	\$ 1.891.711
Investmentfonds	43.534	38.657	206.887	226.018
Pensionsgeschäfte	25.268	15.383	227.937	154.472
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	7.629	8.390	8.510	10.584
Zahlungsmittel	922	796	4.031	1.993
Einlagen bei Kontrahenten	11.854	12.615	13.803	18.130
Forderungen aus Einkünften	4.197	3.400	11.805	12.016
Forderungen aus verkauften Anlagen	782	27.549	670	4.313
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	18.074	21.983	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	278	2.561	2.294	6.106
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	2.177	5.621	4.922	5.389
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>499.422</b>	<b>483.354</b>	<b>2.656.523</b>	<b>2.330.732</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(2.679)	(7.500)	(7.229)	(5.824)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	(2.035)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(1.448)	0	(571.126)	(1.430)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(43.153)	(39.829)	0	0
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(949)	(58)	(3.299)	(2.669)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(209)	(182)	(643)	(722)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	(38.655)	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	(4)	(4)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(303)	(156)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(3.703)	(4.541)	(3.099)	(4.603)
Einlagen von Kontrahenten	(2.185)	(1.876)	(4.219)	(5.365)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(54.629)</b>	<b>(94.832)</b>	<b>(589.619)</b>	<b>(20.617)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 444.793</b>	<b>\$ 388.522</b>	<b>\$ 2.066.904</b>	<b>\$ 2.310.115</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

\* Die Summe der Gesellschaft zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.



<b>Summe der Gesellschaft*</b>			
	Zum	Zum	
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	
\$	175.726.198	\$	158.067.452
	7.615.215		7.205.963
	7.770.096		10.455.165
	64.638		11.759
	7.870.090		8.087.908
	298.962		369.095
	4.105.461		4.738.366
	1.205.157		1.097.303
	673.066		1.035.370
	44.050.900		36.037.151
	407.359		405.829
	2.872.421		3.520.113
	145		662
	252.659.708		231.032.136
	(6.099.929)		(7.088.064)
	(1.735.668)		(2.699.152)
	(1.710.524)		(3.353.495)
	(76.766.692)		(57.317.614)
	(162.124)		(417.932)
	(108.908)		(108.234)
	(2.905.029)		(2.874.391)
	(90.782)		(303.953)
	(7.910)		(7.630)
	0		(20.563)
	(47.128)		(30.796)
	(3.314.886)		(4.103.580)
	(1.405.852)		(1.182.210)
	(2)		(3)
	(94.355.434)		(79.507.617)
\$	158.304.274	\$	151.524.519

## Betriebsergebnisrechnung

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 127.322	\$ 102.800	\$ 10.414	\$ 7.131
Sonstige Erträge	0	0	65	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(127.920)	(172.495)	(11.781)	(13.972)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	16.031	(35.312)	2.220	(5.775)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	22	(103)	21	(144)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(6.170)	(629.811)	5.133	(40.925)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(10.526)	(32.123)	(765)	(4.392)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(54)	(118)	(10)	(7)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(1.295)	(767.162)	5.297	(58.084)
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(9.601)	(10.534)	(1.035)	(1.032)
Servicegebühr	(145)	(376)	0	0
Bestandspflegegebühr	(68)	(98)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(2)	(2)	0	0
Gesamtaufwendungen	(9.816)	(11.010)	(1.035)	(1.032)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	8	8	2	2
Betriebskosten, netto	(9.808)	(11.002)	(1.033)	(1.030)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	(11.103)	(778.164)	4.264	(59.114)
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(61)	(235)	(30)	0
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(17.012)	(23.232)	(5.596)	(3.822)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(545)	77	2	31
Summe Finanzierungskosten	(17.618)	(23.390)	(5.624)	(3.791)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	(28.721)	(801.554)	(1.360)	(62.905)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	0	0	(3)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	(28.721)	(801.554)	(1.360)	(62.908)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ (28.721)	\$ (801.554)	\$ (1.360)	\$ (62.908)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 170.864	\$ 160.238	\$ 5.112	\$ 3.144	\$ 20.182	\$ 61.718	\$ 2.759	\$ 2.145
14	0	0	0	68	0	65	0
(550.340)	(59.121)	(10.449)	(3.827)	(45.548)	(23.145)	(173)	(1.716)
(4.548)	164.830	(2.927)	1.355	(118.831)	561.745	6	(2.772)
(7.044)	(57.669)	(394)	74	25	(7.225)	(28)	(46)
393.969	(1.651.927)	17.685	(60.258)	60.903	(162.956)	1.051	(11.044)
(35.289)	24.401	1.801	(9.486)	(14.337)	(266.379)	478	(1.710)
692	1.836	(19)	7	(685)	(327)	7	(2)
(31.682)	(1.417.412)	10.809	(68.991)	(98.223)	163.431	4.165	(15.145)
(27.395)	(35.732)	(887)	(878)	(6.190)	(10.564)	(528)	(686)
(551)	(965)	0	(5)	(67)	(146)	0	0
(603)	(669)	0	0	0	0	0	0
(167)	(191)	(8)	(8)	(1)	(1)	0	0
(28.716)	(37.557)	(895)	(891)	(6.258)	(10.711)	(528)	(686)
0	302	0	0	0	0	1	1
(28.716)	(37.255)	(895)	(891)	(6.258)	(10.711)	(527)	(685)
(60.398)	(1.454.667)	9.914	(69.882)	(104.481)	152.720	3.638	(15.830)
(9.931)	(1.484)	(4)	0	(9.408)	(151)	(6)	(149)
0	0	0	0	0	0	0	0
(39.969)	(42.121)	(1.972)	(1.074)	(566)	0	0	0
(1.417)	(2.130)	34	76	(34)	0	0	0
(51.317)	(45.735)	(1.942)	(998)	(10.008)	(151)	(6)	(149)
(111.715)	(1.500.402)	7.972	(70.880)	(114.489)	152.569	3.632	(15.979)
(26)	(315)	2	3	1	1	(1)	6
0	0	0	0	0	0	0	0
(111.741)	(1.500.717)	7.974	(70.877)	(114.488)	152.570	3.631	(15.973)
\$ (111.741)	\$ (1.500.717)	\$ 7.974	\$ (70.877)	\$ (114.488)	\$ 152.570	\$ 3.631	\$ (15.973)

## Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 209.219	\$ 231.966	\$ 13.553	\$ 18.087
Sonstige Erträge	1.911	0	197	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(184.578)	(248.907)	(12.205)	(17.443)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	65.169	(538.653)	12.129	(9.888)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(10.292)	(71.471)	203	(2.883)
Nettoveränderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	276.276	(2.134.224)	16.730	(160.520)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	25.065	(487.131)	8.649	(33.646)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	171	(4.272)	29	(278)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	382.941	(3.252.692)	39.285	(206.571)
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(45.117)	(67.929)	(2.456)	(4.479)
Servicegebühr	(312)	(291)	(9)	(17)
Bestandspflegegebühr	(365)	(540)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(217)	(241)	0	(1)
Gesamtaufwendungen	(46.011)	(69.001)	(2.465)	(4.497)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	464	1.070	1	76
Betriebskosten, netto	(45.547)	(67.931)	(2.464)	(4.421)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>337.394</b>	<b>(3.320.623)</b>	<b>36.821</b>	<b>(210.992)</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(1.699)	(65)	(119)	(9)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(63.554)	(82.528)	(4.882)	(6.214)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(2.594)	(4.287)	94	(228)
Summe Finanzierungskosten	(67.847)	(86.880)	(4.907)	(6.451)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>269.547</b>	<b>(3.407.503)</b>	<b>31.914</b>	<b>(217.443)</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(16)	209	0	16
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>269.531</b>	<b>(3.407.294)</b>	<b>31.914</b>	<b>(217.427)</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ 269.531</b>	<b>\$ (3.407.294)</b>	<b>\$ 31.914</b>	<b>\$ (217.427)</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

(1) Der Diversified Income ESG Fund wurde am 27. Juli 2022 aufgelegt.

(2) Emerging Local Bond ESG Fund wurde am 27. Juli 2022 aufgelegt.

Diversified Income ESG Fund <sup>(1)</sup>		Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund <sup>(2)</sup>
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 701	\$ 83.905	\$ 39.672	€ 60.266	€ 26.755	\$ 84.704	\$ 56.141	\$ 243	
0	2.045	0	0	0	498	0	0	
(2)	(3.875)	3.920	(123.631)	52.910	(8.824)	(103.116)	97	
(265)	50.224	(106.614)	(171.519)	87.867	41.594	38.937	47	
(307)	(22.506)	(4.667)	7.680	19.831	3.626	(8.902)	10	
(201)	14.326	(286.244)	162.189	(753.300)	97.627	(227.906)	327	
(205)	106.698	(60.781)	12.190	(125.561)	7.059	(23.421)	(47)	
0	586	(655)	22.296	897	(4.724)	(1.854)	0	
(279)	231.403	(415.369)	(30.529)	(690.601)	221.560	(270.121)	677	
(98)	(16.606)	(13.868)	(30.207)	(42.520)	(11.305)	(9.592)	(26)	
0	(84)	(105)	(19)	(19)	(36)	(59)	0	
0	(64)	(97)	0	0	0	0	0	
(1)	(3)	(1)	(175)	(209)	(1)	(1)	0	
(99)	(16.757)	(14.071)	(30.401)	(42.748)	(11.342)	(9.652)	(26)	
0	228	231	565	621	0	0	0	
(99)	(16.529)	(13.840)	(29.836)	(42.127)	(11.342)	(9.652)	(26)	
(378)	214.874	(429.209)	(60.365)	(732.728)	210.218	(279.773)	651	
0	(797)	(28)	(636)	(647)	(5.964)	(3.419)	(3)	
0	0	0	0	0	0	0	0	
0	(4.869)	(3.803)	(3.405)	(3.860)	(8.029)	(5.728)	(2)	
0	(47)	(684)	479	(107)	261	(8)	0	
0	(5.713)	(4.515)	(3.562)	(4.614)	(13.732)	(9.155)	(5)	
(378)	209.161	(433.724)	(63.927)	(737.342)	196.486	(288.928)	646	
(2)	(49)	11	(2.177)	(6.884)	(739)	(523)	(2)	
0	0	(11)	0	0	(673)	(154)	(9)	
(380)	209.112	(433.724)	(66.104)	(744.226)	195.074	(289.605)	635	
\$ (380)	\$ 209.112	\$ (433.724)	€ (66.104)	€ (744.226)	\$ 195.074	\$ (289.605)	\$ 635	

## Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 108.490	\$ 102.966	\$ 69.582	\$ 60.303
Sonstige Erträge	1.298	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(34.567)	(136.347)	(75.552)	(74.275)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	9.227	(113.944)	20.332	(105.036)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	2.144	(3.818)	944	(1.992)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	81.031	(749.330)	107.494	(540.974)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	2.443	(70.546)	(2.752)	(49.893)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	858	(69)	122	(222)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	170.924	(971.088)	120.170	(712.089)
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(14.672)	(17.626)	(10.963)	(10.984)
Servicegebühr	(13)	(17)	(5)	(3)
Bestandspflegegebühr	(56)	(79)	(3)	(4)
Sonstige Aufwendungen	(3)	(2)	(2)	(1)
Gesamtaufwendungen	(14.744)	(17.724)	(10.973)	(10.992)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(14.744)	(17.724)	(10.973)	(10.992)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	156.180	(988.812)	109.197	(723.081)
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(2.991)	(482)	(1.483)	(114)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(19.646)	(27.780)	(13.396)	(13.814)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	156	254	(838)	547
Summe Finanzierungskosten	(22.481)	(28.008)	(15.717)	(13.381)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	133.699	(1.016.820)	93.480	(736.462)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(119)	(59)	5	13
Kapitalertragsteuer	(5)	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	133.575	(1.016.879)	93.485	(736.449)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 133.575	\$ (1.016.879)	\$ 93.485	\$ (736.449)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 4.269	\$ 3.937	\$ 5.081	\$ 4.790	\$ 558	\$ 321	\$ 5.673	\$ 1.828
274	0	0	0	144	0	0	0
(8.005)	(5.129)	(3.419)	(16.594)	168	(262)	(2.034)	(483)
2.942	(7.168)	4.580	1.705	670	(364)	(3.062)	559
1	(102)	(1.229)	502	122	(4)	251	(115)
7.136	(33.691)	4.216	(24.936)	103	(2.196)	3.258	(18.395)
(1.517)	(4.540)	2.929	(8.358)	(607)	497	(984)	(4.995)
6	(9)	17	(8)	14	(3)	81	43
5.106	(46.702)	12.175	(42.899)	1.172	(2.011)	3.183	(21.558)
(996)	(1.131)	(388)	(1.119)	(152)	(201)	(806)	(442)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	(21)	0
0	0	0	0	0	0	(6)	0
(996)	(1.131)	(388)	(1.119)	(152)	(201)	(833)	(442)
0	0	1	1	3	4	0	0
(996)	(1.131)	(387)	(1.118)	(149)	(197)	(833)	(442)
4.110	(47.833)	11.788	(44.017)	1.023	(2.208)	2.350	(22.000)
(29)	(2)	(14)	(9)	(7)	(1)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(23)	(7)	0	0	(1.248)	(365)
0	0	0	0	0	0	4	(2)
(29)	(2)	(37)	(16)	(7)	(1)	(1.244)	(367)
4.081	(47.835)	11.751	(44.033)	1.016	(2.209)	1.106	(22.367)
(5)	2	(40)	(44)	(1)	(6)	0	(8)
0	0	8	5	1	(1)	0	0
4.076	(47.833)	11.719	(44.072)	1.016	(2.216)	1.106	(22.375)
\$ 4.076	\$ (47.833)	\$ 11.719	\$ (44.072)	\$ 1.016	\$ (2.216)	\$ 1.106	\$ (22.375)



## Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	€ 22.648	€ 15.324	€ 7.837	€ 6.146
Sonstige Erträge	359	0	17	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(82.934)	(51.316)	(24.398)	(10.937)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(31.337)	(69.476)	(961)	(45.245)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	4.011	1.769	371	2.065
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	67.301	(174.838)	28.907	(76.085)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	68.666	142	8.150	(16.858)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(603)	(929)	(594)	(104)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	48.111	(279.324)	19.329	(141.018)
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(4.987)	(5.840)	(1.453)	(2.174)
Servicegebühr	(30)	(34)	0	0
Bestandspflegegebühr	0	(6)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)	0	(1)
Gesamtaufwendungen	(5.018)	(5.881)	(1.453)	(2.175)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	329	275	89	92
Betriebskosten, netto	(4.689)	(5.606)	(1.364)	(2.083)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	43.422	(284.930)	17.965	(143.101)
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(131)	(129)	(59)	(74)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(537)	(473)	(202)	(781)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(35)	(4)	(9)	11
Summe Finanzierungskosten	(703)	(606)	(270)	(844)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	42.719	(285.536)	17.695	(143.945)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(51)	2	0	1
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	42.668	(285.534)	17.695	(143.944)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	€ 42.668	€ (285.534)	€ 17.695	€ (143.944)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
€ 20.803	€ 22.950	€ 1.471	€ 871	€ 3.681	€ 1.448	€ 5.210	€ 2.919
6	0	63	0	12	0	0	0
(48.614)	(35.223)	(20.288)	(3.560)	(3.351)	(1.234)	(6.228)	(1.032)
9.453	(14.618)	(13.811)	(12.896)	1.343	4.763	678	(1.939)
5.817	7.059	243	32	(170)	996	117	179
49.623	(207.195)	21.727	(24.392)	4.196	(17.953)	8.574	(23.505)
4.948	(40.275)	15.292	(1.445)	(977)	2.434	60	(513)
251	175	(57)	(36)	134	62	(35)	(23)
42.287	(267.127)	4.640	(41.426)	4.868	(9.484)	8.376	(23.914)
(7.214)	(10.341)	(259)	(312)	(448)	(851)	(219)	(25)
(33)	(39)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(68)	(80)	0	0	0	0	0	0
(7.315)	(10.460)	(259)	(312)	(448)	(851)	(219)	(25)
195	142	12	4	0	0	19	15
(7.120)	(10.318)	(247)	(308)	(448)	(851)	(200)	(10)
35.167	(277.445)	4.393	(41.734)	4.420	(10.335)	8.176	(23.924)
(243)	(120)	(13)	(8)	(8)	(52)	(3)	(26)
0	0	0	0	0	0	0	0
(6.848)	(7.858)	0	0	0	0	0	0
(31)	(544)	0	0	0	0	0	0
(7.122)	(8.522)	(13)	(8)	(8)	(52)	(3)	(26)
28.045	(285.967)	4.380	(41.742)	4.412	(10.387)	8.173	(23.950)
(1)	2	(7)	0	2	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
28.044	(285.965)	4.373	(41.742)	4.414	(10.387)	8.173	(23.950)
€ 28.044	€ (285.965)	€ 4.373	€ (41.742)	€ 4.414	€ (10.387)	€ 8.173	€ (23.950)

## Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenerträge	€ 2.654	€ 2.451	\$ 7.573	\$ 8.331
Sonstige Erträge	2	0	166	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(8.500)	(6.872)	(8.671)	(4.236)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	1.303	9.870	3.498	(8.952)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	155	565	316	(477)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	9.649	(25.579)	14.032	(64.938)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(3.786)	9.133	(6.890)	(7.107)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	14	(182)	(299)	1.595
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	1.491	(10.614)	9.725	(75.784)
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(355)	(645)	(1.465)	(1.725)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	0	0
Gesamtaufwendungen	(355)	(645)	(1.465)	(1.725)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	25	49	0	0
Betriebskosten, netto	(330)	(596)	(1.465)	(1.725)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	1.161	(11.210)	8.260	(77.509)
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(17)	(30)	(81)	(51)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	(2.225)	(1.978)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	0	0	0
Summe Finanzierungskosten	(17)	(30)	(2.306)	(2.029)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	1.144	(11.240)	5.954	(79.538)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(5)	0	(6)	(13)
Kapitalertragsteuer	0	0	(8)	9
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	1.139	(11.240)	5.940	(79.542)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	€ 1.139	€ (11.240)	\$ 5.940	\$ (79.542)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund		PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 172.649	\$ 135.508	\$ 50.235	\$ 17.566	\$ 10.248	\$ 9.449	\$ 12.416	\$ 6.371
3.707	0	0	0	285	0	729	0
(144.975)	(138.224)	(6.283)	(64.696)	(4.851)	(5.494)	(2.455)	(16.957)
(60.657)	70.835	(74.830)	(12.939)	(9.960)	11.576	20.337	(117.852)
(21.493)	(45.306)	(201)	(9.773)	(1.230)	(4.054)	(2.083)	(127)
1.883	(1.646.386)	(49.756)	(277.444)	(6.532)	(110.407)	(15.061)	(59.134)
428.444	(259.223)	148.590	(64.724)	39.158	14.705	39.440	(35.070)
(7.263)	17.446	(1.859)	(501)	(839)	2.461	(409)	(281)
372.295	(1.865.350)	65.896	(412.511)	26.279	(81.764)	52.914	(223.050)
(36.839)	(39.175)	(8.138)	(5.582)	(1.949)	(2.261)	(4.774)	(5.477)
(766)	(718)	(17)	(19)	(12)	(16)	(18)	(16)
(58)	(56)	0	(2)	(26)	(30)	0	0
(63)	(71)	(2)	(1)	0	0	0	0
(37.726)	(40.020)	(8.157)	(5.604)	(1.987)	(2.307)	(4.792)	(5.493)
1.396	1.564	0	0	1	1	166	176
(36.330)	(38.456)	(8.157)	(5.604)	(1.986)	(2.306)	(4.626)	(5.317)
335.965	(1.903.806)	57.739	(418.115)	24.293	(84.070)	48.288	(228.367)
(2.651)	(640)	(746)	(55)	(173)	(79)	(260)	(41)
0	0	0	0	0	0	0	0
(16.775)	(14.147)	(7.316)	(3.468)	(1.208)	(901)	(1.398)	(1.527)
714	(326)	(378)	117	44	(68)	(29)	(363)
(18.712)	(15.113)	(8.440)	(3.406)	(1.337)	(1.048)	(1.687)	(1.931)
317.253	(1.918.919)	49.299	(421.521)	22.956	(85.118)	46.601	(230.298)
4	(225)	(658)	(37)	(3)	(12)	(295)	(373)
0	(3)	0	0	0	0	0	0
317.257	(1.919.147)	48.641	(421.558)	22.953	(85.130)	46.306	(230.671)
\$ 317.257	\$ (1.919.147)	\$ 48.641	\$ (421.558)	\$ 22.953	\$ (85.130)	\$ 46.306	\$ (230.671)

## Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global High Yield Bond Fund		Global Investment Grade Credit Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 82.477	\$ 102.882	\$ 213.040	\$ 206.572
Sonstige Erträge	996	0	3.970	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(64.412)	(8.163)	(320.703)	(364.265)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	32.096	(87.771)	31.909	(436.718)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(3.581)	(13.879)	(10.330)	(38.102)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	136.901	(831.242)	483.163	(2.030.117)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	351	(71.956)	69.898	(223.463)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(613)	(274)	(1.441)	(6.696)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	184.215	(910.403)	469.506	(2.892.789)
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(11.191)	(15.462)	(35.438)	(42.302)
Servicegebühr	(17)	(32)	(1.200)	(1.376)
Bestandspflegegebühr	(121)	(187)	(591)	(785)
Sonstige Aufwendungen	(19)	(21)	(70)	(83)
Gesamtaufwendungen	(11.348)	(15.702)	(37.299)	(44.546)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	445	449
Betriebskosten, netto	(11.348)	(15.702)	(36.854)	(44.097)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	172.867	(926.105)	432.652	(2.936.886)
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(394)	(63)	(989)	(1.584)
Aufwand für Kreditfazilitäten	(350)	(313)	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(26.056)	(33.177)	(49.362)	(55.106)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	65	385	482	(3.834)
Summe Finanzierungskosten	(26.735)	(33.168)	(49.869)	(60.524)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	146.132	(959.273)	382.783	(2.997.410)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	0	(188)	(227)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	146.132	(959.273)	382.595	(2.997.637)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 146.132	\$ (959.273)	\$ 382.595	\$ (2.997.637)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund		Income Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 32.154	\$ 17.311	\$ 26.758	\$ 43.394	\$ 29.916	\$ 130.217	\$ 1.539.543	\$ 1.081.564
0	0	0	0	1.734	0	0	0
(38.347)	(19.154)	(22.734)	(18.461)	(65.319)	(82.178)	(890.181)	(1.327.161)
(11.095)	(23.201)	19.436	19.213	15.092	154.697	866.814	388.804
(293)	(8.975)	72	(3.491)	(3.548)	(16.457)	(34.847)	(63.921)
55.391	(264.585)	35.544	(110.034)	129.216	(791.364)	977.376	(7.982.341)
1.426	(39.232)	(20.176)	(14.347)	(11.965)	2.983	(257.063)	(885.815)
(179)	(386)	338	201	736	95	36.810	9.998
39.057	(338.222)	39.238	(83.525)	95.862	(602.007)	2.238.452	(8.778.872)
(4.209)	(3.579)	(4.389)	(3.656)	(8.243)	(10.799)	(287.322)	(296.445)
0	0	(12)	(11)	(152)	(248)	(6.709)	(8.044)
(798)	(722)	0	0	(103)	(167)	(15.644)	(15.404)
(1)	(1)	(1)	(1)	(2)	(2)	(1.729)	(1.892)
(5.008)	(4.302)	(4.402)	(3.668)	(8.500)	(11.216)	(311.404)	(321.785)
0	0	0	0	0	0	499	504
(5.008)	(4.302)	(4.402)	(3.668)	(8.500)	(11.216)	(310.905)	(321.281)
34.049	(342.524)	34.836	(87.193)	87.362	(613.223)	1.927.547	(9.100.153)
(3.342)	(116)	(8.678)	(481)	(19.567)	(2.042)	(8.155)	(1.638)
0	0	0	0	0	0	0	0
(7.612)	(5.659)	(3.796)	(4.566)	(16.743)	(21.808)	(968.561)	(690.822)
(440)	826	(29)	(33)	46	(33)	(2.574)	(2.945)
(11.394)	(4.949)	(12.503)	(5.080)	(36.264)	(23.883)	(979.290)	(695.405)
22.655	(347.473)	22.333	(92.273)	51.098	(637.106)	948.257	(9.795.558)
(56)	(27)	(46)	0	(1)	8	(8.186)	(1.468)
0	0	0	0	0	(1)	(443)	(122)
22.599	(347.500)	22.287	(92.273)	51.097	(637.099)	939.628	(9.797.148)
\$ 22.599	\$ (347.500)	\$ 22.287	\$ (92.273)	\$ 51.097	\$ (637.099)	\$ 939.628	\$ (9.797.148)

## Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Income Fund II		Inflation Multi-Asset Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 2.160	\$ 494	\$ 4.991	\$ 7.876
Sonstige Erträge	0	0	2	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(190)	(332)	(2.963)	1.543
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(405)	126	616	14.169
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	122	(4)	1.000	(1.098)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	886	(3.661)	7.057	(39.135)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(69)	(38)	(4.752)	(19.924)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	24	5	72	34
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	2.528	(3.410)	6.023	(36.535)
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(531)	(130)	(2.281)	(2.015)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	(21)	(14)
Sonstige Aufwendungen	(2)	(1)	0	0
Gesamtaufwendungen	(533)	(131)	(2.302)	(2.029)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(533)	(131)	(2.302)	(2.029)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	1.995	(3.541)	3.721	(38.564)
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(71)	0	(64)	(2)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(1.680)	(187)	(323)	(359)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	58	4	(4)	40
Summe Finanzierungskosten	(1.693)	(183)	(391)	(321)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	302	(3.724)	3.330	(38.885)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(28)	0	(181)	(122)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	274	(3.724)	3.149	(39.007)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 274	\$ (3.724)	\$ 3.149	\$ (39.007)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.



Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund		Low Duration Opportunities Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 21.660	\$ 10.329	\$ 14.194	\$ 6.056	\$ 31.699	\$ 17.978	\$ 23.132	\$ 26.353
447	0	0	0	0	0	0	0
(18.982)	(22.364)	(5.391)	(9.517)	(17.630)	(32.369)	(20.610)	(8.053)
(7.707)	9.023	127	(31.826)	10.780	(29.879)	(1.233)	(155.897)
9	(1.331)	(334)	(2.046)	(423)	75	8.451	(5.750)
19.793	(62.880)	10.639	(47.040)	23.985	(105.544)	34.966	(256.550)
1.302	2.631	2.379	(19.231)	23.185	(31.490)	40.725	(149.249)
(417)	(70)	(66)	(94)	558	(143)	76	(277)
16.105	(64.662)	21.548	(103.698)	72.154	(181.372)	85.507	(549.423)
(2.723)	(4.068)	(1.994)	(1.907)	(4.028)	(4.242)	(2.886)	(8.069)
(32)	(47)	0	0	0	(1)	(8)	(12)
(25)	(30)	0	0	0	0	0	0
(1)	(1)	0	0	(1)	(1)	(1)	(2)
(2.781)	(4.146)	(1.994)	(1.907)	(4.029)	(4.244)	(2.895)	(8.083)
83	84	0	0	0	0	106	107
(2.698)	(4.062)	(1.994)	(1.907)	(4.029)	(4.244)	(2.789)	(7.976)
13.407	(68.724)	19.554	(105.605)	68.125	(185.616)	82.718	(557.399)
(3.162)	(53)	(532)	(46)	(275)	(12)	(269)	(43)
0	0	0	0	0	0	0	0
(879)	(384)	(248)	(202)	(2.284)	(2.762)	(4.241)	(4.267)
(99)	4	(2)	21	224	(295)	(255)	(56)
(4.140)	(433)	(782)	(227)	(2.335)	(3.069)	(4.765)	(4.366)
9.267	(69.157)	18.772	(105.832)	65.790	(188.685)	77.953	(561.765)
(20)	(35)	(40)	0	(3)	(4)	89	(12)
0	0	0	0	0	0	0	(2)
9.247	(69.192)	18.732	(105.832)	65.787	(188.689)	78.042	(561.779)
\$ 9.247	\$ (69.192)	\$ 18.732	\$ (105.832)	\$ 65.787	\$ (188.689)	\$ 78.042	\$ (561.779)

## Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Low Duration Opportunities ESG Fund <sup>(3)</sup>			PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>						
Zins- und Dividenderträge	\$ 103	\$ 2.443	\$ 1.872			
Sonstige Erträge	0	0	0			
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	20	1.586	8.257			
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(47)	3.968	9.466			
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(4)	22	(32)			
Nettoveränderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(6)	(3.390)	(3.270)			
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	37	771	(9.022)			
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(1)	6	(3)			
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	102	5.406	7.268			
<b>Betriebskosten</b>						
Verwaltungsgebühr	(13)	(565)	(677)			
Servicegebühr	0	0	0			
Bestandspflegegebühr	0	0	0			
Sonstige Aufwendungen	0	0	0			
Gesamtaufwendungen	(13)	(565)	(677)			
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0			
Betriebskosten, netto	(13)	(565)	(677)			
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>89</b>	<b>4.841</b>	<b>6.591</b>			
<b>Finanzierungskosten</b>						
Zinsaufwendungen	0	(20)	(2)			
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0			
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(1)	(658)	(1.019)			
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	(35)	(162)			
Summe Finanzierungskosten	(1)	(713)	(1.183)			
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>88</b>	<b>4.128</b>	<b>5.408</b>			
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	(333)	(501)			
Kapitalertragsteuer	0	0	0			
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>88</b>	<b>3.795</b>	<b>4.907</b>			
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ 88</b>	<b>\$ 3.795</b>	<b>\$ 4.907</b>			

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

<sup>(3)</sup> Low Duration Opportunities ESG Fund wurde am 27. Juli 2022 aufgelegt.

Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 23.325	\$ 34.884	\$ 31.119	\$ 15.113	\$ 207	\$ 60	\$ 12.823	\$ 12.792
6	0	36	0	0	0	0	0
(58.626)	(28.024)	(16.459)	(21.446)	(46)	48	(6.895)	687
10.480	1.021	109.846	(405.427)	686	(1.276)	10.817	(26.297)
(1.185)	(3.948)	(370)	(4.976)	(22)	0	(522)	71
66.020	(168.883)	24.785	(112.687)	13	(491)	11.162	(69.048)
(11.895)	(53.916)	85.329	(176.311)	886	(1.236)	(3.915)	(13.662)
1.457	108	8	(31)	0	(1)	264	(54)
29.582	(218.758)	234.294	(705.765)	1.724	(2.896)	23.734	(95.511)
(2.614)	(5.633)	(4.906)	(8.247)	(36)	(37)	(3.208)	(4.005)
(44)	(70)	(37)	(25)	0	0	0	0
(4)	0	0	0	0	0	0	0
0	(1)	(5)	(3)	0	0	(46)	(55)
(2.662)	(5.704)	(4.948)	(8.275)	(36)	(37)	(3.254)	(4.060)
0	0	0	0	1	1	0	0
(2.662)	(5.704)	(4.948)	(8.275)	(35)	(36)	(3.254)	(4.060)
26.920	(224.462)	229.346	(714.040)	1.689	(2.932)	20.480	(99.571)
(7.636)	(765)	(184)	(26)	0	0	(117)	(144)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.407)	(5.834)	(434)	(41)	0	0	(2.691)	(2.798)
(450)	16	7	(2)	0	0	(62)	(22)
(9.493)	(6.583)	(611)	(69)	0	0	(2.870)	(2.964)
17.427	(231.045)	228.735	(714.109)	1.689	(2.932)	17.610	(102.535)
0	0	1	11	0	0	(704)	(557)
0	0	0	0	0	0	(5)	(2)
17.427	(231.045)	228.736	(714.098)	1.689	(2.932)	16.901	(103.094)
\$ 17.427	\$ (231.045)	\$ 228.736	\$ (714.098)	\$ 1.689	\$ (2.932)	\$ 16.901	\$ (103.094)

## Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 84.744	\$ 49.726	\$ 9.305	\$ 326
Sonstige Erträge	4.080	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(54.618)	(191.151)	2.055	(3.031)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(7.773)	45.966	(28.724)	11.123
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(2.910)	(13.223)	(1.749)	(581)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	117.352	(569.169)	(6.449)	(1.506)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(29.541)	(31.153)	15.082	6.647
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	219	(293)	95	291
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	111.553	(709.297)	(10.385)	13.269
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(16.143)	(16.840)	(2.635)	(711)
Servicegebühr	(873)	(682)	(5)	0
Bestandspflegegebühr	(446)	(351)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(20)	(21)	0	0
Gesamtaufwendungen	(17.482)	(17.894)	(2.640)	(711)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	512	44	4
Betriebskosten, netto	(17.482)	(17.382)	(2.596)	(707)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	94.071	(726.679)	(12.981)	12.562
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(500)	(522)	(216)	(31)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(10.113)	(7.363)	(1.312)	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(16)	6	12	0
Summe Finanzierungskosten	(10.629)	(7.879)	(1.516)	(31)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	83.442	(734.558)	(14.497)	12.531
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(192)	3	0	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	83.250	(734.555)	(14.497)	12.531
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 83.250	\$ (734.555)	\$ (14.497)	\$ 12.531

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
£ 7.122	£ 5.780	£ 6.796	£ 5.441	\$ 61.723	\$ 89.165	\$ 9.367	\$ 11.166
30	0	83	0	365	0	0	0
(8.084)	(6.552)	(13.392)	(13.229)	(62.031)	(14.111)	(4.417)	(54.490)
4.123	(7.824)	2.534	(12.538)	12.692	(48.533)	1.316	(27.266)
(10)	(76)	27	39	42	(1.248)	210	(521)
(3.359)	(65.594)	(2.332)	(69.491)	107.278	(580.152)	8.433	(69.863)
(2.489)	(2.182)	(1.462)	(3.480)	(2.449)	(25.796)	3.982	(18.953)
(65)	33	(31)	(18)	(33)	(29)	(65)	74
(2.732)	(76.415)	(7.777)	(93.276)	117.587	(580.704)	18.826	(159.853)
(671)	(1.069)	(721)	(879)	(6.895)	(10.592)	(1.212)	(1.722)
0	0	0	0	(471)	(722)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	(1)	(2)	0	0
(671)	(1.069)	(721)	(879)	(7.367)	(11.316)	(1.212)	(1.722)
5	2	0	0	0	0	0	0
(666)	(1.067)	(721)	(879)	(7.367)	(11.316)	(1.212)	(1.722)
(3.398)	(77.482)	(8.498)	(94.155)	110.220	(592.020)	17.614	(161.575)
(317)	(115)	(141)	(39)	(151)	0	(36)	(28)
0	0	0	0	(254)	(240)	0	0
(3.656)	(3.974)	(797)	(700)	(10.534)	(15.889)	(1.917)	(4.678)
(161)	24	(7)	(1)	115	46	89	(996)
(4.134)	(4.065)	(945)	(740)	(10.824)	(16.083)	(1.864)	(5.702)
(7.532)	(81.547)	(9.443)	(94.895)	99.396	(608.103)	15.750	(167.277)
0	6	0	0	0	(22)	(39)	(29)
0	0	0	0	0	0	0	0
(7.532)	(81.541)	(9.443)	(94.895)	99.396	(608.125)	15.711	(167.306)
£ (7.532)	£ (81.541)	£ (9.443)	£ (94.895)	\$ 99.396	\$ (608.125)	\$ 15.711	\$ (167.306)

## Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenerträge	\$ 47.173	\$ 20.765	\$ 3.621.191	\$ 3.018.223
Sonstige Erträge	0	0	23.737	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(28.034)	(32.581)	(3.311.905)	(3.410.275)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	2.688	32.774	833.179	(873.460)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(876)	(616)	(90.477)	(362.866)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	44.606	(98.443)	3.658.223	(24.536.624)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(3.479)	21.526	744.967	(3.331.411)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(18)	(105)	47.262	16.998
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	62.060	(56.680)	5.526.177	(29.479.415)
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(4.354)	(5.191)	(660.693)	(758.453)
Servicegebühr	(24)	(29)	(11.708)	(14.153)
Bestandspflegegebühr	0	0	(19.017)	(19.242)
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)	(2.639)	(2.927)
Gesamtaufwendungen	(4.379)	(5.221)	(694.057)	(794.775)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	371	443	5.159	6.853
Betriebskosten, netto	(4.008)	(4.778)	(688.898)	(787.922)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>58.052</b>	<b>(61.458)</b>	<b>4.837.279</b>	<b>(30.267.337)</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(231)	(747)	(92.810)	(16.747)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	(604)	(553)
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(15.308)	(5.821)	(1.342.840)	(1.111.604)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(44)	(13)	(7.256)	(14.711)
Summe Finanzierungskosten	(15.583)	(6.581)	(1.443.510)	(1.143.615)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>42.469</b>	<b>(68.039)</b>	<b>3.393.769</b>	<b>(31.410.952)</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	(18)	(14.296)	(11.872)
Kapitalertragsteuer	0	0	(1.134)	(282)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>42.469</b>	<b>(68.057)</b>	<b>3.378.339</b>	<b>(31.423.106)</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ 42.469</b>	<b>\$ (68.057)</b>	<b>\$ 3.378.339</b>	<b>\$ (31.423.106)</b>

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)



## Ausweis der Nettovermögensänderungen

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund		PIMCO Capital Securities Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.981.392	\$ 3.411.923	\$ 313.987	\$ 361.011	\$ 5.721.591	\$ 9.110.409
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	461.927	1.624.590	64.256	63.208	1.152.469	1.061.822
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.598	4.497	681	316	4.901	5.034
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(621.025)	(1.208.330)	(57.745)	(49.053)	(1.317.218)	(2.725.487)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(28.721)	(801.554)	(1.360)	(62.908)	(111.741)	(1.500.717)
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.796.171	\$ 3.031.126	\$ 319.819	\$ 312.574	\$ 5.450.002	\$ 5.951.061
	Diversified Income Duration Hedged Fund		Diversified Income ESG Fund <sup>(1)</sup>		Dynamic Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum		Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 564.684	\$ 1.305.365	\$ 9.854		\$ 3.483.601	\$ 3.277.997
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	16.092	37.493	50.269		187.421	312.414
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	25	14	0		705	747
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(91.148)	(315.292)	(1.754)		(513.546)	(721.606)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0		0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	31.914	(217.427)	(380)		209.112	(433.724)
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 521.567	\$ 810.153	\$ 57.989		\$ 3.367.293	\$ 2.435.828
	Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.492.475	\$ 2.635.769	\$ 168.986	\$ 212.894	\$ 205.131	\$ 290.475
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	298.339	948.977	3.563	11.490	38.588	64.474
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	527	962	0	0	22	7
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(522.493)	(652.057)	(16.892)	(21.579)	(24.892)	(41.842)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	93.485	(736.449)	4.076	(47.833)	11.719	(44.072)
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.362.333	\$ 2.197.202	\$ 159.733	\$ 154.972	\$ 230.568	\$ 269.042

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

<sup>(1)</sup> Der Diversified Income ESG Fund wurde am 27. Juli 2022 aufgelegt.

<sup>(2)</sup> Emerging Local Bond ESG Fund wurde am 27. Juli 2022 aufgelegt.

PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		Diversified Income Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 292.655	\$ 328.081	\$ 1.369.877	\$ 1.444.182	\$ 97.153	\$ 139.704	\$ 8.751.796	\$ 16.447.733
95.287	71.635	235.884	1.074.681	4.461	5.489	888.864	1.118.430
2	136	0	0	0	0	7.326	10.732
(106.394)	(54.800)	(518.107)	(859.208)	(5.449)	(8.275)	(1.974.800)	(4.099.599)
0	0	0	0	0	0	0	0
7.974	(70.877)	(114.488)	152.570	3.631	(15.973)	269.531	(3.407.294)
\$ 289.524	\$ 274.175	\$ 973.166	\$ 1.812.225	\$ 99.796	\$ 120.945	\$ 7.942.717	\$ 10.070.002
Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund <sup>(2)</sup>		Emerging Markets Bond Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
€ 5.115.170	€ 7.635.950	\$ 1.919.668	\$ 2.151.129	\$ 6.609	\$ 3.305.979	\$ 4.714.744	
263.195	557.167	1.046.430	490.111	446	493.414	982.073	
35	49	1.071	999	2	1.331	2.131	
(1.054.085)	(1.367.212)	(376.800)	(499.751)	0	(544.652)	(1.467.932)	
0	0	0	0	0	0	0	
(66.104)	(744.226)	195.074	(289.605)	635	133.575	(1.016.879)	
€ 4.258.211	€ 6.081.728	\$ 2.785.443	\$ 1.852.883	\$ 7.692	\$ 3.389.647	\$ 3.214.137	
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund		Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 20.937	\$ 29.760	\$ 237.961	\$ 125.087	€ 1.913.275	€ 2.574.129	€ 610.008	€ 1.017.163
2.533	7.100	109.092	72.168	242.427	211.134	84.231	246.063
0	0	432	95	0	0	0	235
(4.403)	(9.015)	(93.899)	(23.835)	(444.809)	(444.326)	(101.995)	(315.369)
0	0	0	0	0	0	0	0
1.016	(2.216)	1.106	(22.375)	42.668	(285.534)	17.695	(143.944)
\$ 20.083	\$ 25.629	\$ 254.692	\$ 151.140	€ 1.753.561	€ 2.055.403	€ 609.939	€ 804.148

## Aufstellung über die Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	€ 1.352.980	€ 2.482.304	€ 110.048	€ 160.601	€ 353.095	€ 629.859
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	130.742	357.731	362.362	18.010	23.762	32.982
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	13	987	0	0	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(249.609)	(944.650)	(26.818)	(21.658)	(167.912)	(145.195)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	28.044	(285.965)	4.373	(41.742)	4.414	(10.387)
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	€ 1.262.170	€ 1.610.407	€ 449.965	€ 115.211	€ 213.359	€ 507.259
	Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund		PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 3.106.190	\$ 2.302.966	\$ 716.022	\$ 911.707	\$ 750.076	\$ 1.035.021
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	814.491	589.111	79.619	178.248	39.784	121.244
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3.499	1.948	454	348	4	3
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(627.987)	(294.593)	(88.472)	(271.535)	(167.583)	(146.305)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	48.641	(421.558)	22.953	(85.130)	46.306	(230.671)
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 3.344.834	\$ 2.177.874	\$ 730.576	\$ 733.638	\$ 668.587	\$ 779.292
	Global Real Return Fund		Income Fund		Income Fund II	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.571.862	\$ 3.703.379	\$ 57.980.327	\$ 73.579.726	\$ 56.623	\$ 27.770
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	270.535	511.183	13.763.965	9.993.226	86.951	9.537
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.724	2.840	77.852	53.873	17	42
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(384.549)	(783.240)	(8.234.205)	(16.972.510)	(46.148)	(1.548)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	51.097	(637.099)	939.628	(9.797.148)	274	(3.724)
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.510.669	\$ 2.797.063	\$ 64.527.567	\$ 56.857.167	\$ 97.717	\$ 32.077

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund		Global Bond Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
€ 174.162	€ 170.489	€ 211.172	€ 395.491	\$ 410.459	\$ 521.067	\$ 11.420.112	\$ 14.038.846
108.227	6.506	25.909	53.364	2.120	14.290	3.108.542	1.829.723
0	0	0	0	0	0	1.646	1.567
(65.889)	(9.060)	(90.342)	(163.937)	(6.904)	(20.204)	(2.235.847)	(2.625.242)
0	0	0	0	0	0	0	0
8.173	(23.950)	1.139	(11.240)	5.940	(79.542)	317.257	(1.919.147)
€ 224.673	€ 143.985	€ 147.878	€ 273.678	\$ 411.615	\$ 435.611	\$ 12.611.710	\$ 11.325.747
Global High Yield Bond Fund		Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 3.102.868	\$ 5.169.160	\$ 10.538.341	\$ 17.154.925	\$ 1.369.890	\$ 1.189.563	\$ 1.364.375	\$ 1.199.076
494.510	751.865	2.744.657	2.112.051	754.616	866.139	254.055	346.002
1.377	1.143	2.085	2.628	12	308	13	0
(675.051)	(1.438.485)	(3.174.827)	(5.254.660)	(327.768)	(282.014)	(387.573)	(470.577)
0	0	0	0	0	0	0	0
146.132	(959.273)	382.595	(2.997.637)	22.599	(347.500)	22.287	(92.273)
\$ 3.069.836	\$ 3.524.410	\$ 10.492.851	\$ 11.017.307	\$ 1.819.349	\$ 1.426.496	\$ 1.253.157	\$ 982.228
Inflation Multi-Asset Fund		Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 403.078	\$ 164.345	\$ 1.072.758	\$ 1.179.138	\$ 654.749	\$ 806.869	\$ 1.084.380	\$ 1.367.475
13.707	396.530	71.088	1.094.731	159.600	88.461	437.266	469.983
73	102	306	131	172	101	58	25
(95.829)	(50.789)	(267.387)	(628.372)	(35.036)	(111.063)	(132.106)	(618.274)
0	0	0	0	0	0	0	0
3.149	(39.007)	9.247	(69.192)	18.732	(105.832)	65.787	(188.689)
\$ 324.178	\$ 471.181	\$ 886.012	\$ 1.576.436	\$ 798.217	\$ 678.536	\$ 1.455.385	\$ 1.030.520

## Aufstellung über die Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Low Duration Opportunities Fund		Low Duration Opportunities ESG Fund <sup>(3)</sup>		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 1.345.781	\$ 3.217.260	\$ 4.928		\$ 120.137	\$ 100.538
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	248.767	779.899	0		4.956	62.957
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.437	396	1		2	3
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(552.650)	(414.455)	0		(31.799)	(47.316)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0		0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	78.042	(561.779)	88		3.795	4.907
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 1.121.377	\$ 3.021.321	\$ 5.017		\$ 97.091	\$ 121.089
	Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 4.150.717	\$ 4.944.898	\$ 435.924	\$ 101.789	£ 389.173	£ 592.164
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	670.578	577.403	111.465	21.844	35.847	56.101
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5.200	4.094	4	0	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(583.376)	(727.420)	(230.532)	(12.472)	(82.653)	(61.666)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	83.250	(734.555)	(14.497)	12.531	(7.532)	(81.541)
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 4.326.369	\$ 4.064.420	\$ 302.364	\$ 123.692	£ 334.835	£ 505.058
	Summe der Gesellschaft*					
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum				
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 151.524.519	\$ 209.342.798				
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	32.330.533	33.462.234				
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	131.146	110.788				
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(29.325.755)	(53.479.245)				
Nominalwechselkursanpassungen	265.492	(1.324.437)				
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	3.378.339	(31.423.106)				
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 158.304.274	\$ 156.689.032				

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

<sup>(3)</sup> Low Duration Opportunities ESG Fund wurde am 27. Juli 2022 aufgelegt.

\* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 849.148	\$ 2.238.424	\$ 1.008.739	\$ 3.761.156	\$ 9.528	\$ 11.610	\$ 506.557	\$ 619.928
82.072	880.678	825.580	538.574	1.073	1.393	20.350	131.886
198	2.537	429	41	0	0	13	5
(328.509)	(1.283.324)	(259.525)	(1.969.507)	(743)	(299)	(81.885)	(119.881)
0	0	0	0	0	0	0	0
17.427	(231.045)	228.736	(714.098)	1.689	(2.932)	16.901	(103.094)
\$ 620.336	\$ 1.607.270	\$ 1.803.959	\$ 1.616.166	\$ 11.547	\$ 9.772	\$ 461.936	\$ 528.844
UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
£ 325.020	£ 425.748	\$ 1.984.922	\$ 3.923.786	\$ 388.522	\$ 878.100	\$ 2.310.115	\$ 2.650.198
1.886	34.072	289.270	548.535	144.702	92.249	328.573	845.504
1	1	1.930	3.080	30	3.268	12.934	5.244
(19.552)	(66.070)	(397.917)	(1.392.766)	(104.172)	(398.841)	(627.187)	(953.204)
0	0	0	0	0	0	0	0
(9.443)	(94.895)	99.396	(608.125)	15.711	(167.306)	42.469	(68.057)
£ 297.912	£ 298.856	\$ 1.977.601	\$ 2.474.510	\$ 444.793	\$ 407.470	\$ 2.066.904	\$ 2.479.685

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Asia High Yield Bond Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>AUSTRALIEN</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
Emeco Pty. Ltd.				10,875 % fällig am 23.07.2023 ^	\$ 9.800	\$ 624	0,02	Yango Justice International Ltd.			
6,250 % fällig am 10.07.2026	AUD 11.810	\$ 7.313	0,26	11,250 % fällig am 09.04.2022 ^	6.700	448	0,02	7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	\$ 17.800	\$ 374	0,02
Mineral Resources Ltd.				11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	1.450	97	0,00	7,500 % fällig am 17.02.2025 ^	3.000	26	0,00
8,000 % fällig am 01.11.2027	\$ 16.040	16.034	0,57	11,950 % fällig am 12.11.2023 ^	12.100	983	0,04	7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	5.800	87	0,00
8,125 % fällig am 01.05.2027	4.996	5.001	0,18	11,950 % fällig am 22.10.2049 ^	800	53	0,00	8,250 % fällig am 25.11.2023 ^	4.400	66	0,00
Summe Australien		28.348	1,01	KWG Group Holdings Ltd.				9,250 % fällig am 15.04.2023 ^	10.900	95	0,00
				5,950 % fällig am 10.08.2025 ^	16.723	1.782	0,06	Yunda Holding Investment Ltd.			
				Melco Resorts Finance Ltd.				2,250 % fällig am 19.08.2025	15.600	14.032	0,50
				4,875 % fällig am 06.06.2025	36.560	34.867	1,25	ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.			
				5,250 % fällig am 26.04.2026	8.324	7.713	0,28	3,125 % fällig am 16.07.2025	18.180	16.089	0,58
				5,625 % fällig am 17.07.2027	5.450	4.943	0,18	3,500 % fällig am 08.03.2026	2.890	2.500	0,09
				5,750 % fällig am 21.07.2028	47.477	42.017	1,50	Summe China		51.211	1,83
				MGM China Holdings Ltd.				<b>FRANKREICH</b>			
				4,750 % fällig am 01.02.2027	34.355	31.300	1,12	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				5,250 % fällig am 18.06.2025	8.500	8.158	0,29	<b>BNP Paribas S.A.</b>			
				5,875 % fällig am 15.05.2026	3.100	2.957	0,11	7,750 % fällig am 16.08.2029			
				New Metro Global Ltd.				(e)(g)	4.500	4.367	0,16
				4,875 % fällig am 06.06.2025	5.200	2.197	0,08	9,250 % fällig am 17.11.2027			
				6,800 % fällig am 05.08.2023	6.800	6.630	0,24	(e)(g)	4.100	4.235	0,15
				PCPD Capital Ltd.				Societe Generale S.A.			
				5,125 % fällig am 18.06.2026	3.100	2.480	0,09	9,375 % fällig am 22.11.2027			
				Powerlong Real Estate Holdings Ltd.				(e)(g)	8.600	8.428	0,30
				5,950 % fällig am 30.04.2025	17.745	1.837	0,07	Summe Frankreich			
				6,250 % fällig am 10.08.2024	1.130	113	0,00	17.030			
				Sands China Ltd.				<b>DEUTSCHLAND</b>			
				2,800 % fällig am 08.03.2027	6.834	5.937	0,21	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				3,750 % fällig am 08.08.2031	13.200	10.755	0,38	<b>Deutsche Bank AG</b>			
				4,300 % fällig am 08.01.2026	61.160	57.550	2,06	4,500 % fällig am 30.11.2026			
				4,875 % fällig am 18.06.2030	13.400	11.941	0,43	(e)(g)	€ 800	621	0,02
				5,625 % fällig am 08.08.2025	6.600	6.443	0,23	10,000 % fällig am 01.12.2027			
				5,900 % fällig am 08.08.2028	26.300	25.094	0,90	(e)(g)	5.600	6.072	0,22
				Seazen Group Ltd.				Summe Deutschland			
				4,450 % fällig am 13.07.2025	14.100	7.332	0,26	6.693			
				6,000 % fällig am 12.08.2024	14.100	10.074	0,36	<b>HONGKONG</b>			
				Shui On Development Holding Ltd.				<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>			
				5,500 % fällig am 29.06.2026	12.500	9.293	0,33	Universe Trek Ltd.			
				Sunac China Holdings Ltd.				0,000 % fällig am 15.06.2026 (c) \$			
				5,950 % fällig am 26.04.2024 ^	3.800	570	0,02	800			
				6,500 % fällig am 09.07.2023 ^	13.500	2.095	0,07	776			
				6,500 % fällig am 26.01.2026 ^	10.600	1.603	0,06	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				6,650 % fällig am 03.08.2024 ^	19.400	2.865	0,10	<b>Bank of East Asia Ltd.</b>			
				6,800 % fällig am 20.10.2024 ^	12.700	1.952	0,07	4,000 % fällig am 29.05.2030 (g)			
				7,000 % fällig am 09.07.2025 ^	9.200	1.391	0,05	4,875 % fällig am 22.04.2032 (g)			
				7,500 % fällig am 01.02.2024 ^	2.000	300	0,01	8.400			
				7,950 % fällig am 11.10.2023 ^	10.000	1.506	0,05	<b>Fortune Star BVI Ltd.</b>			
				8,350 % fällig am 19.04.2023 ^	19.200	2.839	0,10	3,950 % fällig am 02.10.2026			
				Times China Holdings Ltd.				5,000 % fällig am 18.05.2026			
				5,550 % fällig am 04.06.2024 ^	16.400	1.168	0,04	\$ 26.100			
				6,200 % fällig am 22.03.2026 ^	8.000	611	0,02	5,050 % fällig am 27.01.2027			
				6,600 % fällig am 02.03.2023 ^	7.236	549	0,02	5,950 % fällig am 19.10.2025			
				6,750 % fällig am 16.07.2023 ^	2.980	209	0,01	10.100			
				VLL International, Inc.				GLP China Holdings Ltd.			
				5,750 % fällig am 28.11.2024	24.185	23.399	0,84	2,950 % fällig am 29.03.2026			
				Wynn Macau Ltd.				Huarong Finance Co. Ltd.			
				4,875 % fällig am 01.10.2024	10.471	10.221	0,37	3,250 % fällig am 13.11.2024			
				5,125 % fällig am 15.12.2029	2.851	2.398	0,09	3,750 % fällig am 29.05.2024			
				5,500 % fällig am 15.01.2026	32.544	30.264	1,08	3,875 % fällig am 13.11.2029			
				5,500 % fällig am 01.10.2027	19.713	17.569	0,63	4,250 % fällig am 07.11.2027			
				5,625 % fällig am 26.08.2028	23.930	20.907	0,75	4,500 % fällig am 29.05.2029			
				Zhongsheng Group Holdings Ltd.				4,625 % fällig am 03.06.2026			
				3,000 % fällig am 13.01.2026	2.850	2.599	0,09	4,750 % fällig am 27.04.2027			
				Summe Cayman Inseln		609.199	21,79	4,875 % fällig am 22.11.2026			
						644.446	23,05	5,000 % fällig am 19.11.2025			
								6,625 % fällig am 24.02.2025			
								Sino-Ocean Land Treasure Finance Ltd.			
								6,000 % fällig am 30.07.2024			
								Sino-Ocean Land Treasure Ltd.			
								2,700 % fällig am 13.01.2025			
								3,250 % fällig am 05.05.2026			
								4,750 % fällig am 05.08.2029			
								4,750 % fällig am 14.01.2030			
								Yanlord Land HK Co. Ltd.			
								5,125 % fällig am 20.05.2026			
								20.199			
								16.633			
								208.938			
								209.714			
								<b>INDIEN</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								<b>Adani Green Energy Ltd.</b>			
								4,375 % fällig am 08.09.2024			
								4.800			
								<b>Adani Green Energy UP Ltd.</b>			
								6,250 % fällig am 10.12.2024			
								12.041			
								11.557			
								0,41			



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMO- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMO- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMO- GENS	
GMR Hyderabad International Airport Ltd. 4,250 % fällig am 27.10.2027	\$ 4.878	\$ 4.323	0,15	Greenko Wind Projects Mauritius Ltd. 5,500 % fällig am 06.04.2025	\$ 47.441	\$ 45.585	1,63	6,500 % fällig am 25.04.2024 (e)	\$ 1.750	\$ 1.566	0,06	
4,750 % fällig am 02.02.2026	25.175	24.006	0,86	India Airport Infra 6,250 % fällig am 25.10.2025	3.790	3.672	0,13	7,000 % fällig am 21.10.2025 (e)	16.884	14.183	0,51	
JSW Hydro Energy Ltd. 4,125 % fällig am 18.05.2031	18.186	15.360	0,55	India Cleantech Energy 4,700 % fällig am 10.08.2026	5.127	4.498	0,16	Summe Philippinen		102.072	3,65	
Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023	4.776	4.745	0,17	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	28.073	27.451	0,98	<b>SINGAPUR</b>				
Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	63.700	61.450	2,20	India Green Power Holdings 4,000 % fällig am 22.02.2027	6.102	5.339	0,19	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
ReNew Wind Energy AP2 4,500 % fällig am 14.07.2028	30.988	26.438	0,95	India Toll Roads 5,500 % fällig am 19.08.2024	27.943	26.999	0,97	Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. 4,250 % fällig am 25.03.2027	6.929	6.089	0,22	
Shriram Finance Ltd. 4,150 % fällig am 18.07.2025	6.956	6.582	0,24	Summe Mauritius		165.245	5,91	GLP Pte. Ltd. 4,500 % fällig am 17.05.2026 (e)	13.300	4.974	0,18	
4,400 % fällig am 13.03.2024	36.158	35.383	1,26	<b>MEXIKO</b>				4,600 % fällig am 29.06.2027 (e)	7.000	2.625	0,09	
Summe Indien		194.284	6,95	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Indika Energy Capital Pte. Ltd. 8,250 % fällig am 22.10.2025	19.500	19.417	0,70	
<b>INDONESIEN</b>				Banco Mercantil del Norte S.A. 5,875 % fällig am 24.01.2027	6.150	5.251	0,19	Medco Bell Pte. Ltd. 6,375 % fällig am 30.01.2027	22.200	20.802	0,74	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				(e)(g) 6,625 % fällig am 24.01.2032	4.650	3.599	0,13	Medco Laurel Tree Pte. Ltd. 6,950 % fällig am 12.11.2028	2.500	2.296	0,08	
Adaro Indonesia PT 4,250 % fällig am 31.10.2024	23.174	22.317	0,80	(e)(g) Summe Mexiko		8.850	0,32	TML Holdings Pte. Ltd. 4,350 % fällig am 09.06.2026	8.000	7.498	0,27	
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3,750 % fällig am 30.03.2026 (g)	25.754	23.855	0,85	<b>MONGOLEI</b>				5,500 % fällig am 03.06.2024	13.524	13.375	0,48	
Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7,750 % fällig am 10.02.2026	23.256	19.884	0,71	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Singapur		77.076	2,76	
Cikarang Listrindo Tbk PT 4,950 % fällig am 14.09.2026	443	423	0,01	Mongolia Government International Bond 5,125 % fällig am 07.04.2026	22.095	20.603	0,74	<b>SÜDKOREA</b>				
Medco Oak Tree Pte. Ltd. 7,375 % fällig am 14.05.2026	17.800	17.527	0,63	8,650 % fällig am 19.01.2028	30.302	30.567	1,09	<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				
Minejasa Capital BV 4,625 % fällig am 10.08.2030	4.700	4.231	0,15	Summe Mongolei		51.170	1,83	POSCO Holdings, Inc. 0,000 % fällig am 01.09.2026 (c)	€ 7.200	8.062	0,29	
Pakuwon Jati Tbk PT 4,875 % fällig am 29.04.2028	8.300	7.461	0,27	<b>NIEDERLANDE</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Saka Energi Indonesia PT 4,450 % fällig am 05.05.2024	7.900	7.711	0,28	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				SK Broadband Co. Ltd. 4,875 % fällig am 28.06.2028	\$ 12.950	12.770	0,46	
Summe Indonesien		103.409	3,70	Mong Duong Finance Holdings BV 5,125 % fällig am 07.05.2029	28.259	24.938	0,89	SK Hynix, Inc. 1,500 % fällig am 19.01.2026	4.850	4.299	0,15	
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Prosus NV 4,193 % fällig am 19.01.2032	15.600	13.145	0,47	2,375 % fällig am 19.01.2031	2.300	1.775	0,06	
Indonesia Government International Bond 4,650 % fällig am 20.09.2032	21.684	21.280	0,76	4,987 % fällig am 19.01.2052	11.700	8.448	0,30	6,375 % fällig am 17.01.2028	4.900	4.922	0,18	
Summe Indonesien		124.689	4,46	Summe Niederlande		46.531	1,66	Tongyang Life Insurance Co. Ltd. 5,250 % fällig am 22.09.2025 (e)	7.300	6.461	0,23	
<b>JAPAN</b>				<b>OMAN</b>				Summe Thailand		30.227	1,08	
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Export-Import Bank of Korea 4,625 % fällig am 07.06.2033	9.000	8.861	0,32	
ANA Holdings, Inc. 0,000 % fällig am 10.12.2031 (c)	¥ 860.000	7.343	0,26	Oman Government International Bond 7,000 % fällig am 25.01.2051	4.600	4.566	0,16	Summe Südkorea		47.150	1,69	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>PAKISTAN</b>				<b>SRI LANKA</b>				
Asahi Mutual Life Insurance Co. 6,900 % fällig am 26.01.2028 (e)	\$ 4.900	4.943	0,18	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Summe Japan		12.286	0,44	Pakistan Government International Bond 6,000 % fällig am 08.04.2026	55.571	27.230	0,98	Sri Lanka Government International Bond 5,750 % fällig am 18.04.2023 ^	19.512	8.901	0,32	
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				6,875 % fällig am 05.12.2027	54.357	26.091	0,93	6,200 % fällig am 11.05.2027 ^	23.800	10.958	0,39	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,375 % fällig am 08.04.2031	25.300	11.701	0,42	6,350 % fällig am 28.06.2024 ^	9.500	4.375	0,16	
West China Cement Ltd. 4,950 % fällig am 08.07.2026	30.075	23.081	0,82	8,250 % fällig am 15.04.2024	1.600	1.160	0,04	6,750 % fällig am 18.04.2028 ^	7.000	3.224	0,11	
<b>LUXEMBURG</b>				8,250 % fällig am 30.09.2025	6.635	3.616	0,13	6,825 % fällig am 18.07.2026 ^	4.500	2.132	0,08	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				8,875 % fällig am 08.04.2051	8.200	3.666	0,13	6,850 % fällig am 14.03.2024 ^	61.971	28.541	1,02	
Greensailf Pipelines Bidco SARL 6,129 % fällig am 23.02.2038	200	205	0,01	Summe Pakistan		73.464	2,63	6,850 % fällig am 03.11.2025 ^	39.900	19.013	0,68	
Guara Norte SARL 5,198 % fällig am 15.06.2034	4.421	3.876	0,14	<b>PHILIPPINEN</b>				7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	8.350	3.844	0,14	
Summe Luxemburg		4.081	0,15	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	3.600	1.657	0,06	
<b>MAURITIUS</b>				ACEN Finance Ltd. 4,000 % fällig am 08.03.2025 (e)	14.900	10.456	0,37	Summe Sri Lanka		82.645	2,96	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Globe Telecom, Inc. 3,000 % fällig am 23.07.2035	8.150	6.134	0,22	<b>THAILAND</b>				
CA Magnum Holdings 5,375 % fällig am 31.10.2026	34.160	30.671	1,10	4,200 % fällig am 02.08.2026 (e)	24.100	22.443	0,80	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Greenko Dutch BV 3,850 % fällig am 29.03.2026	9.265	8.340	0,30	ICTSI Treasury BV 3,500 % fällig am 16.11.2031	2.000	1.741	0,06	Bangkok Bank PCL 5,000 % fällig am 23.09.2025		21.400	20.300	0,73
Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025	9.339	9.024	0,32	Petron Corp. 4,600 % fällig am 19.07.2023 (e)	2.100	2.095	0,07	(e)(g)				
5,950 % fällig am 29.07.2026	3.900	3.666	0,13	5,950 % fällig am 19.04.2026 (e)	6.260	5.822	0,21	Kasikornbank PCL 3,343 % fällig am 11.05.2027 (g)	3.200	2.828	0,10	
				Royal Capital BV 4,875 % fällig am 05.05.2024 (e)	10.571	10.435	0,37	5,275 % fällig am 14.10.2025		28.657	27.089	0,97
				5,000 % fällig am 05.02.2026 (e)	900	875	0,03	(e)(g)				
				San Miguel Corp. 5,500 % fällig am 29.07.2025 (e)	10.150	9.161	0,33	Muang Thai Life Assurance PCL 3,552 % fällig am 27.01.2037 (g)	23.300	20.201	0,72	
				SMC Global Power Holdings Corp. 5,450 % fällig am 09.12.2026 (e)	9.875	7.193	0,26	Summe Thailand		70.418	2,52	
				5,700 % fällig am 21.01.2026 (e)	3.754	2.834	0,10	<b>GROSSBRITANNIEN</b>				
				5,950 % fällig am 05.05.2025 (e)	9.000	7.134	0,26	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
								Diamond Ltd. 7,950 % fällig am 28.07.2026	3.700	3.643	0,13	
								Jaguar Land Rover Automotive PLC 4,500 % fällig am 15.07.2028	€ 6.100	5.833	0,21	

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>Standard Chartered PLC</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
6,000 % fällig am 26.07.2025 (e)(g)	\$ 21.300	\$ 20.284	0,73	<b>Celestial Miles Ltd.</b>				<b>KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>			
6,187 % fällig am 06.07.2027 (a)	4.600	4.604	0,16	5,750 % fällig am 31.01.2024 (e)	\$ 26.054	\$ 25.730	0,92	Yango Justice International Ltd.	\$ 4.500	\$ 90	0,00
7,750 % fällig am 15.08.2027 (e)(g)	57.300	56.885	2,03	4,500 % fällig am 27.01.2026	17.700	15.648	0,56	Summe kurzfristige Instrumente		90	0,00
<b>Vedanta Resources Finance PLC</b>				<b>Easy Tactic Ltd. (6,500 % bar oder 7,500 % PIK)</b>				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.458.996	87,94	
8,950 % fällig am 11.03.2025	54.692	41.349	1,48	7,500 % fällig am 11.07.2025 (b)	1.600	144	0,01				
Summe Großbritannien		132.598	4,74	7,500 % fällig am 11.07.2027 (b)	51.991	4.476	0,16	<b>AKTIEN</b>			
<b>USA</b>				7,500 % fällig am 11.07.2028 (b)	42.544	3.195	0,11	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>NWD Finance BVI Ltd.</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
<b>Stillwater Mining Co.</b>				4,125 % fällig am 10.03.2028 (e)	24.450	16.611	0,59	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO</b>			
4,000 % fällig am 16.11.2026	2.500	2.233	0,08	4,800 % fällig am 09.09.2023 (e)	6.100	3.603	0,13	US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	25.845.662	257.370	9,20
<b>US-SCHATZOBBLIGATIONEN</b>				5,250 % fällig am 22.03.2026 (e)	25.500	22.478	0,80	<b>PIMCO Specialty Funds Ireland</b>			
<b>U.S. Treasury Bonds</b>				6,150 % fällig am 16.03.2025 (e)	45.900	42.802	1,53	p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)	744.048	9.697	0,35
1,875 % fällig am 15.11.2051	2.700	1.783	0,06	<b>Peak RE BVI Holding Ltd.</b>					267.067	9,55	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				5,350 % fällig am 28.10.2025 (e)	8.670	7.196	0,26	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
0,125 % fällig am 15.01.2032	49.895	43.949	1,57	<b>RKPF Overseas Ltd.</b>				<b>PIMCO ETFs plc -</b>			
		45.732	1,63	5,125 % fällig am 26.07.2026	16.550	7.587	0,27	PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	48.700	4.837	0,17
Summe USA		47.965	1,71	5,200 % fällig am 12.01.2026	26.100	14.003	0,50	Summe Investmentfonds	\$ 271.904	9,72	
<b>VIETNAM</b>				6,000 % fällig am 04.09.2025	5.606	3.214	0,12				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Studio City Co. Ltd.</b>							
<b>Vietnam Debt &amp; Asset Trading Corp.</b>				7,000 % fällig am 15.02.2027	7.000	6.565	0,23				
1,000 % fällig am 10.10.2025	1.300	1.101	0,04	<b>Studio City Finance Ltd.</b>							
Vietnam Government International Bond				5,000 % fällig am 15.01.2029	11.600	8.607	0,31				
5,500 % fällig am 12.03.2028	936	903	0,03	6,000 % fällig am 15.07.2025	29.132	27.078	0,97				
Summe Vietnam		2.004	0,07	6,500 % fällig am 15.01.2028	2.267	1.896	0,07				
<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>				<b>Wanda Properties Global Co. Ltd.</b>							
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				11,000 % fällig am 20.01.2025	7.900	3.514	0,13				
<b>ADM AG Holding Ltd.</b>				11,000 % fällig am 13.02.2026	4.800	2.038	0,07				
0,000 % fällig am 26.08.2023 (c)	9.000	8.908	0,32	<b>Wanda Properties International Co. Ltd.</b>							
				7,250 % fällig am 29.01.2024	2.000	1.248	0,04				
				<b>Wanda Properties Overseas Ltd.</b>							
				6,875 % fällig am 23.07.2023	1.000	926	0,03				
				Summe Jungferninseln (Britisch)		218.559	7,81				
						227.467	8,13				

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 7.016	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	\$ (7.156)	\$ 7.016	\$ 7.016	0,25
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (7.156)	\$ 7.016	\$ 7.016	0,25

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	105	\$ 173	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.990	(4.156)	(0,15)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	7	(13)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	18	21	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	638	(78)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	23	44	0,00
				\$ (4.009)	(0,14)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (4.009)	(0,14)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.12.2024	€ 5.000	\$ 654	0,03
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	2.800	(153)	(0,01)
				\$ 501	0,02

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850 %	20.09.2033	¥ 3.800.000	\$ (215)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	\$ 19.400	2.422	0,09
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	37.550	3.594	0,13
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	13.500	1.967	0,07
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2031	28.100	2.197	0,08
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	114.000	(1.703)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.12.2051	39.300	4.546	0,16
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033	KRW 41.093.606	(312)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,500	15.03.2028	42.889.600	246	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.09.2023	\$ 19.400	242	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.09.2023	37.550	415	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	€ 4.000	(14)	0,00
					\$ 13.385	0,48
					\$ 13.886	0,50

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Saudi Arabia Government International Bond	(1,000) %	20.06.2028	\$ 44.900	\$ (648)	\$ (230)	\$ (878)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000 %	20.06.2026	\$ 9.500	\$ (155)	\$ (968)	\$ (1.123)	(0,04)
BRC	BOC Aviation Ltd.	1,000	20.06.2026	24.300	(70)	118	48	0,00
	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.	1,000	20.06.2026	7.400	9	(512)	(503)	(0,02)
CBK	Vietnam Government International Bond	1,000	20.12.2027	9.100	(263)	242	(21)	0,00
					\$ (479)	\$ (1.120)	\$ (1.599)	(0,06)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545 %	05.05.2028	MYR 127.400	\$ 0	\$ 150	\$ 150	0,01
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	167.250	49	200	249	0,01
						\$ 49	\$ 350	\$ 399	0,02

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettoerhöhung/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	08.2023	AUD	10.762	\$ 7.275	\$ 103	\$ 0	0,00	
	08.2023	CNY	12.479	1.818	92	0	0,00	
	08.2023	€	5.866	6.440	27	0	0,00	
	08.2023	¥	4.117.200	28.826	158	0	158	0,01
	08.2023	NZD	237	150	5	0	5	0,00
	09.2023	TWD	125.459	4.133	96	0	96	0,00
	09.2023	\$	1.808	HKD 14.125	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	\$	20.504	IDR 306.940.703	0	(117)	(117)	0,00
	09.2023	\$	14.664	INR 1.212.899	79	0	79	0,00
	07.2023	\$	13.749	MYR 63.110	0	(202)	(202)	(0,01)
BPS	08.2023	CNY	14.674	\$ 2.146	116	0	116	0,00
	08.2023	€	1.483	1.590	0	(31)	(31)	0,00
	08.2023	TWD	62.796	2.057	40	0	40	0,00
	08.2023	\$	5.239	CNH 36.203	0	(246)	(246)	(0,01)
	08.2023	\$	6.684	€ 6.106	0	(9)	(9)	0,00
	09.2023	IDR	1.079.052	\$ 72	0	0	0	0,00
	09.2023	\$	0	THB 1	0	0	0	0,00
	08.2023	€	442	\$ 476	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	\$	2.392	CNH 16.575	0	(106)	(106)	0,00
	08.2023	\$	6.903	¥ 913.551	0	(542)	(542)	(0,02)
CBK	09.2023	PHP	462.920	\$ 8.260	0	(94)	(94)	0,00
	07.2023	\$	1.594.596	29.231	404	0	404	0,02
	08.2023	€	5.301	5.802	7	0	7	0,00
	08.2023	¥	43.700	321	17	0	17	0,00
	08.2023	TWD	65.378	2.142	42	0	42	0,00
	08.2023	\$	14	CNH 100	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	PHP	294.148	\$ 5.253	0	(55)	(55)	0,00
	09.2023	\$	13.783	INR 1.133.307	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	CNH	105.760	\$ 15.033	448	0	448	0,02
	09.2023	TWD	7.303	\$ 240	5	0	5	0,00
JPM	09.2023	\$	28.324	THB 977.177	0	(555)	(555)	(0,02)
	07.2023	PHP	104.353	\$ 1.910	23	0	23	0,00
	08.2023	CNH	73.409	10.469	345	0	345	0,01
	08.2023	CNY	15.480	2.264	122	0	122	0,01
	08.2023	\$	4.205	CNH 29.061	0	(198)	(198)	(0,01)
	08.2023	¥	1.130	¥ 150.136	0	(85)	(85)	0,00
	09.2023	IDR	300.865	\$ 20	0	0	0	0,00
	09.2023	THB	7.662	223	6	0	6	0,00
	09.2023	\$	8.534	IDR 128.395.884	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023	\$	54	INR 4.431	0	0	0	0,00
MBC	08.2023	CNH	139.191	\$ 20.213	1.018	0	1.018	0,04
	08.2023	€	25.777	CNH 28.444	263	0	263	0,01
	08.2023	\$	314	CNH 2.160	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	£	13	\$ 16	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	80.913.271	€ 5.410	14	0	14	0,00
	07.2023	\$	35	€ 32	0	0	0	0,00
	07.2023	£	186	£ 147	1	0	1	0,00
	07.2023	£	5.385	IDR 80.913.271	12	0	12	0,00
	08.2023	TWD	67.573	\$ 2.228	58	0	58	0,00
	08.2023	\$	14.772	¥ 1.963.090	0	(1.103)	(1.103)	(0,04)
SCX	09.2023	IDR	593.736	\$ 40	0	0	0	0,00
	09.2023	THB	3.492	102	3	0	3	0,00
	09.2023	\$	5.410	IDR 80.983.607	0	(32)	(32)	0,00
	09.2023	\$	12	INR 957	0	0	0	0,00
	07.2023	13.783	MYR 63.348	0	(186)	(186)	(0,01)	
	08.2023	CNY	41.104	\$ 6.021	334	0	334	0,01
	08.2023	NZD	84	52	1	0	1	0,00
	08.2023	\$	6.229	CNH 43.774	0	(192)	(192)	(0,01)
	08.2023	\$	14.352	TWD 436.304	0	(340)	(340)	(0,01)
	09.2023	IDR	299.775.204	\$ 20.160	247	0	247	0,01
UAG	09.2023	THB	7.929	230	4	0	4	0,00
	09.2023	TWD	104.832	3.438	66	0	66	0,00
	09.2023	\$	34	INR 2.771	0	0	0	0,00
	09.2023	SGD	37.928	\$ 28.379	273	0	273	0,01
	09.2023	\$	13.880	INR 1.147.440	68	0	68	0,00
					\$ 4.497	\$ (4.131)	\$ 366	0,01

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Investor AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
AZD	07.2023	AUD	\$	355	236	0	(1)	0,00	
	07.2023	\$	AUD	437	668	8	0	0,00	
	08.2023			236	355	1	0	0,00	
BOA	07.2023			1.370	2.106	33	(1)	0,01	
	07.2023	AUD	\$	2.029	1.342	0	(9)	0,00	
BPS	07.2023	\$	AUD	1.240	1.910	32	0	0,00	
	08.2023			1.206	1.820	6	0	0,00	
	07.2023			277	425	6	0	0,00	
SCX	07.2023	AUD	\$	626	416	0	(1)	0,00	
	07.2023	\$	AUD	337	516	6	0	0,00	
UAG	08.2023			416	626	1	0	0,00	
	07.2023	AUD	\$	2.111	1.402	2	(6)	0,00	
	07.2023	\$	AUD	520	795	9	0	0,00	
	08.2023			1.403	2.111	7	(3)	0,00	
						\$ 111	\$ (21)	\$ 90	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BPS	07.2023	CHF	\$	2.058	2.301	1	0	0,00
	07.2023	\$	CHF	3.157	2.857	36	0	0,00
	08.2023			2.301	2.052	0	(1)	0,00
MBC	07.2023			36	32	0	0	0,00
	07.2023	CHF	\$	220	243	0	(3)	0,00
MYI	07.2023	\$	CHF	53	48	1	0	0,00
	07.2023	CHF	\$	32	35	0	(1)	0,00
SCX	07.2023	\$	CHF	2.156	1.938	9	0	0,00
	07.2023	CHF	\$	2.126	2.372	0	(5)	0,00
UAG	07.2023	\$	CHF	1.954	1.756	9	0	0,00
	08.2023			2.372	2.120	5	0	0,00
						\$ 61	\$ (10)	\$ 51

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2023	€	\$	2.159	2.359	4	0	0,00	
	07.2023	\$	€	165.988	154.450	2.517	0	0,09	
BPS	07.2023	€	\$	171.369	187.722	759	(1)	0,03	
	07.2023	\$	€	166.467	154.852	2.477	0	0,09	
	08.2023			174.611	159.137	0	(755)	(0,03)	
CBK	07.2023	€	\$	175.663	190.718	2	(933)	(0,03)	
	07.2023	\$	€	55	51	0	0	0,00	
	08.2023			169.171	155.383	584	0	0,02	
MBC	07.2023	€	\$	1.186	1.274	0	(20)	0,00	
	07.2023	\$	€	36.635	34.083	550	0	0,02	
SCX	07.2023	€	\$	6.144	6.709	6	0	0,00	
	07.2023	\$	€	167.108	156.151	3.253	0	0,11	
						\$ 10.152	\$ (1.709)	\$ 8.443	0,30

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2023	£	\$	19	24	0	0	0,00	
	07.2023			0	0	0	0	0,00	
BRC	07.2023	\$	£	470	374	5	0	0,00	
	07.2023	£	\$	534	679	0	0	0,00	
CBK	07.2023	\$	£	45	36	0	0	0,00	
	07.2023			12.941	10.454	350	0	0,01	
MBC	07.2023			13.008	10.466	298	0	0,01	
	07.2023								
UAG	07.2023	£	\$	3	4	0	0	0,00	
	07.2023	\$	£	13.374	10.733	271	0	0,01	
						\$ 924	\$ 0	\$ 924	0,03

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die ausschüttende Investor RMB (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$	466	CNH	3.309	\$	0
BPS	07.2023		465		3.292	\$	(11)
GLM	07.2023	CNH	3.462	\$	477		(12)
	07.2023	\$	468	CNH	3.302		1
	08.2023		477		3.454		(14)
MBC	07.2023		29		204		(2)
UAG	07.2023		10		71		(1)
							0
						\$	(39)
							0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) Income, Investor SGD (Hedged) Income, E Class SGD (Hedged) Income und M Retail SGD (Hedged) Income II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$	6.713	SGD	9.084	\$	(1)
GLM	07.2023	SGD	866	\$	645		5
	07.2023	\$	448	SGD	603		(3)
MBC	07.2023		6.157		8.318		(10)
	08.2023		20		27		0
MYI	07.2023	SGD	9.341	\$	6.913		10
	08.2023	\$	6.764	SGD	9.131		(10)
SCX	07.2023		1.384		1.874		0
UAG	07.2023		6.801		9.198		(4)
						\$	(13)
							0,00

Summe Freiverkehrsfinauzderivate

\$ 7.744 0,28

Summe Anlagen

\$ 2.755.537 98,55

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 40.634 1,45

Nettovermögen

\$ 2.796.171 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertauschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,04 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Flourish Century	6,600 %	04.02.2022	25.08.2021 - 27.08.2021	\$ 10.747	\$ 1.209	0,04

Barmittel in Höhe von 21.139 USD (31. Dezember 2022: 21.668 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.460 USD (31. Dezember 2022: 12.646 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.445.564	\$ 13.432	\$ 2.458.996
Investmentfonds	271.904	0	0	271.904
Pensionsgeschäfte	0	7.016	0	7.016
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	173	17.448	0	17.621
Summen	\$ 272.077	\$ 2.470.028	\$ 13.432	\$ 2.755.537

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.650.199	\$ 1.972	\$ 2.652.171
Investmentfonds	235.155	4.824	0	239.979
Pensionsgeschäfte	0	20.572	0	20.572
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	413	27.752	(1.299)	26.866
<b>Summen</b>	<b>\$ 235.568</b>	<b>\$ 2.703.347</b>	<b>\$ 673</b>	<b>\$ 2.939.588</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 8	\$ (20)	\$ (12)	\$ 1.734	\$ (1.360)	\$ 374
BOA	2.105	(1.670)	435	(199)	350	151
BPS	1.078	(730)	348	(8.680)	9.734	1.054
BRC	(1.200)	1.210	10	(872)	1.172	300
CBK	45	0	45	4.080	(4.046)	34
DUB	448	(320)	128	1.048	(1.010)	38
GLM	(413)	590	177	96	0	96
GST	249	0	249	(732)	660	(72)
JPM	208	(290)	(82)	(538)	730	192
MBC	2.134	(2.060)	74	4.627	(4.030)	597
MYI	(751)	660	(91)	479	(240)	239
SCX	3.207	(2.920)	287	4.720	(4.520)	200
UAG	626	(610)	16	7.636	(8.540)	(904)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	72,48	70,85
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	15,46	18,07
Investmentfonds	9,72	8,05
Pensionsgeschäfte	0,25	0,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,14)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,50	0,47
Freiverkehrsfinanzderivate	0,28	0,45

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,01	1,12
Brasilien	0,14	0,13
Cayman-Inseln	23,05	26,52
China	1,83	1,91
Frankreich	0,61	0,59
Deutschland	0,24	0,38
Hongkong	7,50	6,10
Indien	6,95	6,45
Indonesien	4,46	3,84
Israel	k. A.	0,09
Japan	0,44	0,24
Jersey, Kanalinseln	0,82	0,84
Luxemburg	0,15	0,13
Mauritius	5,91	7,22
Mexiko	0,32	0,37
Mongolei	1,83	1,30
Niederlande	1,66	1,80
Oman	0,16	0,16
Pakistan	2,63	2,18
Philippinen	3,65	3,53
Singapur	2,76	3,90
Südkorea	1,69	0,20
Sri Lanka	2,96	1,91
Thailand	2,52	2,75
Großbritannien	4,74	3,67
USA	1,71	1,57

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Vietnam	0,07	0,21
Jungferninseln (Britisch)	8,13	9,83
Kurzfristige Instrumente	0,00	0,01
Investmentfonds	9,72	8,05
Pensionsgeschäfte	0,25	0,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,14)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,03
Zinsswaps	0,48	0,45
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,03)	(0,09)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,06)	(0,07)
Zinsswaps	0,02	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,01	0,06
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,34	0,55
Sonstige Aktiva und Passiva	1,45	1,40
Nettovermögen	100,00	100,00



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>AUSTRALIEN</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
Emeco Pty. Ltd. 6,250 % fällig am 10.07.2026	AUD 1.300	\$ 805	0,25	FWD Group Ltd. 6,375 % fällig am 13.09.2024 (e) 8,045 % fällig am 15.12.2023 (e)	\$ 200 200	\$ 179 182	0,06 0,06	Huaxin Cement International Finance Co. Ltd. 2,250 % fällig am 19.11.2025	\$ 900	\$ 806	0,25
Mineral Resources Ltd. 8,000 % fällig am 01.11.2027 8,125 % fällig am 01.05.2027	\$ 1.000 605	1.000 606	0,31 0,19	Geely Automobile Holdings Ltd. 4,000 % fällig am 09.12.2024 (e)	2.000	1.915	0,60	Midea Investment Development Co. Ltd. 2,880 % fällig am 24.02.2027	1.500	1.358	0,42
Pacific National Finance Pty. Ltd. 4,750 % fällig am 22.03.2028	900	818	0,25	Goodman HK Finance 3,000 % fällig am 22.07.2030	700	594	0,19	New Metro Global Ltd. 4,625 % fällig am 15.10.2025 4,800 % fällig am 15.12.2024	1.140 700	576 479	0,18 0,15
Santos Finance Ltd. 3,649 % fällig am 29.04.2031 5,250 % fällig am 13.03.2029	600 400	499 376	0,16 0,12	Health & Happiness International Holdings Ltd. 13,500 % fällig am 26.06.2026	2.800	2.651	0,83	SF Holding Investment Ltd. 2,375 % fällig am 17.11.2026	600	540	0,17
Woodside Finance Ltd. 3,700 % fällig am 15.09.2026	1.600	1.506	0,47	Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^ 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ 10,500 % fällig am 15.01.2025 ^ 11,250 % fällig am 09.04.2022 ^ 11,950 % fällig am 12.11.2023 ^ 11,950 % fällig am 22.10.2049 ^	800 200 2.100 500 1.200 300	53 13 140 33 98 20	0,02 0,00 0,04 0,01 0,03 0,01	Yango Group Co. Ltd. 6,900 % fällig am 31.10.2022 ^ CNY Yango Justice International Ltd. 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^ \$ Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	20.000 700 2.300	146 11	0,05 0,00 0,65
Summe Australien		5.610	1,75	Longfor Group Holdings Ltd. 3,950 % fällig am 16.09.2029 4,500 % fällig am 16.01.2028	400 400	300 326	0,09 0,10	ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd. 3,125 % fällig am 16.07.2025	2.500	2.212	0,69
<b>BRASILIEN</b>								<b>Summe China</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>12.638 3,95</b>			
CSN Resources S.A. 4,625 % fällig am 10.06.2031	400	306	0,10	Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025 5,250 % fällig am 26.04.2026 5,750 % fällig am 21.07.2028	900 1.700 2.900	858 1.575 2.567	0,27 0,49 0,80	<b>FRANKREICH</b>			
<b>CAYMAN INSELN</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>											
Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd. 0,000 % fällig am 22.01.2026 (c)	900	866	0,27	MGM China Holdings Ltd. 4,750 % fällig am 01.02.2027 5,250 % fällig am 18.06.2025	1.600 200	1.458 192	0,46 0,06	BNP Paribas S.A. 9,250 % fällig am 17.11.2027 (e)(g)	700	723	0,22
Meituan 0,000 % fällig am 27.04.2027 (c) 0,000 % fällig am 27.04.2028 (c)	1.400 500	1.228 411	0,38 0,13	Powerlong Real Estate Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 30.04.2025 6,250 % fällig am 10.08.2024	400 400	41 40	0,01 0,01	Societe Generale S.A. 9,375 % fällig am 22.11.2027 (e)(g)	1.000	980	0,31
Wynn Macau Ltd. 4,500 % fällig am 07.03.2029	1.300	1.423	0,45	Sands China Ltd. 2,800 % fällig am 08.03.2027 4,875 % fällig am 18.06.2030 5,625 % fällig am 08.08.2025 5,900 % fällig am 08.08.2028	1.500 400 2.100 1.900	1.303 356 2.050 1.813	0,41 0,11 0,64 0,57	Summe Frankreich		1.703	0,53
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>1.703 0,53</b>			
AAC Technologies Holdings, Inc. 3,000 % fällig am 27.11.2024 3,750 % fällig am 02.06.2031	1.700 400	1.611 294	0,50 0,09	Seazen Group Ltd. 4,450 % fällig am 13.07.2025 6,000 % fällig am 12.08.2024	600 500	312 357	0,10 0,11	<b>DEUTSCHLAND</b>			
Agile Group Holdings Ltd. 5,500 % fällig am 17.05.2026 6,050 % fällig am 13.10.2025 7,875 % fällig am 31.07.2024 (e)	2.500 1.500 523	532 360 69	0,17 0,11 0,02	Shui On Development Holding Ltd. 5,000 % fällig am 29.06.2026	700	520	0,16	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Alibaba Group Holding Ltd. 2,125 % fällig am 09.02.2031 2,700 % fällig am 09.02.2041 4,500 % fällig am 28.11.2034	800 1.100 900	652 736 832	0,20 0,23 0,26	Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 26.04.2024 ^ 6,500 % fällig am 10.01.2025 ^ 6,650 % fällig am 03.08.2024 ^ 6,800 % fällig am 20.10.2024 ^ 7,950 % fällig am 11.10.2023 ^ 8,350 % fällig am 19.04.2023 ^	300 200 3.000 800 500 800	45 30 443 123 75 118	0,01 0,01 0,14 0,04 0,02 0,04	<b>BMW Finance NV</b> 3,440 % fällig am 15.06.2024 CNY			
Baidu, Inc. 4,375 % fällig am 29.03.2028	1.000	954	0,30	Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 5,950 % fällig am 17.07.2026	1.600	1.598	0,50	7.000	971	0,30	
China Hongqiao Group Ltd. 6,250 % fällig am 08.06.2024	1.400	1.377	0,43	Tencent Holdings Ltd. 3,240 % fällig am 03.06.2050	1.100	723	0,23	Deutsche Bank AG 4,500 % fällig am 30.11.2026 (e)(g) € 10,000 % fällig am 01.12.2027 (e)(g)	200 400	155 434	0,05 0,14
China Modern Dairy Holdings Ltd. 2,125 % fällig am 14.07.2026	2.200	1.885	0,59	Times China Holdings Ltd. 5,550 % fällig am 04.06.2024 ^	1.900	135	0,04	Summe Deutschland		1.560	0,49
China SCE Group Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 29.09.2024 6,000 % fällig am 04.02.2026	200 200	35 24	0,01 0,01	VLL International, Inc. 5,750 % fällig am 28.11.2024	200	194	0,06	<b>HONGKONG</b>			
CIFI Holdings Group Co. Ltd. 4,450 % fällig am 17.08.2026 ^ 4,800 % fällig am 17.05.2028 ^ 5,950 % fällig am 20.10.2025 ^ 6,000 % fällig am 16.07.2025 ^	100 700 900 200	11 81 104 23	0,00 0,03 0,03 0,01	Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024 5,500 % fällig am 15.01.2026 5,500 % fällig am 01.10.2027 5,625 % fällig am 26.08.2028	2.250 1.500 400 300	2.196 1.395 357 262	0,69 0,44 0,11 0,08	<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>			
CK Hutchison International Ltd. 4,750 % fällig am 21.04.2028 4,875 % fällig am 21.04.2033	1.500 1.700	1.484 1.684	0,46 0,53	Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % fällig am 13.01.2026	1.650	1.505	0,47	Universe Trek Ltd. 0,000 % fällig am 15.06.2026 (c) \$	200	194	0,06
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,700 % fällig am 12.07.2026 3,125 % fällig am 22.10.2025 3,875 % fällig am 22.10.2030 4,200 % fällig am 06.02.2026 4,800 % fällig am 06.08.2030 5,125 % fällig am 14.01.2027 5,625 % fällig am 14.01.2030 6,150 % fällig am 17.09.2025 7,250 % fällig am 08.04.2026	200 400 1.500 800 1.500 700 500 300 3.200	61 126 429 255 434 222 157 99 1.126	0,02 0,04 0,13 0,08 0,14 0,07 0,05 0,03 0,35			46.039	14,39	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
eHi Car Services Ltd. 7,000 % fällig am 21.09.2026 7,750 % fällig am 14.11.2024	1.400 500	843 394	0,26 0,12	Summe Cayman Inseln		49.967	15,62	<b>Bank of East Asia Ltd.</b> 6,750 % fällig am 15.03.2027			
								<b>1.681 0,53</b>			
								<b>China Cinda Finance Ltd.</b> 4,750 % fällig am 08.02.2028			
								<b>1.000 960 0,30</b>			
								<b>Fortune Star BVI Ltd.</b> 3,950 % fällig am 02.10.2026 5,000 % fällig am 18.05.2026 5,050 % fällig am 27.01.2027 5,950 % fällig am 19.10.2025 6,850 % fällig am 02.07.2024			
								<b>900 561 0,18</b>			
								<b>GLP China Holdings Ltd.</b> 2,950 % fällig am 29.03.2026 4,974 % fällig am 26.02.2024			
								<b>400 356 0,11</b>			
								<b>Huarong Finance Co. Ltd.</b> 4,250 % fällig am 07.11.2027 4,500 % fällig am 29.05.2029 4,625 % fällig am 03.06.2026 4,875 % fällig am 22.11.2026 5,000 % fällig am 19.11.2025 6,625 % fällig am 24.02.2025			
								<b>500 417 0,13</b>			
								<b>4.800 3.852 1,20</b>			
								<b>300 267 0,08</b>			
								<b>400 354 0,11</b>			
								<b>500 462 0,14</b>			
								<b>400 376 0,12</b>			
								<b>Lenovo Group Ltd.</b> 6,536 % fällig am 27.07.2032			
								<b>700 707 0,22</b>			
								<b>Sino-Ocean Land Treasure Ltd.</b> 2,700 % fällig am 13.01.2025 3,250 % fällig am 05.05.2026 4,750 % fällig am 05.08.2029 4,750 % fällig am 14.01.2030			
								<b>1.400 444 0,14</b>			
								<b>1.000 309 0,10</b>			
								<b>400 82 0,03</b>			
								<b>1.000 207 0,07</b>			
								<b>Yanlord Land HK Co. Ltd.</b> 5,125 % fällig am 20.05.2026			
								<b>600 494 0,15</b>			
								<b>13.803 4,32</b>			

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>MEXIKO</b>			
Airport Authority Hong Kong				Saka Energi Indonesia PT	\$ 700	\$ 683	0,21	India Toll Roads	\$ 2.000	\$ 1.932	0,60
2,500 % fällig am 12.01.2032	\$ 3.600	\$ 3.065	0,96	4,450 % fällig am 05.05.2024		20.570	6,43	5,500 % fällig am 19.08.2024			
4,750 % fällig am 12.01.2028	1.250	1.247	0,39					Summe Mauritius		10.112	3,16
4,875 % fällig am 12.01.2030	1.300	1.322	0,41					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
		5.634	1,76	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>MEXIKO</b>			
Summe Hongkong		19.631	6,14	Indonesia Government International Bond	2.900	2.846	0,89	Banco Mercantil del Norte S.A.			
				4,650 % fällig am 20.09.2032	900	900	0,28	5,875 % fällig am 24.01.2027 (e)(g)	850	726	0,23
				5,250 % fällig am 17.01.2042		3.746	1,17	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				Summe Indonesien		24.316	7,60	<b>MONGOLEI</b>			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>INDIEN</b>				<b>IRLAND</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Adani Electricity Mumbai Ltd.	1.200	893	0,28	SMBC Aviation Capital Finance DAC	3.200	3.159	0,99	Mongolia Government International Bond	1.600	1.244	0,39
3,949 % fällig am 12.02.2030				5,450 % fällig am 03.05.2028				4,450 % fällig am 07.07.2031	1.530	1.543	0,48
Adani Green Energy UP Ltd.	1.000	960	0,30					8,650 % fällig am 19.01.2028			
6,250 % fällig am 10.12.2024								Summe Mongolei		2.787	0,87
Adani Transmission Step-One Ltd.	800	700	0,22	<b>JAPAN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,000 % fällig am 03.08.2026				<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
GMR Hyderabad International Airport Ltd.	2.000	1.773	0,56	ANA Holdings, Inc.	¥ 90.000	768	0,24	Mong Duong Finance Holdings BV	2.000	1.765	0,55
4,250 % fällig am 27.10.2027				0,000 % fällig am 10.12.2031 (c)				5,125 % fällig am 07.05.2029			
Indian Railway Finance Corp. Ltd.	2.100	1.833	0,57					Prosus NV	1.200	1.011	0,32
3,570 % fällig am 21.01.2032								4,193 % fällig am 19.01.2032	900	650	0,20
JSW Hydro Energy Ltd.	924	780	0,24					4,987 % fällig am 19.01.2052			
4,125 % fällig am 18.05.2031								Summe Niederlande		3.426	1,07
Muthoot Finance Ltd.	791	786	0,25	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>PAKISTAN</b>			
4,400 % fällig am 02.09.2023				<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Network I2i Ltd.	200	195	0,06	Asahi Mutual Life Insurance Co.	\$ 600	606	0,19	Pakistan Government International Bond	2.950	1.445	0,45
5,650 % fällig am 15.01.2025 (e)				6,900 % fällig am 26.01.2028 (e)	2.900	2.866	0,90	6,000 % fällig am 08.04.2026	4.200	2.016	0,63
NTPC Ltd.	600	578	0,18	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	2.900	2.866	0,90	6,875 % fällig am 05.12.2027			
4,250 % fällig am 26.02.2026				5,063 % fällig am 12.09.2025				Summe Pakistan		3.461	1,08
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd.	1.000	946	0,30	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.	2.900	2.845	0,89				
3,750 % fällig am 27.07.2026				4,800 % fällig am 15.09.2025		6.317	1,98				
Reliance Industries Ltd.	700	584	0,18	Summe Japan		7.085	2,22				
2,875 % fällig am 12.01.2032								<b>PHILIPPINEN</b>			
Shriram Finance Ltd.	958	907	0,28	<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,150 % fällig am 18.07.2025	2.480	2.427	0,76	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,400 % fällig am 13.03.2024				West China Cement Ltd.	1.700	1.305	0,41	Globe Telecom, Inc.	200	151	0,05
UltraTech Cement Ltd.	2.100	1.727	0,54	4,950 % fällig am 08.07.2026				3,000 % fällig am 23.07.2035	900	838	0,26
2,800 % fällig am 16.02.2031								4,200 % fällig am 02.08.2026 (e)			
Summe Indien		15.089	4,72	<b>LUXEMBURG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				Guara Norte SARL	796	698	0,22	SMC Global Power Holdings Corp.	300	218	0,07
				5,198 % fällig am 15.06.2034				5,450 % fällig am 09.12.2026 (e)	800	716	0,22
								6,500 % fällig am 25.04.2024 (e)	200	168	0,05
								7,000 % fällig am 21.10.2025 (e)			
								Summe Philippinen		2.091	0,65
<b>INDONESIEN</b>				<b>MALAYSIA</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Bank Mandiri Persero Tbk PT	1.800	1.800	0,56	Genn Capital Labuan Ltd.	500	405	0,13	Philippines Government International Bond	1.400	996	0,31
5,500 % fällig am 04.04.2026				3,882 % fällig am 19.04.2031	300	297	0,09	1,750 % fällig am 28.04.2041	\$ 900	666	0,21
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	2.220	2.056	0,64	Khazanah Capital Ltd.	1.200	1.185	0,37	3,200 % fällig am 06.07.2046	600	608	0,19
3,750 % fällig am 30.03.2026 (g)	450	373	0,12	4,876 % fällig am 01.06.2033				5,000 % fällig am 17.07.2033	200	200	0,06
4,300 % fällig am 24.03.2027 (e)(g)				Khazanah Global Sukuk Bhd.	3.900	3.751	1,17	5,000 % fällig am 13.01.2037	800	847	0,27
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	3.000	2.998	0,94	4,687 % fällig am 01.06.2028				5,609 % fällig am 13.04.2033			
4,625 % fällig am 20.07.2023				Misc Capital Two Labuan Ltd.							
Bukit Makmur Mandiri Utama PT	2.200	1.881	0,59	3,625 % fällig am 06.04.2025							
7,750 % fällig am 10.02.2026				Petronas Capital Ltd.	600	502	0,16				
Cikarang Listrindo Tbk PT	400	382	0,12	2,480 % fällig am 28.01.2032	550	393	0,12				
4,950 % fällig am 14.09.2026				3,404 % fällig am 28.04.2061							
Freeport Indonesia PT	700	679	0,21	Petronas Energy Canada Ltd.	700	622	0,19				
4,763 % fällig am 14.04.2027	1.600	1.517	0,47	2,112 % fällig am 23.03.2028							
5,315 % fällig am 14.04.2032											
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	700	590	0,19								
3,541 % fällig am 27.04.2032											
Indonesia Asahan Aluminium PT	1.200	1.060	0,33	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
5,800 % fällig am 15.05.2050				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
LLPL Capital Pte. Ltd.	993	892	0,28	Export-Import Bank of Malaysia Bhd.	1.000	888	0,28	BOC Aviation Ltd.	1.500	1.451	0,45
6,875 % fällig am 04.02.2039				1,831 % fällig am 26.11.2026				3,500 % fällig am 10.10.2024	744	654	0,21
Medco Oak Tree Pte. Ltd.	1.800	1.772	0,55	Summe Malaysia		8.043	2,51	Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.			
7,375 % fällig am 14.05.2026								4,250 % fällig am 25.03.2027			
Minejesa Capital BV	400	360	0,11	<b>MAURITIUS</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,625 % fällig am 10.08.2030				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Pakuwon Jati Tbk PT	200	180	0,06	CA Magnum Holdings	2.500	2.245	0,70	Indika Energy Capital Pte. Ltd.	1.150	1.145	0,36
4,875 % fällig am 29.04.2028				5,375 % fällig am 31.10.2026				8,250 % fällig am 22.10.2025			
Pelabuhan Indonesia Persero PT	700	694	0,22	Greenko Dutch BV	2.632	2.369	0,74	Medco Bell Pte. Ltd.	778	729	0,23
4,875 % fällig am 01.10.2024				3,850 % fällig am 29.03.2026				6,375 % fällig am 30.01.2027			
Pertamina Persero PT	700	633	0,20	India Cleantech Energy	275	241	0,08	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.	2.700	2.618	0,82
1,400 % fällig am 09.02.2026				4,700 % fällig am 10.08.2026				4,602 % fällig am 15.06.2032 (g)			
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara	2.300	2.020	0,63	India Green Energy Holdings	3.400	3.325	1,04	TML Holdings Pte. Ltd.	2.100	2.077	0,65
3,375 % fällig am 05.02.2030				5,375 % fällig am 29.04.2024				5,500 % fällig am 03.06.2024			
								United Overseas Bank Ltd.	800	712	0,22
								1,750 % fällig am 16.03.2031 (g)			
								Summe Singapur		9.386	2,94

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS						
<b>SÜDKOREA</b>				<b>THAILAND</b>				<b>0,000 % fällig am 26.08.2023 (c)</b>									
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>									
POSCO Holdings, Inc. 0,000 % fällig am 01.09.2026 (c)	€	800	\$ 896	0,28	Bangkok Bank PCL 4,300 % fällig am 15.06.2027	\$	1.800	\$ 1.750	0,55	Celestial Miles Ltd. 5,750 % fällig am 31.01.2024 (e)	1.600	1.580	0,49				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>									
Hana Bank 3,250 % fällig am 30.03.2027	\$	2.300	2.155	0,67	Kasikornbank PCL 5,275 % fällig am 14.10.2025 (e)(g)		1.100	1.040	0,33	Champion Path Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 27.01.2026	900	796	0,25				
KB Capital Co. Ltd. 1,500 % fällig am 28.10.2025		700	629	0,20	Summe Thailand		5.493	1,72		Easy Tactic Ltd. (6,500 % bar oder 7,500 % PIK) 7,500 % fällig am 11.07.2027 (b)	700	60	0,02				
Kodit Global Co. Ltd. 4,954 % fällig am 25.05.2026		1.500	1.477	0,46	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					3.400	255	0,08	NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % fällig am 10.03.2028 (e)	3.550	2.412	0,75	
Kookmin Bank 2,500 % fällig am 04.11.2030 (g)		1.400	1.137	0,36	Diamond Ltd. 7,950 % fällig am 28.07.2026		600	591	0,18	4,800 % fällig am 09.09.2023 (e)	400	236	0,07	5,250 % fällig am 22.03.2026 (e)	1.600	1.410	0,44
POSCO 5,750 % fällig am 17.01.2028		3.700	3.755	1,17	HSBC Holdings PLC 8,000 % fällig am 07.03.2028 (e)(g)		600	597	0,19	Peak RE BVI Holding Ltd. 5,350 % fällig am 28.10.2025 (e)	1.300	1.079	0,34	RKPF Overseas Ltd. 5,125 % fällig am 26.07.2026	2.600	1.192	0,37
Shinhan Bank Co. Ltd. 4,000 % fällig am 23.04.2029 (g)		200	182	0,06	Jaguar Land Rover Automotive PLC 4,500 % fällig am 15.07.2028	€	900	860	0,27	5,900 % fällig am 05.03.2025	305	194	0,06	Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029	1.100	816	0,26
Shinhan Card Co. Ltd. 2,500 % fällig am 27.01.2027		3.400	3.034	0,95	Prudential Funding Asia PLC 2,950 % fällig am 03.11.2033	\$	700	592	0,18	6,000 % fällig am 15.07.2025	1.100	1.022	0,32	TSMC Global Ltd. 1,750 % fällig am 23.04.2028	1.800	1.551	0,49
SK Broadband Co. Ltd. 4,875 % fällig am 28.06.2028		1.500	1.479	0,46	Standard Chartered PLC 0,991 % fällig am 12.01.2025		1.200	1.164	0,36	Wanda Properties Global Co. Ltd. 11,000 % fällig am 20.01.2025	300	134	0,04	11,000 % fällig am 13.02.2026	200	85	0,03
SK Hynix, Inc. 1,500 % fällig am 19.01.2026		200	177	0,05	1,822 % fällig am 23.11.2025		1.400	1.310	0,41	Wheelock MTN BVI Ltd. 2,375 % fällig am 25.01.2026	1.500	1.381	0,43	Summe Jungferinseln (Britisch)		15.193	4,75
2,375 % fällig am 19.01.2031		2.720	2.100	0,66	3,603 % fällig am 12.01.2033 (h)		500	401	0,13	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 281.696	88,08				
SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026		3.200	3.175	0,99	6,000 % fällig am 26.07.2025 (e)(g)		1.200	1.143	0,36								
Tongyang Life Insurance Co. Ltd. 5,250 % fällig am 22.09.2025 (e)		1.700	1.504	0,47	6,170 % fällig am 09.01.2027		1.500	1.499	0,47								
Woori Bank 4,875 % fällig am 26.01.2028		1.800	1.783	0,56	6,187 % fällig am 06.07.2027 (a)		500	500	0,16								
			22.587	7,06	6,301 % fällig am 09.01.2029		2.300	2.314	0,72								
					7,750 % fällig am 15.08.2027 (e)(g)		2.100	2.085	0,65								
					Vedanta Resources Finance PLC 8,950 % fällig am 11.03.2025		1.350	1.021	0,32								
					Summe Großbritannien		14.077	4,40									
					<b>USA</b>												
					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>												
					Hyundai Capital America 2,750 % fällig am 27.09.2026		700	637	0,20								
					Stillwater Mining Co. 4,000 % fällig am 16.11.2026		800	715	0,22								
								1.352	0,42								
					<b>US-SCHATZOBBLIGATIONEN</b>												
					U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.11.2051		600	396	0,12								
					2,250 % fällig am 15.08.2049		20	15	0,01								
					U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,125 % fällig am 15.01.2032		4.267	3.759	1,18								
					U.S. Treasury Notes 3,250 % fällig am 31.08.2024		6.100	5.954	1,86								
								10.124	3,17								
					Summe USA			11.476	3,59								
					<b>VIETNAM</b>												
					<b>STAATSEMISSIONEN</b>												
					Vietnam Debt & Asset Trading Corp. 1,000 % fällig am 10.10.2025		1.600	1.354	0,42								
					Vietnam Government International Bond 5,500 % fällig am 12.03.2028		1.950	1.882	0,59								
					Summe Vietnam			3.236	1,01								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 347	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	\$ (354)	\$ 347	\$ 347	0,11
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (354)	\$ 347	\$ 347	0,11

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	6	\$ 10	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	3	4	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	4	(9)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	32	(94)	(0,03)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	33	68	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	175	(330)	(0,10)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	11	15	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	40	(2)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	67	52	0,02
				\$ (286)	(0,09)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (286)	(0,09)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Atlantia SpA	1,000 %	20.06.2025	€ 100	\$ 8	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	400	(22)	(0,01)
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2028	400	19	0,01
				\$ 5	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850 %	20.09.2033	¥ 450.000	\$ (26)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	15.06.2024	\$ 10.900	(35)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	14.400	332	0,10
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033	KRW 5.041.456	(39)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,500	15.03.2028	4.761.600	27	0,01
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	0,500	16.12.2025	AUD 800	59	0,02
					\$ 318	0,10
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 323	0,10

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Saudi Arabia Government International Bond	(1,000) %	20.06.2028	\$ 5.200	\$ (75)	\$ (27)	\$ (102)	(0,03)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Longfor Group Holdings Ltd,	1,000 %	20.06.2026	\$ 600	\$ (10)	\$ (61)	\$ (71)	(0,03)
BRC	BOC Aviation Ltd,	1,000	20.06.2026	2.000	(7)	11	4	0,00
	Philippines Government International Bond	1,000	20.06.2028	2.400	11	9	20	0,01
CBK	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2028	9.600	51	12	63	0,02
	Vietnam Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.400	(40)	37	(3)	0,00
					\$ 5	\$ 8	\$ 13	0,00

- (1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**ZINSSWAPS**

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545 %	05.05.2028	MYR 15.644	\$ 0	\$ 18	\$ 18	0,01
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	19.310	6	23	29	0,01
						\$ 6	\$ 41	\$ 47	0,02

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettozunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	08.2023	AUD	1.425	\$ 963	\$ 14	\$ 0	14	0,01	
	08.2023	CNY	1.082	158	8	0	8	0,00	
	08.2023	¥	451.300	3.160	17	0	17	0,01	
	09.2023	IDR	358.262	24	0	0	0	0,00	
	09.2023	TWD	15.282	503	12	0	12	0,01	
	09.2023	\$	98	HKD	762	0	0	0,00	
	09.2023		1.761	INR	145.646	9	9	0,00	
BPS	07.2023		4.019	€	3.668	0	(17)	(0,01)	
	07.2023		1.722	MYR	7.906	0	(25)	(0,01)	
	08.2023	CNY	1.273	\$	186	10	0	0,00	
	08.2023	€	3.668		4.025	17	0	0,01	
	08.2023	TWD	7.649		251	5	0	0,00	
	08.2023	\$	774	CNH	5.348	0	(36)	(0,01)	
	09.2023	THB	371	\$	11	0	0	0,00	
BRC	08.2023	\$	114	¥	15.085	0	(9)	0,00	
	09.2023	PHP	93.068	\$	1.661	0	(19)	(0,01)	
CBK	07.2023		170.959		3.134	43	0	0,01	
	08.2023	TWD	7.964		261	5	0	0,00	
	09.2023	\$	1.645	INR	135.260	0	(1)	0,00	
DUB	08.2023	CNH	12.708	\$	1.805	54	0	0,02	
GLM	09.2023	\$	3.336	THB	115.103	0	(66)	(0,02)	
JPM	07.2023	€	15	\$	16	0	0	0,00	
	07.2023	PHP	11.188		205	2	0	0,00	
	08.2023	CNH	9.498		1.355	45	0	0,02	
	08.2023	CNY	1.343		196	11	0	0,00	
	08.2023	\$	621	CNH	4.293	0	(29)	(0,01)	
	09.2023	IDR	149.873	\$	10	0	0	0,00	
	09.2023	THB	806		24	1	0	0,00	
	09.2023	\$	2	IDR	26.413	0	0	0,00	
MYI	07.2023	HKD	20	\$	3	0	0	0,00	
	07.2023	IDR	94.440		6	0	0	0,00	
	07.2023	\$	13	€	12	0	0	0,00	
	07.2023		1	£	1	0	0	0,00	
	07.2023		6	IDR	94.440	0	0	0,00	
	08.2023	CNH	2.673	\$	382	13	0	0,01	
	08.2023	TWD	8.456		279	7	0	0,00	
	08.2023	\$	1.625	¥	216.013	0	(122)	(0,04)	
	09.2023	IDR	94.522	\$	6	0	0	0,00	
	09.2023	\$	11	IDR	168.118	0	0	0,00	
SCX	07.2023		1.727	MYR	7.936	0	(23)	(0,01)	
	08.2023	CNH	15.880	\$	2.313	124	0	0,04	
	08.2023	CNY	3.566		522	29	0	0,01	
	08.2023	TWD	177		6	0	0	0,00	
	08.2023	\$	296	CNH	2.035	0	(15)	0,00	
	08.2023		1.732	TWD	52.659	0	(41)	(0,01)	
	09.2023	THB	834	\$	24	0	0	0,00	
	09.2023	TWD	12.770		419	8	0	0,00	
	09.2023	\$	1.773	IDR	26.360.654	0	(22)	(0,01)	
SOG	07.2023	€	3.668	\$	3.946	0	(56)	(0,02)	
TOR	08.2023	\$	750	¥	99.487	0	(58)	(0,02)	
UAG	08.2023		228	CNH	1.580	0	(10)	0,00	
	09.2023	SGD	4.587	\$	3.432	33	0	0,01	
	09.2023	\$	1.667	INR	137.786	8	0	0,00	
						\$ 475	\$ (549)	\$ (74)	(0,02)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	\$ 49	€ 45	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	07.2023	€ 55	\$ 58	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 36.935	€ 34.365	558	0	558	0,18
CBK	07.2023	€ 37.057	\$ 40.259	1	(170)	(169)	(0,05)
	07.2023	\$ 126	€ 117	2	0	2	0,00
	08.2023	38.011	34.913	131	0	131	0,04
GLM	07.2023	2.093	1.959	45	0	45	0,01
MBC	07.2023	€ 652	\$ 715	3	0	3	0,00
	07.2023	\$ 37.987	€ 35.529	775	0	775	0,24
SCX	07.2023	37.030	34.602	721	0	721	0,23
UAG	07.2023	€ 92	\$ 100	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 2.236	\$ (172)	\$ 2.064	0,65

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	\$ 29	£ 23	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
MBC	07.2023	117	94	3	0	3	0,00
MYI	07.2023	120	96	3	0	3	0,00
SCX	07.2023	31	25	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	94	75	2	0	2	0,00
				\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
GLM	07.2023	\$ 1.325	SGD 1.781	\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	(0,01)
MBC	07.2023	2.038	2.754	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	35	47	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD 3.488	\$ 2.581	4	0	4	0,00
	08.2023	\$ 2.547	SGD 3.439	0	(4)	(4)	0,00
SCX	07.2023	2.149	2.909	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	2.396	3.239	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 4	\$ (19)	\$ (15)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 1.942 0,61

Summe Anlagen

\$ 304.857 95,32

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 14.962 4,68

Nettovermögen

\$ 319.819 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,06 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Flourish Century	6,600 %	04.02.2022	25.08.2021 - 27.08.2021	\$ 1.676	\$ 189	0,06
Standard Chartered PLC	3,603	12.01.2033	06.02.2023	432	401	0,13
				\$ 2.108	\$ 590	0,19



Barmittel in Höhe von 2.463 USD (31. Dezember 2022: 1.987 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 30 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 279.938	\$ 1.758	\$ 281.696
Investmentfonds	20.835	0	0	20.835
Pensionsgeschäfte	0	347	0	347
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	5	1.974	0	1.979
Summen	\$ 20.840	\$ 282.259	\$ 1.758	\$ 304.857

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 276.388	\$ 571	\$ 276.959
Investmentfonds	28.745	1.001	0	29.746
Pensionsgeschäfte	0	820	0	820
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	160	2.557	(82)	2.635
Summen	\$ 28.905	\$ 280.766	\$ 489	\$ 310.160

<sup>(1)</sup> Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 515	\$ (590)	\$ (75)	\$ (103)	\$ 0	\$ (103)
BPS	(117)	0	(117)	(80)	0	(80)
BRC	(4)	0	(4)	(20)	30	10
CBK	71	0	71	917	(820)	97
DUB	54	0	54	77	0	77
GLM	(12)	0	(12)	61	(250)	(189)
GST	29	0	29	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	30	0	30	34	0	34
MBC	778	(740)	38	661	(670)	(9)
MYI	(99)	0	(99)	10	(129)	(119)
SCX	782	(690)	92	894	(680)	214
SOG	(56)	0	(56)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(58)	0	(58)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	29	0	29	2	0	2

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	74,58	75,24
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	13,50	12,97
Investmentfonds	6,51	9,47
Pensionsgeschäfte	0,11	0,26
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,09)	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,10	0,11
Freiverkehrsfinanzderivate	0,61	0,78

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,75	2,17
Brasilien	0,10	0,10
Cayman-Inseln	15,62	17,23
China	3,95	4,71

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Frankreich	0,53	0,56
Deutschland	0,49	0,68
Hongkong	6,14	5,57
Indien	4,72	7,64
Indonesien	7,60	9,42
Irland	0,99	k. A.
Israel	k. A.	0,15
Japan	2,22	2,19
Jersey, Kanalinseln	0,41	0,38
Luxemburg	0,22	0,22
Malaysia	2,51	2,11
Mauritius	3,16	4,60
Mexiko	0,23	0,24
Mongolei	0,87	0,53
Niederlande	1,07	1,40
Pakistan	1,08	0,87
Philippinen	1,69	1,62
Singapur	2,94	3,04
Südkorea	13,36	7,62
Sri Lanka	0,96	0,70
Thailand	1,72	2,83
Großbritannien	4,40	1,74
USA	3,59	4,01
Vietnam	1,01	0,00
Jungfernseln (Britisch)	4,75	5,88
Investmentfonds	6,51	9,47
Pensionsgeschäfte	0,11	0,26
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,09)	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,02)
Zinsswaps	0,10	0,13
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,03)	(0,04)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,04)
Zinsswaps	0,02	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,02)	0,03
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,64	0,83
Sonstige Aktiva und Passiva	4,68	1,22
Nettovermögen	100,00	100,00



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>								<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>ÖSTERREICH</b>								<b>ÖSTERREICH</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Erste Group Bank AG 4,250 % fällig am 15.10.2027 (d)(f)	€ 85.400	\$ 71.062	1,30	7,875 % fällig am 23.01.2024 (d)(f)	\$ 17.200	\$ 17.056	0,31	HSBC Capital Funding Dollar LP 10,176 % fällig am 30.06.2030 (d)	\$ 3.817	\$ 4.730	0,09
6,500 % fällig am 15.04.2024 (d)(f)	10.200	10.791	0,20	Electricite de France S.A. 2,875 % fällig am 15.12.2026 (d)	€ 200	186	0,00	Summe Jersey, Kanalinseln		89.738	1,65
Summe Österreich		81.853	1,50	9,125 % fällig am 15.03.2033 (d)	\$ 23.800	24.466	0,45	<b>LUXEMBURG</b>			
<b>BELGIEN</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
KBC Group NV 4,250 % fällig am 24.10.2025 (d)(f)	66.000	62.264	1,14	Societe Generale S.A. 3,337 % fällig am 21.01.2033	30.100	24.128	0,44	CPI Property Group S.A. 4,875 % fällig am 16.07.2025 (d)	€ 2.000	790	0,02
4,750 % fällig am 05.03.2024 (d)(f)	14.600	15.381	0,28	6,221 % fällig am 15.06.2033	20.300	18.915	0,35	4,875 % fällig am 18.08.2026 (d)	14.200	6.218	0,11
Summe Belgien		77.645	1,42	6,446 % fällig am 10.01.2029	400	401	0,01	Summe Luxemburg		7.008	0,13
<b>KANADA</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bank of Nova Scotia 3,625 % fällig am 27.10.2081 (f)(g)(h)	\$ 19.200	13.587	0,25	6,691 % fällig am 10.01.2034	36.200	36.880	0,68	Summe Niederlande		821.656	15,08
4,900 % fällig am 04.06.2025 (d)(f)(h)	27.300	25.841	0,48	7,875 % fällig am 18.12.2034 (d)(f)	26.800	26.275	0,48	<b>NORWEGEN</b>			
Scotiabank Capital Trust 5,650 % fällig am 31.12.2056	CAD 18.216	14.246	0,26	8,000 % fällig am 29.09.2025 (d)(f)	49.150	46.169	0,85	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Toronto-Dominion Bank 8,125 % fällig am 31.10.2082 (f)(h)	\$ 13.000	13.239	0,24	Summe Frankreich		673.175	12,35	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Summe Kanada		66.913	1,23	<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>DÄNEMARK</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nykredit Realkredit A/S 4,125 % fällig am 15.04.2026 (d)(f)	€ 25.600	25.380	0,47	Commerzbank AG 5,125 % fällig am 18.01.2030	€ 1.900	2.071	0,04	de Volksbank NV 7,000 % fällig am 15.12.2027 (d)(f)	35.000	31.930	0,59
<b>FINNLAND</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nordea Bank Abp 3,750 % fällig am 01.03.2029 (d)(f)	\$ 58.500	43.430	0,80	6,500 % fällig am 09.10.2029 (d)(f)	31.800	30.297	0,55	ING Groep NV 3,875 % fällig am 16.05.2027 (d)(f)	\$ 53.726	38.510	0,71
<b>FRANKREICH</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Altice France S.A. 4,250 % fällig am 15.10.2029 (h)	€ 8.800	6.933	0,13	6,500 % fällig am 06.12.2032	17.900	19.410	0,36	4,250 % fällig am 16.05.2031 (d)(f)	69.200	46.212	0,85
5,500 % fällig am 15.10.2029	\$ 17.900	12.819	0,24	Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032 (g)	\$ 13.475	10.198	0,19	4,875 % fällig am 16.05.2029 (d)(f)	33.500	26.036	0,48
BNP Paribas S.A. 2,871 % fällig am 19.04.2032	2.100	1.722	0,03	7,079 % fällig am 10.02.2034	23.185	21.456	0,39	5,750 % fällig am 16.11.2026 (d)(f)	89.300	78.940	1,45
3,132 % fällig am 20.01.2033 (h)	16.600	13.634	0,25	10,000 % fällig am 01.12.2027 (d)(f)	€ 35.800	38.814	0,71	6,750 % fällig am 16.04.2024 (d)(f)	6.100	5.833	0,11
3,132 % fällig am 20.01.2033	6.800	5.585	0,10	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 5,875 % fällig am 23.05.2042	\$ 16.800	16.895	0,31	7,500 % fällig am 16.05.2028 (d)(f)	56.400	51.920	0,95
4,500 % fällig am 25.02.2030 (d)(f)	20.000	14.232	0,26	Summe Deutschland		139.141	2,55	LeasePlan Corp. NV 7,375 % fällig am 29.05.2024 (d)(f)	€ 48.500	52.021	0,95
4,625 % fällig am 12.01.2027 (d)(f)	34.400	27.241	0,50	<b>HONGKONG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,625 % fällig am 25.02.2031 (d)(f)	13.400	9.598	0,18	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,875 % fällig am 06.12.2029 (d)(f)	€ 28.400	29.781	0,55	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
7,000 % fällig am 16.08.2028 (d)(f)	\$ 65.800	59.067	1,08	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
7,375 % fällig am 11.06.2030 (d)(f)	€ 21.800	23.116	0,42	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
7,750 % fällig am 16.08.2029 (d)(f)	\$ 74.965	72.746	1,33	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
9,250 % fällig am 17.11.2027 (d)(f)	37.200	38.432	0,70	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>BPCE S.A.</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
1,500 % fällig am 13.01.2042 (f)	€ 8.600	7.912	0,15	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
2,125 % fällig am 13.10.2046 (f)	36.000	28.133	0,52	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Credit Agricole S.A. 7,250 % fällig am 23.09.2028 (d)(f)	117.500	127.748	2,34	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig am 05.11.2031 (d)	£ 66.532	85.008	1,56	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>SPANIEN</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (d)(f)	8.200	8.875	0,16	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,000 % fällig am 29.03.2024 (d)(f)	80.800	85.498	1,57	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,000 % fällig am 15.01.2026 (d)(f)	10.000	10.264	0,19	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
8,375 % fällig am 21.06.2028 (d)(f)	20.200	21.956	0,40	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco de Credito Social Cooperativo S.A. 1,750 % fällig am 09.03.2028	11.300	10.068	0,19	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>SPANIEN</b>				<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>			
Banco Santander S.A.	36.200	26.089	0,48	Barclays PLC	200	158	0,00	Liberty Mutual Group, Inc.	15.500	16.105	0,30
3,625 % fällig am 21.03.2029 (d)(f)				2,894 % fällig am 24.11.2032				5,948 % fällig am 23.05.2059			
4,125 % fällig am 12.11.2027 (d)(f)(h)	50.800	41.650	0,76	6,125 % fällig am 15.12.2025 (d)(f)	33.483	29.390	0,54	Morgan Stanley	23.400	23.110	0,42
4,375 % fällig am 14.01.2026 (d)(f)	54.200	49.698	0,91	7,125 % fällig am 15.06.2025 (d)(f)	35.350	40.873	0,75	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	8.224	7.648	0,14
Bankinter S.A.	11.000	11.436	0,21	7,437 % fällig am 02.11.2033 (h)	16.000	17.319	0,32	5,650 % fällig am 01.05.2079 (h)			
6,250 % fällig am 17.01.2026 (d)(f)				8,000 % fällig am 15.06.2024 (d)(f)	47.524	45.024	0,83	Summe USA		121.682	2,23
7,375 % fällig am 15.08.2028 (d)(f)	8.600	8.902	0,16	9,250 % fällig am 15.09.2028 (d)(f)	19.500	22.456	0,41				
CaixaBank S.A.	61.200	45.560	0,84	Bupa Finance PLC	6.800	5.148	0,09	<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
3,625 % fällig am 14.09.2028 (d)(f)				4,000 % fällig am 24.09.2031 (d)(f)				5,127 % fällig am 12.09.2023 (b)(c)	62.500	61.867	1,13
5,250 % fällig am 23.03.2026 (d)(f)	11.600	10.734	0,20	HSBC Bank PLC				5,139 % fällig am 12.09.2023 (b)(c)	58.800	58.205	1,07
5,875 % fällig am 09.10.2027 (d)(f)	13.600	13.313	0,24	5,460 % fällig am 29.09.2023 (d)(h)	19.480	19.480	0,36	5,143 % fällig am 12.09.2023 (b)(c)	140.800	139.375	2,56
6,750 % fällig am 13.06.2024 (d)(f)	72.000	76.250	1,40	HSBC Holdings PLC	200	162	0,00	5,150 % fällig am 03.08.2023 (b)(c)	46.600	46.395	0,85
8,250 % fällig am 13.03.2029 (d)(f)	29.600	31.224	0,57	2,804 % fällig am 24.05.2032	200	222	0,00	5,161 % fällig am 08.08.2023 (b)(c)	2.800	2.786	0,05
Summe Spanien		451.517	8,28	5,875 % fällig am 28.09.2026 (d)(f)	200	222	0,00	5,183 % fällig am 15.08.2023 (b)(c)	6.900	6.858	0,13
<b>SCHWEDEN</b>				<b>AKTIEN</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Svenska Handelsbanken AB	40.000	33.973	0,63	Lloyds Banking Group PLC	70.522	70.336	1,29	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	14.302	142	0,00
4,375 % fällig am 01.03.2027 (d)(f)				4,944 % fällig am 27.06.2025 (d)(f)	€ 70.522			Summe kurzfristige Instrumente		1.004.563	18,43
4,750 % fällig am 01.03.2031 (d)(f)	37.400	29.013	0,53	7,500 % fällig am 27.06.2024 (d)(f)	\$ 15.800	15.107	0,28	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 5.571.381	102,22	
Swedbank AB	3.000	2.160	0,04	7,500 % fällig am 27.09.2025 (d)(f)	25.491	23.902	0,44				
4,000 % fällig am 17.03.2029 (d)(f)				7,875 % fällig am 27.06.2029 (d)(f)	44.954	50.700	0,93				
Summe Schweden		65.146	1,20	8,000 % fällig am 29.09.2029 (d)(f)	43.280	39.651	0,73				
<b>SCHWEIZ</b>				<b>USA</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Credit Suisse AG	450	439	0,01	Nationwide Building Society	19.270	21.038	0,39				
0,250 % fällig am 05.01.2026	€ 450			4,445 % fällig am 08.05.2030	\$ 33.800	31.099	0,57				
0,250 % fällig am 01.09.2028	200	175	0,00	4,500 % fällig am 31.03.2028 (d)(f)	18.200	17.476	0,32				
0,495 % fällig am 02.02.2024	\$ 600	577	0,01	4,600 % fällig am 28.06.2031 (d)(f)	22.659	15.748	0,29				
1,250 % fällig am 07.08.2026	500	431	0,01	4,892 % fällig am 18.05.2029	43.026	40.974	0,75				
4,474 % fällig am 01.09.2023	€ 800	872	0,02	5,076 % fällig am 27.01.2030 (h)	11.500	10.981	0,20				
4,713 % fällig am 31.05.2024	950	1.033	0,02	5,125 % fällig am 12.05.2027 (d)(f)	11.150	11.720	0,22				
4,750 % fällig am 09.08.2024	\$ 250	244	0,00	6,000 % fällig am 29.12.2025 (d)(f)	69.400	64.368	1,18				
5,000 % fällig am 09.07.2027	1.100	1.063	0,02	8,000 % fällig am 10.08.2025 (d)(f)	19.800	19.292	0,35				
7,500 % fällig am 15.02.2028	550	585	0,01	Santander UK Group Holdings PLC							
7,750 % fällig am 10.03.2026	€ 100	129	0,00	2,896 % fällig am 15.03.2032	1.600	1.295	0,02				
7,950 % fällig am 09.01.2025	\$ 250	255	0,00	6,534 % fällig am 10.01.2029	4.600	4.636	0,09				
UBS AG	5.000	4.924	0,09	6,750 % fällig am 24.06.2024 (d)(f)	€ 89.935	107.251	1,96				
5,125 % fällig am 15.05.2024 (f)				Santander UK PLC	8.753	8.707	0,16				
0,650 % fällig am 14.01.2028	€ 800	751	0,01	5,000 % fällig am 07.11.2023							
0,650 % fällig am 10.09.2029	100	86	0,00	Standard Chartered PLC	2.600	2.606	0,05				
1,000 % fällig am 24.06.2027	200	194	0,00	6,296 % fällig am 06.07.2034 (a)							
1,250 % fällig am 17.07.2025	250	261	0,01	Virgin Money UK PLC							
1,250 % fällig am 12.09.2025	€ 200	238	0,00	8,250 % fällig am 17.06.2027 (d)(f)	€ 20.000	21.482	0,39				
1,250 % fällig am 13.10.2026	€ 200	203	0,00	9,250 % fällig am 08.06.2024 (d)(f)	20.000	24.001	0,44				
1,250 % fällig am 15.11.2029	€ 200	199	0,00								
2,250 % fällig am 09.06.2028	300	315	0,01								
2,593 % fällig am 11.09.2025	\$ 850	811	0,02								
2,746 % fällig am 11.02.2033 (h)	11.570	9.019	0,17								
2,875 % fällig am 02.04.2032	€ 1.200	1.143	0,02								
3,091 % fällig am 14.05.2032	\$ 4.500	3.642	0,07								
3,250 % fällig am 02.04.2026	€ 1.800	1.893	0,03								
3,750 % fällig am 26.03.2025	\$ 700	670	0,01								
3,869 % fällig am 12.01.2029	300	271	0,01								
4,177 % fällig am 16.01.2026	€ 1.850	1.988	0,04								
4,194 % fällig am 01.04.2031	\$ 36.000	32.061	0,59								
4,282 % fällig am 09.01.2028	300	278	0,01								
4,375 % fällig am 10.02.2031 (d)(f)(h)	37.135	26.252	0,48								
4,375 % fällig am 10.02.2031 (d)(f)	5.100	3.605	0,07								
4,550 % fällig am 17.04.2026	200	192	0,00								
4,875 % fällig am 12.02.2027 (d)(f)(h)	43.100	34.611	0,64								
4,875 % fällig am 12.02.2027 (d)(f)	42.500	34.130	0,63								
5,959 % fällig am 12.01.2034	6.100	6.072	0,11								
6,373 % fällig am 15.07.2026	850	845	0,02								
6,442 % fällig am 11.08.2028	2.500	2.511	0,05								
6,537 % fällig am 12.08.2033	1.050	1.076	0,02								
7,000 % fällig am 19.02.2025 (d)(f)	5.737	5.474	0,10								
7,000 % fällig am 30.09.2027	€ 600	752	0,01								
7,375 % fällig am 07.09.2033	900	1.199	0,02								
7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 2.400	2.904	0,05								
9,016 % fällig am 15.11.2033	\$ 650	780	0,01								
Summe Schweiz		185.153	3,40								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
NOM	5,040 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 25.100	U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.05.2046	\$ (25.876)	\$ 25.100	\$ 25.111	0,46
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (25.876)	\$ 25.100	\$ 25.111	0,46

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	222	\$ (300)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	442	460	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1.252	(1.663)	(0,03)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	432	(997)	(0,02)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1.456	1.606	0,03
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	371	(356)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	4.949	(13.643)	(0,25)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	523	617	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	3.545	(5.789)	(0,10)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	1.403	1.699	0,03
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	455	776	0,02
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2023	422	(444)	(0,01)
				\$ (18.034)	(0,33)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (18.034)	(0,33)

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.06.2027	€ 20.000	\$ 1.279	0,02

**ZINSSWAPS**

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2051	£ 3.800	\$ 1.439	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053	31.100	2.055	0,04
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	93.100	6.895	0,13
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	43.900	3.107	0,06
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	21.100	(778)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 64.900	(373)	(0,01)
					\$ 12.345	0,23
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 13.624	0,25

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	\$	AUD	\$	\$	\$	0,00
	08.2023	AUD	\$				0,00
BOA	07.2023	CAD			(430)	(430)	(0,01)
	07.2023	€		277.698	(4.162)	(4.157)	(0,07)
	07.2023	SEK		9	0	0	0,00
	07.2023	\$	€	9.927	0	93	0,00
	07.2023		£	2.484	0	23	0,00
	08.2023		CNY	335	(2)	(2)	0,00
BPS	07.2023	AUD	\$	46	(1)	(1)	0,00
	07.2023	€		1.848.252	(27.468)	(27.468)	(0,50)
	07.2023	£		2.284	(64)	(64)	0,00
	07.2023	\$	AUD	134	0	0	0,00
	07.2023		€	36.578	(34)	520	0,01
	08.2023	AUD	\$	89	0	0	0,00
	08.2023	\$	CNY	394	(3)	(3)	0,00
BRC	07.2023	£	\$	35.167	(765)	(765)	(0,01)
	07.2023	\$	£	16.634	(28)	(28)	0,00
CBK	07.2023	€	\$	25.351	(323)	(309)	(0,01)
	07.2023	£		6.309	(47)	(47)	0,00
	07.2023	\$	€	282.810	0	1.305	0,03
	07.2023		£	16.126	(12)	(5)	0,00
	08.2023	CNH	\$	38	0	1	0,00
	08.2023	€		276.900	(956)	(956)	(0,02)
DUB	07.2023	AUD		307	0	10	0,00
JPM	07.2023	€		6.990	(143)	(143)	0,00
	07.2023	SGD		1.336	0	31	0,00
	07.2023	\$	€	1.652.218	(1.486)	(1.486)	(0,03)
	07.2023		£	452.099	0	3.143	0,06
	08.2023	€	\$	1.806.580	0	1.541	0,03
	08.2023	£		571.755	(3.136)	(3.136)	(0,06)
	08.2023	\$	CNY	415	(3)	(3)	0,00
MBC	07.2023	CAD	\$	528	(13)	(13)	0,00
	07.2023	€		7.394	(144)	(144)	0,00
	07.2023	£		407.242	(10.968)	(10.968)	(0,20)
	07.2023	\$	€	26.125	(82)	115	0,00
	07.2023		£	985	(7)	(7)	0,00
MYI	07.2023	€	\$	1.636	7	7	0,00
	07.2023	£		162.576	(3.726)	(3.726)	(0,07)
	07.2023	SEK		446	3	3	0,00
	07.2023	\$	€	35.336	0	206	0,00
	07.2023		£	4.072	0	108	0,00
	07.2023		SEK	4.888	0	0	0,00
	08.2023	SEK	\$	453	0	0	0,00
RBC	07.2023	£		210	1	1	0,00
SCX	07.2023	\$	AUD	275	0	0	0,00
	08.2023	AUD	\$	183	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$	CNH	290	(2)	(2)	0,00
SOG	07.2023	AUD	\$	194	(3)	(3)	0,00
TOR	07.2023	\$	AUD	338	2	2	0,00
	07.2023		CAD	21.393	(12)	(1)	0,00
	08.2023	AUD	\$	224	(2)	(2)	0,00
	08.2023	CAD		16.168	(11)	1	0,00
UAG	07.2023	AUD		200	(3)	(3)	0,00
	07.2023	€		28.016	(536)	(536)	(0,01)
	07.2023	\$	AUD	163	0	1	0,00
	08.2023	AUD	\$	108	(1)	(1)	0,00
	09.2023	\$	SGD	21	0	0	0,00
				\$ 7.275	\$ (54.574)	\$ (47.299)	(0,86)

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Investor AUD (Hedged) ausschüttend und die Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	\$	\$	\$	\$	0,00
	07.2023	\$	AUD	104	(10)	(10)	0,00
	08.2023			10	0	10	0,00
BOA	07.2023	AUD	\$	286	4	4	0,00
	07.2023	\$	AUD	19.198	293	293	0,01
BPS	07.2023	AUD	\$	17.248	0	(84)	0,00
	07.2023	\$	AUD	567	7	7	0,00
	08.2023			25.620	84	84	0,00
CBK	07.2023	AUD	\$	556	12	12	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
JPM	07.2023	\$ 4.143	AUD 6.350	\$ 84	\$ 0	\$ 84	0,00
	07.2023	6.307	9.647	115	0	115	0,00
MBC	07.2023	AUD 193	\$ 128	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07.2023	127	87	2	0	2	0,00
SCX	07.2023	8.831	5.863	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	\$ 5.029	AUD 7.696	94	0	94	0,00
	08.2023	5.867	8.831	16	0	16	0,00
SOG	07.2023	10.043	15.350	175	0	175	0,00
TOR	07.2023	AUD 15.420	\$ 10.185	0	(79)	(79)	0,00
	07.2023	\$ 10.670	AUD 16.314	189	0	189	0,01
	08.2023	10.193	15.420	79	0	79	0,00
UAG	07.2023	AUD 29.991	\$ 19.917	41	(87)	(46)	0,00
	07.2023	\$ 4.861	AUD 7.426	82	0	82	0,00
	08.2023	19.744	29.713	88	(38)	50	0,00
				\$ 1.479	\$ (315)	\$ 1.164	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	BRL 162	\$ 32	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
BPS	07.2023	21.681	4.538	44	(1)	43	0,00
	07.2023	\$ 32	BRL 152	0	0	0	0,00
	08.2023	BRL 478	\$ 100	1	0	1	0,00
	08.2023	\$ 4.105	BRL 19.713	0	(39)	(39)	0,00
CBK	07.2023	BRL 20.452	\$ 4.277	37	0	37	0,00
	07.2023	\$ 4.488	BRL 22.477	171	0	171	0,00
	08.2023	4.255	20.452	0	(36)	(36)	0,00
GLM	07.2023	4.783	23.958	184	0	184	0,01
JPM	07.2023	BRL 8.794	\$ 1.812	7	(18)	(11)	0,00
	07.2023	\$ 4.844	BRL 24.248	183	0	183	0,00
	08.2023	BRL 76	\$ 16	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	19.748	4.116	23	0	23	0,00
	08.2023	\$ 4.095	BRL 19.748	0	(21)	(21)	0,00
				\$ 650	\$ (116)	\$ 534	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die ausschüttende Investor CAD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 975	CAD 1.326	\$ 27	\$ 0	\$ 27	0,00
CBK	07.2023	957	1.304	28	0	28	0,00
MBC	07.2023	28	38	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	CAD 43	\$ 32	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	\$ 980	CAD 1.332	26	0	26	0,00
				\$ 82	\$ 0	\$ 82	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF 88	\$ 98	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 659	CHF 590	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	CHF 14.388	\$ 16.087	5	0	5	0,00
	07.2023	\$ 20.651	CHF 18.681	229	0	229	0,01
	08.2023	16.016	14.283	0	(5)	(5)	0,00
CLY	07.2023	CHF 7.571	\$ 8.428	0	(34)	(34)	0,00
	08.2023	\$ 8.428	CHF 7.549	34	0	34	0,00
JPM	07.2023	CHF 314	\$ 348	0	(4)	(4)	0,00
MBC	07.2023	201	224	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 22	CHF 20	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CHF 57	\$ 63	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 350	CHF 317	4	0	4	0,00
RYL	07.2023	CHF 11	\$ 12	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	181	199	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	\$ 15.535	CHF 13.958	67	0	67	0,00
UAG	07.2023	CHF 14.805	\$ 16.516	0	(33)	(33)	0,00
	07.2023	\$ 14.216	CHF 12.773	61	0	61	0,00
	08.2023	16.516	14.763	33	0	33	0,00
				\$ 434	\$ (80)	\$ 354	0,01

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 450	\$ 491	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2023	\$ 793.672	€ 738.470	12.000	0	12.000	0,22
BPS	07.2023	€ 728.477	\$ 798.180	3.413	(2)	3.411	0,06
	07.2023	\$ 787.788	€ 732.820	11.721	0	11.721	0,21
CBK	08.2023	795.650	725.139	0	(3.442)	(3.442)	(0,06)
	07.2023	€ 727.517	\$ 790.962	0	(2.760)	(2.760)	(0,05)
JPM	07.2023	\$ 13.694	€ 12.758	224	0	224	0,00
	08.2023	790.649	726.210	2.731	0	2.731	0,05
MBC	07.2023	€ 726.210	\$ 792.948	653	0	653	0,01
	08.2023	\$ 794.057	€ 726.210	0	(677)	(677)	(0,01)
SOG	07.2023	€ 23.655	\$ 25.597	28	(239)	(211)	0,00
	07.2023	\$ 3.667	€ 3.429	73	0	73	0,00
	07.2023	788.324	732.820	11.184	0	11.184	0,21
				\$ 42.028	\$ (7.120)	\$ 34.908	0,64

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 155	£ 123	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2023	£ 348	\$ 437	2	(7)	(5)	0,00
BPS	07.2023	\$ 51.481	£ 41.622	1.435	0	1.435	0,02
	07.2023	£ 161	\$ 204	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2023	\$ 348	£ 274	0	0	0	0,00
	07.2023	£ 266	\$ 336	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07.2023	\$ 117	£ 93	1	0	1	0,00
	07.2023	£ 41.953	\$ 53.046	0	(292)	(292)	(0,01)
MBC	08.2023	\$ 53.057	£ 41.953	291	0	291	0,01
	07.2023	\$ 53.170	£ 42.946	1.430	0	1.430	0,03
MYI	07.2023	\$ 52.413	£ 42.171	1.202	0	1.202	0,02
	07.2023	£ 41.982	\$ 53.346	0	(27)	(27)	0,00
TOR	07.2023	\$ 53.358	£ 41.982	26	0	26	0,00
				\$ 4.388	\$ (329)	\$ 4.059	0,07

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) Income, Investor SGD (Hedged) Income, Administrative SGD (Hedged) Income II und M Retail SGD (Hedged) Income II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$ 24.236	SGD 32.795	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	07.2023	SGD 320	\$ 238	1	0	1	0,00
GLM	07.2023	\$ 340	SGD 457	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	SGD 31.840	\$ 23.529	3	0	3	0,00
JPM	07.2023	\$ 2.141	SGD 2.898	0	0	0	0,00
	08.2023	23.529	31.809	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023	22.109	29.872	0	(37)	(37)	0,00
	08.2023	SGD 292	\$ 216	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	31.368	23.214	37	(1)	36	0,00
	08.2023	\$ 22.780	SGD 30.752	0	(34)	(34)	0,00
UAG	07.2023	SGD 249	\$ 184	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 23.857	SGD 32.273	0	(10)	(10)	0,00
				\$ 41	\$ (91)	\$ (50)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (6.248) (0,11)

Summe Anlagen

\$ 5.585.965 102,49

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (135.963) (2,49)

Nettovermögen

\$ 5.450.002 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,66 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Bank of Nova Scotia	3,625 %	27.10.2081	29.09.2021	\$ 19.200	\$ 13.587	0,25
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	17.10.2022 - 24.01.2023	10.466	10.198	0,19
				\$ 29.666	\$ 23.785	0,44

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 290.514 USD (31. Dezember 2022: 627.510 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 9.837 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von 12.150 USD (31. Dezember 2022: 29.992 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 8.540 USD (31. Dezember 2022: 18.271 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 62.214 USD (31. Dezember 2022: 80.890 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.570.373	\$ 1.008	\$ 5.571.381
Investmentfonds	142	0	0	142
Pensionsgeschäfte	0	25.100	0	25.100
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.694)	(8.964)	0	(10.658)
Summen	\$ (1.552)	\$ 5.586.509	\$ 1.008	\$ 5.585.965

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.129.600	\$ 0	\$ 6.129.600
Investmentfonds	140	0	0	140
Pensionsgeschäfte	0	10.172	0	10.172
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	25.386	(4.310)	0	21.076
Summen	\$ 25.526	\$ 6.135.462	\$ 0	\$ 6.160.988

<sup>(1)</sup> Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	3,500 %	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (6.429)	\$ (7.048)	(0,13)
	5,480	23.05.2023	07.07.2023	\$ (30.710)	(30.892)	(0,57)
BRC	3,450	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (4.445)	(4.872)	(0,09)
JML	5,050	22.03.2023	06.07.2023	\$ (25.517)	(25.878)	(0,47)
	5,590	06.01.2023	06.07.2023	(61.405)	(62.975)	(1,15)
	5,590	02.03.2023	06.07.2023	(12.164)	(12.383)	(0,23)
	5,590	08.03.2023	06.07.2023	(12.726)	(12.945)	(0,24)
	5,590	22.03.2023	06.07.2023	(3.676)	(3.732)	(0,07)
NOM	4,250	08.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(4.738)	(4.768)	(0,09)
SCX	5,270	10.04.2023	10.07.2023	(34.615)	(35.030)	(0,64)
	5,270	15.06.2023	10.07.2023	(36.339)	(36.425)	(0,67)
	5,340	10.04.2023	10.07.2023	(16.238)	(16.435)	(0,30)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (253.383)	(4,65)

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.



Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 104	\$ (80)	\$ 24	\$ 137	\$ 0	\$ 137
BOA	7.853	(5.909)	1.944	1.028	(1.010)	18
BPS	(13.655)	12.150	(1.505)	(1.308)	1.490	182
BRC	(798)	709	(89)	37	(10)	27
CBK	479	(300)	179	6.857	(6.830)	27
DUB	10	0	10	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	182	0	182	352	(400)	(48)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(268)	262	(6)
JPM	206	(290)	(84)	175	(340)	(165)
MBC	(9.762)	7.291	(2.471)	14.804	(13.250)	1.554
MYI	(2.195)	1.516	(679)	771	(650)	121
RBC	3	0	3	34	0	34
SCX	181	(290)	(109)	(28.111)	26.890	(1.221)
SOG	11.356	(8.370)	2.986	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	190	(280)	(90)	(140)	1.350	1.210
UAG	(402)	321	(81)	(147)	0	(147)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,71	82,69
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	17,32	24,44
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,19	k. A.
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	0,46	0,18
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,33)	0,42
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,25	0,05
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,11)	(0,10)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(4,65)	(10,11)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Österreich	1,50	1,85
Belgien	1,42	1,41
Kanada	1,23	1,20
Cayman-Inseln	k. A.	0,11
China	k. A.	0,01
Dänemark	0,47	0,44
Finnland	0,80	0,82
Frankreich	12,35	13,26
Deutschland	2,55	3,81
Hongkong	0,19	0,12
Irland	3,38	3,56
Israel	k. A.	0,26
Italien	7,11	7,66
Jersey, Kanalinseln	1,65	1,51
Luxemburg	0,13	0,64
Mexiko	k. A.	0,71
Niederlande	15,08	15,07
Norwegen	0,47	0,36
Portugal	0,28	0,16
Slowenien	0,62	0,60
Spanien	8,28	8,65
Schweden	1,20	0,72
Schweiz	3,40	7,67
Großbritannien	19,45	18,81
USA	2,23	1,51
Kurzfristige Instrumente	18,43	16,21
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	0,46	0,18
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,33)	0,42
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	(0,03)
Zinsswaps	0,23	0,08
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	(0,04)
Devisenterminkontrakte	(0,86)	(1,11)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,75	1,05
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,49)	(7,68)
Nettovermögen	100,00	100,00



BESCHREIBUNG  
 ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
<b>AUSTRALIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
GPT Wholesale Office Fund 3,222 % fällig am 05.11.2031	AUD	500	\$ 259	0,09
Lendlease Finance Ltd. 3,400 % fällig am 27.10.2027		930	544	0,19
3,700 % fällig am 31.03.2031		200	104	0,03
Summe Australien			907	0,31

**ÖSTERREICH**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Erste Group Bank AG 0,125 % fällig am 17.05.2028	€	700	631	0,22
UniCredit Bank Austria AG 3,125 % fällig am 21.09.2029		600	645	0,22
Summe Österreich			1.276	0,44

**BELGIEN**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Belgium Government International Bond 2,750 % fällig am 22.04.2039		700	714	0,25
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap 3,250 % fällig am 12.01.2043		500	518	0,18
Summe Belgien			1.232	0,43

**KANADA**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Brookfield Property Finance ULC 7,125 % fällig am 13.02.2028 (e)	CAD	700	490	0,17

**STAATSEMISSIONEN**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
Canada Government International Bond 2,250 % fällig am 01.12.2029		6.400	4.521	1,56
Summe Kanada			5.011	1,73

**CHILE**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Chile Government International Bond 0,830 % fällig am 02.07.2031	€	2.100	1.808	0,63
3,500 % fällig am 15.04.2053	\$	400	299	0,10
Summe Chile			2.107	0,73

**ZYPERN**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Atrium Finance PLC 2,625 % fällig am 05.09.2027	€	1.100	875	0,30

**TSCHECHISCHE REPUBLIK**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S 3,750 % fällig am 20.06.2028		600	648	0,22

**DANEMARK**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Danske Bank A/S 4,750 % fällig am 21.06.2030		700	762	0,26
Pandora A/S 4,500 % fällig am 10.04.2028		400	435	0,15
TDC Net A/S 5,618 % fällig am 06.02.2030		1.900	2.036	0,71
Summe Dänemark			3.233	1,12

**FINNLAND**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Nokia Oyj 4,375 % fällig am 21.08.2031		500	538	0,18
Nordea Bank Abp 6,000 % fällig am 02.06.2026	€	1.800	2.249	0,78
Tornator Oyj 1,250 % fällig am 14.10.2026	€	200	197	0,07
Summe Finnland			2.984	1,03

BESCHREIBUNG  
 STAATSEMISSIONEN

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
Kundarahoitus Oyj 3,000 % fällig am 25.09.2028	€	500	\$ 540	0,19
Summe Finnland			3.524	1,22

**FRANKREICH**

**UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
<b>AXA S.A.</b>				
5,500 % fällig am 11.07.2043		400	437	0,15
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,250 % fällig am 29.06.2028		100	91	0,03
BNP Paribas S.A. 0,500 % fällig am 04.06.2026		2.900	2.945	1,02
1,675 % fällig am 30.06.2027	\$	500	441	0,15
4,625 % fällig am 25.02.2031 (c)(d)		1.000	716	0,25
CNP Assurances 2,000 % fällig am 27.07.2050	€	200	174	0,06
4,875 % fällig am 07.10.2030 (c)(d)	\$	800	598	0,21
Credit Agricole S.A. 0,125 % fällig am 09.12.2027	€	100	92	0,03
Forvia 2,750 % fällig am 15.02.2027		500	496	0,17
Ile-de-France Mobilites 0,400 % fällig am 28.05.2031		800	705	0,24
Schneider Electric SE 3,250 % fällig am 12.06.2028		1.200	1.294	0,45
SEB S.A. 1,375 % fällig am 16.06.2025		600	619	0,21
Societe Generale S.A. 0,625 % fällig am 02.12.2027		1.200	1.135	0,39
Summe Frankreich			9.743	3,36

**STAATSEMISSIONEN**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
Agence Francaise de Developpement 1,375 % fällig am 17.09.2024		1.000	1.061	0,37
3,500 % fällig am 25.02.2033		800	888	0,31
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.06.2044		850	550	0,19
Regie Autonome des Transports Parisiens 3,250 % fällig am 11.04.2033		1.400	1.514	0,52
Region of Ile de France 3,050 % fällig am 03.02.2033		200	215	0,07
Societe Du Grand Paris EPIC 0,300 % fällig am 25.11.2031		1.900	1.623	0,56
1,000 % fällig am 18.02.2070		100	45	0,02
3,500 % fällig am 25.05.2043		500	531	0,18
Societe Nationale SNCF S.A. 0,625 % fällig am 17.04.2030		800	730	0,25
3,125 % fällig am 02.11.2027		900	968	0,34
3,375 % fällig am 25.05.2033		800	874	0,30
Summe Frankreich			8.999	3,11
Summe Frankreich			18.742	6,47

**DEUTSCHLAND**

**UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
Amprion GmbH 3,450 % fällig am 22.09.2027		200	214	0,07
Commerzbank AG 3,000 % fällig am 14.09.2027		500	512	0,18
3,375 % fällig am 12.12.2025		700	757	0,26
Deutsche Bahn Finance GmbH 0,625 % fällig am 08.12.2050		50	28	0,01
3,250 % fällig am 19.05.2033		600	645	0,22
Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 23.02.2028		1.900	1.837	0,64
E.ON SE 3,875 % fällig am 12.01.2035		500	543	0,19
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028 (b)		100	93	0,03
1,375 % fällig am 07.06.2032		15.600	14.979	5,17
2,000 % fällig am 15.11.2029		10.400	10.702	3,70
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 1,000 % fällig am 26.05.2042		700	552	0,19

BESCHREIBUNG  
 ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
Schaeffler AG 3,375 % fällig am 12.10.2028	€	1.700	\$ 1.696	0,59
Vonovia SE 2,375 % fällig am 25.03.2032		1.600	1.424	0,49
ZF Finance GmbH 2,000 % fällig am 06.05.2027		800	762	0,26
2,250 % fällig am 03.05.2028		600	553	0,19
Summe Deutschland			35.297	12,19

**STAATSEMISSIONEN**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
<b>Bundesrepublik Deutschland</b>				
0,000 % fällig am 15.08.2031 (b)		1.400	1.266	0,43
<b>Land Nordrhein-Westfalen</b>				
0,000 % fällig am 12.10.2035 (b)		20	15	0,01
Summe Deutschland			1.281	0,44
Summe Deutschland			36.578	12,63

**HONGKONG**

**STAATSEMISSIONEN**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
Hong Kong Government International Bond 5,250 % fällig am 11.01.2053	\$	700	783	0,27

**INDIEN**

**UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
JSW Hydro Energy Ltd. 4,125 % fällig am 18.05.2031		1.176	993	0,34
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027		837	785	0,27
ReNew Wind Energy AP2 4,500 % fällig am 14.07.2028		1.700	1.450	0,50
Summe Indien			3.228	1,11

**IRLAND**

**UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
AIB Group PLC 2,875 % fällig am 30.05.2031	€	600	594	0,21
4,625 % fällig am 23.07.2029		1.300	1.394	0,48
Bank of Ireland Group PLC 5,000 % fällig am 04.07.2031 (a)		400	436	0,15
6,253 % fällig am 16.09.2026	\$	800	795	0,27
7,594 % fällig am 06.12.2032	£	600	731	0,25
Smurfit Kappa Treasury ULC 0,500 % fällig am 22.09.2029	€	1.000	885	0,31
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. 3,000 % fällig am 19.04.2051	\$	650	510	0,18
3,500 % fällig am 02.05.2052		1.200	956	0,33
Summe Irland			6.301	2,18

**ITALIEN**

**UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
Ferrovie dello Stato Italiane SpA 3,750 % fällig am 14.04.2027	€	1.200	1.288	0,44
UniCredit SpA 5,850 % fällig am 15.11.2027		2.200	2.459	0,85
Summe Italien			3.747	1,29

**STAATSEMISSIONEN**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,500 % fällig am 30.04.2045		1.050	709	0,25
4,000 % fällig am 30.10.2031		400	440	0,15
Summe Italien			1.149	0,40
Summe Italien			4.896	1,69

**JAPAN**

**UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT (000S)	% DES VERMÖGENS
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,848 % fällig am 19.07.2029		800	739	0,26
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig am 05.09.2027		1.300	1.380	0,48
Norinchukin Bank 2,080 % fällig am 22.09.2031	\$	1.000	804	0,28
4,867 % fällig am 14.09.2027		600	591	0,20

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
<b>NTT Finance Corp.</b> 0,399 % fällig am 13.12.2028 4,239 % fällig am 25.07.2025	€ 1.300 \$ 2.900	\$ 1.199 2.822	0,41 0,98		<b>CTP NV</b> 1,250 % fällig am 21.06.2029 Digital Intrepid Holding BV 0,625 % fällig am 15.07.2031	€ 2.000 1.500	\$ 1.585 1.139	0,55 0,39		<b>Caja Rural de Navarra SCC</b> 3,000 % fällig am 26.04.2027	€ 2.100	\$ 2.230	0,77	
<b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b> 2,472 % fällig am 14.01.2029	1.300	1.110	0,38		<b>DSV Finance BV</b> 0,500 % fällig am 03.03.2031	500	430	0,15						
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b> 2,800 % fällig am 10.03.2027	800	736	0,25		<b>EnBW International Finance BV</b> 3,625 % fällig am 22.11.2026	500	542	0,19						
		<u>9.381</u>	<u>3,24</u>		<b>Enel Finance International NV</b> 0,000 % fällig am 17.06.2027 (b) 1,375 % fällig am 12.07.2026 7,500 % fällig am 14.10.2032	600 \$ 1.000 500	563 883 555	0,19 0,31 0,17		<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				
					<b>ING Groep NV</b> 1,125 % fällig am 07.12.2028 4,875 % fällig am 16.05.2029 (c)(d)	£ 200 \$ 2.000	200 1.554	0,09 0,54		<b>Autonomous Community of Madrid</b> 3,596 % fällig am 30.04.2033	300	328	0,11	
		<u>10.293</u>	<u>3,55</u>		<b>JDE Peet's NV</b> 2,250 % fällig am 24.09.2031	1.000	775	0,27		<b>Spain Government International Bond</b> 1,000 % fällig am 30.07.2042	1.700	1.170	0,40	
					<b>LeasePlan Corp. NV</b> 0,250 % fällig am 23.02.2026 0,250 % fällig am 07.09.2026 1,375 % fällig am 07.03.2024 3,500 % fällig am 09.04.2025	€ 2.000 1.400 100 700	1.957 1.345 107 750	0,68 0,46 0,04 0,26		<b>Xunta de Galicia</b> 0,084 % fällig am 30.07.2027	50	47	0,02	
					<b>Nationale-Niederlanden Bank NV</b> 0,500 % fällig am 21.09.2028 1,875 % fällig am 17.05.2032	1.100 200	995 195	0,34 0,07		<b>Summe Spanien</b>		<u>7.390</u>	<u>2,55</u>	
					<b>NE Property BV</b> 2,000 % fällig am 20.01.2030	1.400	1.130	0,39		<b>SUPRANATIONAL</b>				
					<b>Sika Capital BV</b> 3,750 % fällig am 03.11.2026	400	434	0,15		<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
					<b>TenneT Holding BV</b> 4,500 % fällig am 28.10.2034	700	815	0,28		<b>Eurofima Europäische Gesellschaft für die Finanzierung von Eisenbahnmaterial</b> 0,000 % fällig am 28.07.2026 (b) 0,010 % fällig am 23.06.2028 0,150 % fällig am 10.10.2034 3,125 % fällig am 09.11.2031	100 2.000 500 800	98 1.849 392 868	0,03 0,64 0,14 0,30	
					<b>Thermo Fisher Scientific Finance BV</b> 0,000 % fällig am 18.11.2025 (b)	1.400	1.393	0,48		<b>Europäische Investitionsbank</b> 0,750 % fällig am 15.07.2027 1,500 % fällig am 15.06.2032 2,250 % fällig am 15.03.2030 3,750 % fällig am 14.02.2033	AUD 500 € 5.600 1.230 \$ 5.000	287 5.389 1.278 4.929	0,10 1,86 0,44 1,70	
					<b>VIA Outlets BV</b> 1,750 % fällig am 15.11.2028	1.100	965	0,33		<b>Europäische Union</b> 0,000 % fällig am 04.10.2030 (b) 0,300 % fällig am 04.11.2050 0,400 % fällig am 04.02.2037 2,625 % fällig am 04.02.2048 2,750 % fällig am 04.02.2033	€ 1.400 100 800 600 600	1.233 53 611 592 640	0,43 0,02 0,21 0,20 0,22	
					<b>Wabtec Transportation Netherlands BV</b> 1,250 % fällig am 03.12.2027	1.900	1.802	0,62		<b>Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung</b> 2,125 % fällig am 03.03.2025	\$ 1.000	953	0,33	
							<u>23.055</u>	<u>7,96</u>		<b>International Development Association</b> 0,750 % fällig am 21.09.2028	£ 1.450	1.468	0,51	
										<b>Summe Supranational</b>		<u>20.640</u>	<u>7,13</u>	
										<b>SCHWEDEN</b>				
										<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
										<b>Castellum AB</b> 0,750 % fällig am 04.09.2026	€ 1.100	989	0,34	
										<b>EQT AB</b> 0,875 % fällig am 14.05.2031	1.200	934	0,32	
										<b>Skandinaviska Enskilda Banken AB</b> 4,000 % fällig am 09.11.2026	300	323	0,11	
												<u>2.246</u>	<u>0,77</u>	
										<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				
										<b>Kommuninvest Sverige AB</b> 3,375 % fällig am 15.03.2027	200	219	0,08	
										<b>Svensk Exportkredit AB</b> 2,000 % fällig am 30.06.2027	1.100	1.135	0,39	
												<u>1.354</u>	<u>0,47</u>	
										<b>Summe Schweden</b>		<u>3.600</u>	<u>1,24</u>	
										<b>GROSSBRITANNIEN</b>				
										<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
										<b>Assura Financing PLC</b> 1,625 % fällig am 30.06.2033	£ 1.100	918	0,32	
										<b>Berkeley Group PLC</b> 2,500 % fällig am 11.08.2031	1.300	1.081	0,37	
										<b>British Land Co. PLC</b> 2,375 % fällig am 14.09.2029	1.400	1.359	0,47	
										<b>Burberry Group PLC</b> 1,125 % fällig am 21.09.2025	600	677	0,23	
										<b>Cadent Finance PLC</b> 4,250 % fällig am 05.07.2029 (a)	€ 100	109	0,04	
										<b>Chanel Ceres PLC</b> 1,000 % fällig am 31.07.2031	2.200	1.917	0,66	
										<b>Compass Group PLC</b> 4,375 % fällig am 08.09.2032	£ 1.900	2.221	0,77	

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Derwent London PLC 1,875 % fällig am 17.11.2031	£ 1.200	\$ 1.058	0,37	Bank of America Corp. 2,456 % fällig am 22.10.2025	\$ 100	\$ 95	0,03	NSTAR Electric Co. 3,100 % fällig am 01.06.2051	\$ 1.070	\$ 752	0,26
ENW Finance PLC 4,893 % fällig am 24.11.2032	400	469	0,16	4,134 % fällig am 12.06.2028	€ 1.400	1.514	0,52	4,950 % fällig am 15.09.2052	300	292	0,10
Grainger PLC 3,375 % fällig am 24.04.2028	700	736	0,25	6,204 % fällig am 10.11.2028	\$ 500	514	0,18	Oberlin College 2,874 % fällig am 01.10.2051	1.800	1.206	0,42
Land Securities Capital Markets PLC 4,875 % fällig am 15.09.2034	500	603	0,21	Boston Properties LP 2,450 % fällig am 01.10.2033	1.020	736	0,25	Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % fällig am 01.04.2053	400	393	0,14
Lendlease Europe Finance Plc 3,500 % fällig am 02.12.2033	327	272	0,09	6,500 % fällig am 15.01.2034	150	151	0,05	PacifiCorp 2,900 % fällig am 15.06.2052	600	375	0,13
London & Quadrant Housing Trust 2,000 % fällig am 31.03.2032	400	377	0,13	CBRE Services, Inc. 2,500 % fällig am 01.04.2031	1.370	1.103	0,38	PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % fällig am 26.01.2027	2.000	1.956	0,68
Marks & Spencer PLC 4,500 % fällig am 10.07.2027	300	338	0,12	CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % fällig am 01.04.2053	600	614	0,21	Public Service Co. of Colorado 2,700 % fällig am 15.01.2051	75	48	0,02
National Grid PLC 3,875 % fällig am 16.01.2029	€ 300	325	0,11	Community Preservation Corp. 2,867 % fällig am 01.02.2030	360	302	0,10	3,200 % fällig am 01.03.2050	425	301	0,10
NatWest Group PLC 2,057 % fällig am 09.11.2028	£ 1.200	1.244	0,43	Continental Wind LLC 6,000 % fällig am 28.02.2033	535	541	0,19	Public Service Electric & Gas Co. 4,650 % fällig am 15.03.2033	1.100	1.080	0,37
Santander UK Group Holdings PLC 2,896 % fällig am 15.03.2032	\$ 2.400	1.942	0,67	Crown Cork & Seal Co., Inc. 7,375 % fällig am 15.12.2026	725	750	0,26	Puget Sound Energy, Inc. 5,448 % fällig am 01.06.2053	540	544	0,19
Severn Trent Utilities Finance PLC 2,625 % fällig am 22.02.2033	£ 600	577	0,20	Entergy Louisiana LLC 4,750 % fällig am 15.09.2052	300	276	0,10	Solar Star Funding LLC 5,375 % fällig am 30.06.2035	156	153	0,05
South Eastern Power Networks PLC 1,750 % fällig am 30.09.2034	2.100	1.801	0,62	Farmers Exchange Capital 5,454 % fällig am 15.10.2054	30	26	0,01	Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	1.000	832	0,29
Standard Chartered PLC 0,800 % fällig am 17.11.2029	€ 1.800	1.606	0,56	Ford Motor Co. 3,250 % fällig am 12.02.2032	200	157	0,05	Southwestern Public Service Co. 3,150 % fällig am 01.05.2050	450	314	0,11
Travis Perkins PLC 3,750 % fällig am 17.02.2026	£ 1.100	1.258	0,43	6,100 % fällig am 19.08.2032	434	421	0,15	3,750 % fällig am 15.06.2049	400	307	0,11
Vodafone Group PLC 5,125 % fällig am 04.06.2081	\$ 950	691	0,24	Ford Motor Credit Co. LLC 6,800 % fällig am 12.05.2028	800	802	0,28	TerraForm Power Operating LLC 5,000 % fällig am 31.01.2028	1.650	1.521	0,53
Workspace Group PLC 2,250 % fällig am 11.03.2028	£ 400	373	0,13	Gap, Inc. 3,625 % fällig am 01.10.2029	1.250	885	0,31	Topaz Solar Farms LLC 5,750 % fällig am 30.09.2039	794	780	0,27
Zenith Finco PLC 6,500 % fällig am 30.06.2027	700	679	0,23	Georgia Power Co. 3,250 % fällig am 15.03.2051	800	565	0,19	UDR, Inc. 1,900 % fällig am 15.03.2033	900	659	0,23
		22.631	7,81	HAT Holdings LLC 6,000 % fällig am 15.04.2025	500	494	0,17	3,100 % fällig am 01.11.2034	150	120	0,04
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Host Hotels & Resorts LP 2,900 % fällig am 15.12.2031	700	551	0,19	Verizon Communications, Inc. 1,500 % fällig am 18.09.2030	4.110	3.250	1,12
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.07.2033	3.700	3.372	1,17	3,375 % fällig am 15.12.2029	600	513	0,18	5,050 % fällig am 09.05.2033	500	495	0,17
3,750 % fällig am 22.10.2053	800	905	0,31	3,500 % fällig am 15.09.2030	2.075	1.760	0,61	Wisconsin Electric Power Co. 4,750 % fällig am 30.09.2032	500	490	0,17
		4.277	1,48	Hudson Pacific Properties LP 3,950 % fällig am 01.11.2027	1.000	728	0,25	Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % fällig am 01.04.2033	600	594	0,20
Summe Großbritannien		26.908	9,29	5,950 % fällig am 15.02.2028	800	637	0,22	Wisconsin Public Service Corp. 2,850 % fällig am 01.12.2051	450	297	0,10
				Hyundai Capital America 5,800 % fällig am 26.06.2025	2.200	2.197	0,76			44.632	15,42
				Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032	700	487	0,17	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				2,650 % fällig am 15.11.2033	100	68	0,02	<b>New York Water &amp; Sewer System Revenue Bonds, (BABs), Series 2010</b>			
				MidAmerican Energy Co. 2,700 % fällig am 01.08.2052	950	602	0,21	5,724 % fällig am 15.06.2042	170	188	0,07
				3,650 % fällig am 01.08.2048	750	579	0,20	<b>New York Water &amp; Sewer System Revenue Bonds, Series 2010</b>			
				4,250 % fällig am 15.07.2049	400	341	0,12	5,882 % fällig am 15.06.2044	110	124	0,04
				Mississippi Power Co. 3,100 % fällig am 30.07.2051	900	607	0,21	<b>San Francisco, California Public Utilities Commission Water Revenue Bonds, Series 2020</b>			
				Moody's Corp. 2,000 % fällig am 19.08.2031	300	242	0,08	1,988 % fällig am 01.11.2031	255	208	0,07
				3,100 % fällig am 29.11.2061	840	554	0,19	2,825 % fällig am 01.11.2041	145	113	0,04
				MSCI, Inc. 3,250 % fällig am 15.08.2033	200	161	0,06	<b>State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020</b>			
				4,000 % fällig am 15.11.2029	100	91	0,03	2,154 % fällig am 01.07.2030	170	142	0,05
				<b>New York State Electric &amp; Gas Corp.</b> 2,150 % fällig am 01.10.2031	1.100	862	0,30			775	0,27
				NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	2.100	1.802	0,62	Summe USA		49.879	17,23
				Niagara Mohawk Power Corp. 5,783 % fällig am 16.09.2052	620	623	0,21	<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>			
				Northern States Power Co. 2,250 % fällig am 01.04.2031	600	502	0,17	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				2,600 % fällig am 01.06.2051	200	128	0,04	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	811	797	0,27
								Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	249.473	86,16

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOS	5,140 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 3.200	U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.02.2041	\$ (3.287)	\$ 3.200	\$ 3.201	1,11
	5,170	30.06.2023	03.07.2023	30.800	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.02.2042	(31.708)	30.800	30.813	10,63
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						\$ (34.995)	\$ 34.000	\$ 34.014	11,74

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	75	\$ 15	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	206	271	0,09
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	22	(46)	(0,02)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	2	(7)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	16	49	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	741	(1.223)	(0,42)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	186	(351)	(0,12)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	40	(42)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	55	(108)	(0,04)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	68	73	0,02
				<u>\$ (1.369)</u>	<u>(0,47)</u>
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				<u>\$ (1.369)</u>	<u>(0,47)</u>

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 700	\$ 61	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	08.07.2023	\$ 100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	3.200	(165)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,840	08.07.2051	100	31	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,943	15.06.2051	400	112	0,04
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 900	(57)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	08.07.2023	\$ 100	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,943	15.09.2023	400	4	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 1.800	(22)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	4.900	(59)	(0,02)
					<u>\$ (95)</u>	<u>(0,03)</u>
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					<u>\$ (95)</u>	<u>(0,03)</u>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	08.2023	€	459	\$	499	\$ 0	0,00		
	08.2023	\$	189	AUD	279	(3)	0,00		
	08.2023		355	€	331	7	0,00		
BPS	08.2023		339	¥	46.900	(13)	0,00		
	08.2023	€	1.560	\$	1.695	(11)	0,00		
	08.2023	\$	4.369	€	4.051	60	0,02		
BRC	08.2023	£	917	\$	1.150	(15)	(0,01)		
	08.2023	\$	644	£	521	18	0,01		
CBK	08.2023	CAD	6.658	\$	4.993	(42)	(0,01)		
	08.2023	€	3.753		4.067	(38)	(0,01)		
	08.2023	£	1.944		2.424	(48)	(0,02)		
JPM	08.2023	SEK	987		97	6	0,00		
	08.2023	\$	1.488	€	1.379	19	0,01		
	08.2023		488	£	394	13	0,00		
MBC	08.2023	€	18.161	\$	20.004	149	0,05		
	08.2023	£	9.768		12.371	(50)	(0,02)		
	08.2023	\$	394	£	317	9	0,00		
MYI	08.2023	€	106.662	\$	117.699	1.089	0,38		
	07.2023		5		6	0	0,00		
	07.2023	£	45		57	0	0,00		
RBC	07.2023	\$	2.587	£	2.050	20	0,01		
	08.2023	¥	5.053	\$	38	3	0,00		
	08.2023	£	1.895		2.394	(16)	(0,01)		
SCX	08.2023	\$	915	¥	126.800	(32)	(0,01)		
UAG	08.2023	£	8.556	\$	10.814	(65)	(0,02)		
						<u>\$ 1.396</u>	<u>\$ (336)</u>	<u>\$ 1.060</u>	<u>0,37</u>

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE**

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	\$ 82	AUD 126	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
GLM	07.2023	\$ 82	126	2	0	2	0,00
MBC	07.2023	60	92	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	AUD 37	\$ 25	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 21	AUD 32	1	0	1	0,00
	08.2023	25	37	0	0	0	0,00
				\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF 236	\$ 264	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 356	CHF 322	4	0	4	0,00
	08.2023	264	235	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CHF 9	\$ 9	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	\$ 254	CHF 228	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	CHF 244	\$ 272	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 229	CHF 206	1	0	1	0,00
	08.2023	272	243	1	0	1	0,00
				\$ 7	\$ (1)	\$ 6	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 107	\$ 116	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2023	\$ 60.540	€ 56.331	917	0	917	0,32
BPS	07.2023	€ 54.998	\$ 60.260	257	0	257	0,09
	07.2023	\$ 59.968	€ 55.775	882	0	882	0,30
	08.2023	59.780	54.482	0	(258)	(258)	(0,09)
CBK	07.2023	€ 55.738	\$ 60.581	0	(228)	(228)	(0,08)
	07.2023	\$ 1.325	€ 1.212	1	(4)	(3)	0,00
	08.2023	59.272	54.441	205	0	205	0,07
JPM	07.2023	€ 54.441	\$ 59.444	49	0	49	0,02
	07.2023	\$ 4.803	€ 4.492	98	0	98	0,03
	08.2023	59.527	54.441	0	(51)	(51)	(0,02)
MBC	07.2023	€ 76	\$ 81	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 2.989	€ 2.784	49	(1)	48	0,02
MYI	07.2023	€ 9.635	\$ 10.455	0	(57)	(57)	(0,02)
SOG	07.2023	\$ 59.362	€ 55.183	842	0	842	0,29
				\$ 3.300	\$ (602)	\$ 2.698	0,93

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 46	£ 37	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BPS	07.2023	£ 11	\$ 14	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 26.260	£ 21.231	732	0	732	0,25
BRC	07.2023	£ 216	\$ 275	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 60	£ 48	1	0	1	0,00
CBK	07.2023	£ 124	\$ 157	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 510	£ 402	2	0	2	0,00
JPM	07.2023	£ 21.830	\$ 27.602	0	(152)	(152)	(0,05)
	08.2023	\$ 27.607	£ 21.830	152	0	152	0,05
MBC	07.2023	£ 55	\$ 70	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 26.334	£ 21.272	710	0	710	0,25
MYI	07.2023	£ 694	\$ 861	0	(22)	(22)	(0,01)
	07.2023	\$ 26.061	£ 20.968	597	0	597	0,21
RBC	07.2023	3.947	3.102	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2023	£ 256	\$ 318	0	(7)	(7)	0,00
				\$ 2.195	\$ (184)	\$ 2.011	0,70

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	SEK 25.919	\$ 2.402	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BOA	07.2023	25.914	2.406	7	0	7	0,00
	07.2023	\$ 1.802	SEK 19.513	5	0	5	0,00
	08.2023	532	5.733	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	SEK 25.872	\$ 2.422	27	0	27	0,01
	07.2023	\$ 34	SEK 366	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	SEK 20.143	\$ 1.871	6	0	6	0,00
	07.2023	\$ 5.554	SEK 60.664	62	0	62	0,02
GLM	07.2023	SEK 25.876	\$ 2.422	26	0	26	0,01
MBC	07.2023	25	2	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 4.675	SEK 50.344	0	(14)	(14)	0,00
SCX	07.2023	SEK 20.305	\$ 1.886	6	0	6	0,00
	07.2023	\$ 4.685	SEK 50.679	6	0	6	0,00
UAG	07.2023	SEK 25.919	\$ 2.390	0	(10)	(10)	0,00
				\$ 147	\$ (24)	\$ 123	0,04

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$ 1.372	SGD 1.857	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	07.2023	SGD 97	\$ 72	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 25	SGD 34	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	1.251	1.690	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	SGD 75	\$ 55	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	1.760	1.302	2	0	2	0,00
	08.2023	\$ 1.302	SGD 1.758	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2023	198	268	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	SGD 20	\$ 15	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 1.348	SGD 1.824	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 3	\$ (5)	\$ (2)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 5.902	2,04
Summe Anlagen						\$ 287.911	99,44
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 1.613	0,56
Nettovermögen						\$ 289.524	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (d) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (e) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: null):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Brookfield Property Finance ULC	7,125 %	13.02.2028	09.02.2023	\$ 522	\$ 490	0,17

Barmittel in Höhe von 3.962 USD (31. Dezember 2022: 3.781 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 4.260 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 249.473	\$ 0	\$ 249.473
Pensionsgeschäfte	0	34.000	0	34.000
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	306	4.132	0	4.438
Summen	\$ 306	\$ 287.605	\$ 0	\$ 287.911

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 248.281	\$ 0	\$ 248.281
Pensionsgeschäfte	0	36.800	0	36.800
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2.683	(46)	0	2.637
<b>Summen</b>	<b>\$ 2.683</b>	<b>\$ 285.035</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 287.718</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 2	\$ 0	\$ 2	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	917	(700)	217	(522)	560	38
BPS	1.667	(1.540)	127	(3.021)	2.670	(351)
BRC	31	(20)	11	(6)	40	34
CBK	(42)	0	(42)	1.594	(1.510)	84
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	(1.016)	990	(26)
GLM	29	0	29	42	(110)	(68)
JPM	204	(350)	(146)	16	0	16
MBC	1.830	(1.800)	30	1.318	(1.270)	48
MYI	541	(350)	191	43	(20)	23
RBC	(19)	0	(19)	0	0	0
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	(113)	0	(113)
SCX	(25)	0	(25)	1.674	(1.560)	114
SOG	842	(630)	212	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(75)	0	(75)	86	0	86

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	76,41	73,76
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	9,75	11,04
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,04
Pensionsgeschäfte	11,74	12,57
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,47)	0,81
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate	2,04	0,03

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,31	0,31
Österreich	0,44	0,21
Belgien	0,43	0,40
Brasilien	k. A.	0,07
Kanada	1,73	1,62
Chile	0,73	0,70
Zypern	0,30	0,28
Tschechische Republik	0,22	k. A.
Dänemark	1,12	k. A.
Finnland	1,22	0,28
Frankreich	6,47	6,29
Deutschland	12,63	11,61
Hongkong	0,27	k. A.
Indien	1,11	1,30
Irland	2,18	1,49
Italien	1,69	1,97
Japan	3,55	3,29
Jersey, Kanalinseln	0,38	0,36
Luxemburg	3,01	2,89
Mauritius	0,12	0,97
Mexiko	0,31	0,29
Multinational	0,54	0,87
Niederlande	8,30	8,65
Norwegen	0,63	k. A.
Singapur	0,20	0,20



Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Südkorea	0,56	0,31
Spanien	2,55	2,01
Supranational	7,13	4,97
Schweden	1,24	1,20
Schweiz	k. A.	0,30
Großbritannien	9,29	8,79
USA	17,23	21,97
Jungferninseln (Britisch)	0,27	0,26
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,98
Pensionsgeschäfte	11,74	12,57
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,47)	0,81
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,03)	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	0,37	(1,53)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,67	1,56
Sonstige Aktiva und Passiva	0,56	1,69
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Australia Government International Bond			
0,250 % fällig am 21.11.2032 AUD	5.495	\$ 3.207	0,33
0,750 % fällig am 21.11.2027	4.186	2.706	0,28
3,000 % fällig am 20.09.2025	1.726	1.185	0,12
Summe Australien		7.098	0,73
<b>KANADA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Canadian Government Real Return Bond			
0,500 % fällig am 01.12.2050			
(a) CAD	241	145	0,01
4,250 % fällig am 01.12.2026			
(a)	2.849	2.320	0,24
Summe Kanada		2.465	0,25
<b>CAYMAN INSELN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Allegro CLO Ltd.			
6,425 % fällig am 16.10.2031	\$ 500	495	0,05
Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
6,350 % fällig am 15.01.2031	6.063	5.985	0,62
6,410 % fällig am 16.01.2030	938	933	0,10
BlueMountain CLO Ltd.			
6,453 % fällig am 22.10.2030	1.705	1.697	0,17
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.			
6,260 % fällig am 15.01.2031	584	579	0,06
Catamaran CLO Ltd.			
6,373 % fällig am 22.04.2030	2.470	2.455	0,25
Cedar Funding CLO Ltd.			
6,360 % fällig am 17.07.2031	700	694	0,07
CIFC Funding Ltd.			
6,352 % fällig am 27.04.2031	1.200	1.190	0,12
Dryden CLO Ltd.			
6,331 % fällig am 15.05.2031	700	694	0,07
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.			
6,373 % fällig am 15.09.2037	1.623	1.601	0,16
ICG U.S. CLO Ltd.			
6,353 % fällig am 22.07.2031	2.500	2.472	0,25
LCM LP			
6,290 % fällig am 20.07.2031	3.300	3.268	0,34
6,390 % fällig am 15.10.2031	1.200	1.185	0,12
Madison Park Funding Ltd.			
0,000 % fällig am 29.07.2030	395	394	0,04
6,103 % fällig am 22.04.2027	273	271	0,03
Magnetite Ltd.			
6,240 % fällig am 15.04.2031	295	293	0,03
Octagon Investment Partners Ltd.			
6,220 % fällig am 16.04.2031	3.500	3.466	0,36
Octagon Loan Funding Ltd.			
6,525 % fällig am 18.11.2031	2.500	2.477	0,26
OZLM Ltd.			
6,340 % fällig am 17.04.2031	2.759	2.721	0,28
6,400 % fällig am 20.01.2031	3.243	3.212	0,33
Regatta Funding Ltd.			
6,510 % fällig am 17.10.2030	3.879	3.862	0,40
Sound Point CLO Ltd.			
6,368 % fällig am 26.07.2031	1.500	1.474	0,15
6,370 % fällig am 21.01.2031	1.373	1.351	0,14
6,412 % fällig am 18.04.2031	2.200	2.162	0,22
TIAA CLO Ltd.			
6,450 % fällig am 20.07.2031	500	494	0,05
Voya CLO Ltd.			
6,351 % fällig am 14.07.2031	495	490	0,05
6,458 % fällig am 15.10.2030	1.829	1.823	0,19
		47.738	4,91
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Avolon Holdings Funding Ltd.			
2,528 % fällig am 18.11.2027	258	218	0,02
Summe Cayman Inseln		47.956	4,93

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS
<b>DÄNEMARK</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Jyske Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050 DKK	552	\$ 58	0,01
1,000 % fällig am 01.10.2053	6.301	612	0,06
1,500 % fällig am 01.10.2053	6.938	753	0,08
2,000 % fällig am 01.10.2053	2.778	317	0,03
2,500 % fällig am 01.10.2047	1	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
0,500 % fällig am 01.10.2043	6.645	737	0,08
1,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	3.900	397	0,04
2,000 % fällig am 01.10.2053	999	114	0,01
2,500 % fällig am 01.10.2047	3	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	30.724	3.233	0,33
1,000 % fällig am 01.10.2053	10	1	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	85.897	8.950	0,92
2,000 % fällig am 01.10.2053	6.073	668	0,07
2,500 % fällig am 01.10.2047	13	2	0,00
3,500 % fällig am 01.10.2053	14.485	1.939	0,20
Realkredit Danmark A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	13.858	1.460	0,15
1,000 % fällig am 01.10.2053	5.251	522	0,05
1,500 % fällig am 01.10.2053	17.747	1.913	0,20
2,000 % fällig am 01.10.2053	3.919	425	0,04
2,500 % fällig am 01.04.2047	12	2	0,00
		22.103	2,27
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Denmark Government International Bond			
0,100 % fällig am 15.11.2023			
(a)	13.470	1.976	0,21
Summe Dänemark		24.079	2,48
<b>FRANKREICH</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
France Government International Bond			
0,100 % fällig am 01.03.2025			
(a) €	19.962	21.387	2,20
0,100 % fällig am 25.07.2031			
(a)	9.707	10.297	1,06
0,100 % fällig am 25.07.2038			
(a)	7.005	7.119	0,73
2,100 % fällig am 25.07.2023			
(a)	34.194	37.264	3,83
Summe Frankreich		76.067	7,82
<b>IRLAND</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Ares European CLO			
3,837 % fällig am 15.10.2030	1.391	1.489	0,15
Ares European CLO DAC			
3,787 % fällig am 15.04.2030	688	737	0,08
4,050 % fällig am 20.04.2032	2.100	2.248	0,23
Armada Euro CLO DAC			
3,897 % fällig am 15.07.2031	500	533	0,06
Bain Capital Euro CLO DAC			
4,311 % fällig am 24.01.2033	1.300	1.391	0,14
Black Diamond CLO DAC			
4,060 % fällig am 20.01.2032	1.966	2.115	0,22
4,303 % fällig am 15.05.2032	2.600	2.775	0,29
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC			
1,050 % fällig am 15.01.2031	994	1.000	0,10
3,897 % fällig am 15.01.2031	2.088	2.232	0,23
BNPP AM Euro CLO DAC			
3,777 % fällig am 15.04.2031	1.600	1.707	0,18
Cairn CLO DAC			
3,957 % fällig am 15.10.2031	2.300	2.460	0,25
4,212 % fällig am 20.10.2028	8	9	0,00
Carlyle Euro CLO DAC			
3,877 % fällig am 15.01.2031	2.190	2.339	0,24
4,213 % fällig am 15.08.2032	900	960	0,10
CVC Cordatus Loan Fund DAC			
4,305 % fällig am 26.08.2032	500	534	0,06
Dryden Euro CLO DAC			
4,073 % fällig am 15.05.2032	1.285	1.366	0,14
4,183 % fällig am 15.05.2034	2.400	2.562	0,26
Harvest CLO DAC			
1,040 % fällig am 15.07.2031	700	696	0,07
3,937 % fällig am 15.07.2031	1.400	1.491	0,15
4,250 % fällig am 26.06.2030	1.418	1.516	0,16

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS
Invesco Euro CLO DAC			
4,097 % fällig am 15.07.2032	€ 2.600	\$ 2.768	0,28
Jubilee CLO DAC			
4,326 % fällig am 15.12.2029	931	1.004	0,10
Laurelin DAC			
3,920 % fällig am 20.10.2031	1.200	1.286	0,13
Madison Park Euro Funding DAC			
3,977 % fällig am 15.07.2032	700	745	0,08
Man GLG Euro CLO DAC			
4,047 % fällig am 15.01.2030	110	118	0,01
Oak Hill European Credit Partners DAC			
3,940 % fällig am 20.10.2031	1.100	1.169	0,12
OCP Euro CLO DAC			
4,091 % fällig am 22.09.2034	2.600	2.763	0,28
Palmer Square European Loan Funding DAC			
3,897 % fällig am 15.10.2031	844	903	0,09
Rockford Tower Europe CLO DAC			
4,577 % fällig am 20.12.2031	2.518	2.696	0,28
Segovia European CLO DAC			
4,080 % fällig am 20.07.2032	2.300	2.445	0,25
Tikehau CLO DAC			
4,144 % fällig am 04.08.2034	2.600	2.772	0,29
Toro European CLO DAC			
4,133 % fällig am 15.02.2034	3.700	3.929	0,40
		52.758	5,42
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
European Loan Conduit DAC			
4,358 % fällig am 17.02.2030	573	613	0,06
Summe Irland		53.371	5,48
<b>ITALIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			
0,400 % fällig am 15.05.2030 (a)	18.499	18.462	1,90
1,400 % fällig am 26.05.2025 (a)	33.783	36.495	3,75
2,350 % fällig am 15.09.2024 (a)	26.289	28.868	2,97
2,550 % fällig am 15.09.2041 (a)	1.464	1.766	0,18
2,600 % fällig am 15.09.2023 (a)	11.890	12.969	1,33
Summe Italien		98.560	10,13
<b>JAPAN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Japan Government International Bond			
0,005 % fällig am			
10.03.2031 (a)	¥ 348.863	2.589	0,27
0,100 % fällig am 10.09.2024 (a)	938.960	6.678	0,69
0,100 % fällig am 10.03.2025 (a)	1.020.895	7.293	0,75
0,100 % fällig am 10.03.2026 (a)	773.102	5.603	0,57
0,100 % fällig am 10.03.2028 (a)	1.337.314	9.752	1,00
0,100 % fällig am 10.03.2029 (a)	4.239.309	31.047	3,19
Summe Japan		62.962	6,47
<b>NEUSEELAND</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
New Zealand Government International Bond			
2,000 % fällig am 20.09.2025 NZD	3.147	1.925	0,20
<b>PERU</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Peru Government International Bond			
5,940 % fällig am 12.02.2029 PEN	400	108	0,01
<b>SPANIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
5,875 % fällig am			
24.09.2023 (c)(d)	€ 400	433	0,04
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Spain Government International Bond			
0,150 % fällig am			
30.11.2023 (a)	16.725	18.128	1,86
0,500 % fällig am 30.04.2030	2.500	2.279	0,24

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Commodity Real Return Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
0,650 % fällig am 30.11.2027 (a)	€ 26.866	\$ 28.789	2,96	Home Equity Asset Trust 6,005 % fällig am 25.08.2034	\$ 98	\$ 96	0,01	5,367 % fällig am 20.07.2046 ^	\$ 8	\$ 7	0,00
0,700 % fällig am 30.11.2033 (a)	1.324	1.382	0,14	6,170 % fällig am 25.03.2035	1.465	1.383	0,14	5,530 % fällig am 25.09.2046 ^	8	7	0,00
Summe Spanien		50.578	5,24	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 5,290 % fällig am 25.11.2036	661	594	0,06	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 3,611 % fällig am 25.09.2047 ^	5	5	0,00
<b>SCHWEDEN</b>				Lehman XS Trust 7,450 % fällig am 25.12.2037	826	837	0,09	5,790 % fällig am 25.03.2035	63	59	0,01
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Mid-State Capital Corp. Trust 5,787 % fällig am 15.10.2040	79	77	0,01	5,910 % fällig am 25.09.2034	1	1	0,00
Sweden Government International Bond 0,125 % fällig am 01.06.2026	SEK 3.059	275	0,03	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,810 % fällig am 25.01.2035	331	320	0,03	GreenPoint Mortgage Funding Trust 5,590 % fällig am 25.06.2045	69	65	0,01
0,125 % fällig am 01.12.2027	15.965	1.428	0,15	6,125 % fällig am 25.07.2034	139	134	0,01	GSR Mortgage Loan Trust 4,070 % fällig am 25.09.2035	2	2	0,00
1,000 % fällig am 01.06.2025	124.211	11.427	1,17	New Century Home Equity Loan Trust 5,915 % fällig am 25.02.2035	472	431	0,04	4,485 % fällig am 25.06.2034	4	3	0,00
Summe Schweden		13.130	1,35	Option One Mortgage Loan Trust 5,690 % fällig am 25.01.2036	1.700	1.517	0,16	4,660 % fällig am 25.07.2035	38	36	0,00
<b>SCHWEIZ</b>				Renaissance Home Equity Loan Trust 6,350 % fällig am 25.11.2034	184	152	0,02	HarborView Mortgage Loan Trust 6,057 % fällig am 20.06.2035	185	167	0,02
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Saxon Asset Securities Trust 5,460 % fällig am 25.09.2037	239	226	0,02	Impac CMB Trust 6,050 % fällig am 25.10.2033	1	1	0,00
UBS Group AG 2,593 % fällig am 11.09.2025	\$ 600	572	0,06	5,585 % fällig am 25.09.2036	3.000	2.750	0,28	IndyMac Mortgage Loan Trust 5,630 % fällig am 25.07.2035	1.280	1.201	0,12
4,177 % fällig am 16.01.2026	€ 400	430	0,04	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 5,870 % fällig am 25.10.2035	1.495	1.198	0,12	5,790 % fällig am 25.07.2045	3	2	0,00
Summe Schweiz		1.002	0,10			17.899	1,84	JPMorgan Mortgage Trust 4,111 % fällig am 25.04.2035	19	18	0,00
<b>GROSSBRITANNIEN</b>								4,356 % fällig am 25.08.2035	6	6	0,00
<b>NON-AGENCY-MBS</b>								Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 5,633 % fällig am 15.12.2030	1	1	0,00
Great Hall Mortgages PLC 5,152 % fällig am 18.03.2039	£ 6	8	0,00	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 5,840 % fällig am 25.08.2036	3.500	3.292	0,34
5,172 % fällig am 18.06.2038	6	7	0,00	Broadcom, Inc. 3,137 % fällig am 15.11.2035	1.459	1.119	0,12	New Residential Mortgage Loan Trust 4,500 % fällig am 25.05.2058	428	409	0,04
Polaris PLC 5,640 % fällig am 23.10.2059	3.456	4.363	0,45	Lehman Brothers Holdings, Inc. 7,875 % fällig am 08.05.2018 ^	£ 100	1	0,00	Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates 6,950 % fällig am 25.04.2035	500	480	0,05
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,635 % fällig am 20.10.2051	835	1.063	0,11			1.120	0,12	Regal Trust 3,910 % fällig am 29.09.2031	6	5	0,00
Summe Großbritannien		5.441	0,56	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 6,500 % fällig am 25.03.2032	6	6	0,00
<b>AKTIEN</b>				American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010 7,734 % fällig am 15.02.2033	\$ 200	237	0,03	Sequoia Mortgage Trust 4,601 % fällig am 20.04.2035	17	16	0,00
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				Bay Area Toll Authority, California Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 6,918 % fällig am 01.04.2040	600	708	0,07	5,557 % fällig am 20.07.2036	505	433	0,04
Nationwide Building Society 10,250 %	1.606	235	0,02	California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009 7,300 % fällig am 01.10.2039	500	605	0,06	5,846 % fällig am 19.10.2026	3	2	0,00
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				7,500 % fällig am 01.04.2034	100	122	0,01	Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,726 % fällig am 19.07.2034	2	1	0,00
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2024	£ 17.538	21.868	2,25	7,550 % fällig am 01.04.2039	200	252	0,03	5,806 % fällig am 19.10.2034	8	7	0,00
0,125 % fällig am 22.03.2026 (a)	175	214	0,02	Los Angeles Department of Water & Power, California Revenue Bonds, Series 2010 5,516 % fällig am 01.07.2027	500	511	0,05	5,846 % fällig am 19.03.2034	6	6	0,00
0,125 % fällig am 10.08.2028 (a)	4.470	5.467	0,56	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 5,508 % fällig am 01.08.2037	200	208	0,02	Towd Point Mortgage Trust 2,750 % fällig am 25.10.2056	264	261	0,03
0,125 % fällig am 10.08.2041 (a)	4.524	5.028	0,52	5,770 % fällig am 15.03.2039	100	105	0,01	3,250 % fällig am 25.03.2058	524	500	0,05
1,250 % fällig am 22.11.2027 (a)	40.705	52.277	5,37	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 5,376 % fällig am 25.06.2042	1	1	0,00
2,500 % fällig am 17.07.2024	23.479	30.455	3,13	Banc of America Funding Trust 4,496 % fällig am 20.09.2034	7	6	0,00	5,770 % fällig am 25.01.2045	10	10	0,00
Summe Großbritannien		115.309	11,85	BCAP LLC Trust 5,250 % fällig am 26.04.2037	190	111	0,01	5,890 % fällig am 25.01.2045	52	51	0,01
<b>USA</b>				Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,553 % fällig am 25.09.2034	52	48	0,01	5,930 % fällig am 25.10.2044	154	142	0,02
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				3,887 % fällig am 25.05.2047 ^	6	5	0,00				
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 6,200 % fällig am 25.12.2033	\$ 786	766	0,08	4,033 % fällig am 25.11.2034	4	4	0,00				
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 6,110 % fällig am 25.10.2035	1.300	1.164	0,12	4,033 % fällig am 25.01.2035	21	19	0,00				
Asset-Backed Funding Certificates Trust 5,290 % fällig am 25.10.2036	2.300	2.100	0,22	4,439 % fällig am 25.02.2034	7	6	0,00				
5,750 % fällig am 25.10.2034	103	103	0,01	Bear Stearns ALT-A Trust 4,116 % fällig am 25.08.2036 ^	12	6	0,00				
CIT Mortgage Loan Trust 6,500 % fällig am 25.10.2037	54	54	0,01	5,044 % fällig am 25.10.2033	7	7	0,00				
Citigroup Mortgage Loan Trust 5,440 % fällig am 25.09.2036	458	433	0,05	Chase Mortgage Finance Trust 4,086 % fällig am 25.03.2037 ^	4	4	0,00				
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates 6,095 % fällig am 25.10.2034	291	275	0,03	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 5,500 % fällig am 25.08.2034	0	0	0,00				
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 5,840 % fällig am 25.10.2035 ^	800	716	0,07	6,430 % fällig am 25.09.2035	1	1	0,00				
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 6,110 % fällig am 25.02.2036	1.906	1.858	0,19	Countrywide Alternative Loan Trust 3,940 % fällig am 25.02.2037 ^	6	5	0,00				
Ellington Loan Acquisition Trust 6,250 % fällig am 25.05.2037	599	574	0,06	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				Fannie Mae 5,188 % fällig am 01.11.2034	157	156	0,02
First Franklin Mortgage Loan Trust 5,460 % fällig am 25.07.2036	150	141	0,01					5,720 % fällig am 25.09.2036	1	1	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				0,375 % fällig am 15.01.2027	\$ 27.323	\$ 25.643	2,63	5,400 % fällig am 21.07.2023	\$ 1.000	\$ 997	0,10
4,000 % fällig am 01.08.2053	\$ 62.714	\$ 58.910	6,05	0,375 % fällig am 15.07.2027		37.299	3,83	5,400 % fällig am 24.07.2023	3.200	3.189	0,33
4,500 % fällig am 01.08.2053	31.500	30.302	3,12	(e)(f)	39.777			Virginia Electric & Power Co.			
				0,500 % fällig am 15.04.2024	(e)	30.462	3,05	5,330 % fällig am 13.07.2023	400	399	0,04
		91.647	9,42	0,500 % fällig am 15.01.2028		34.061	3,27	Summe kurzfristige Instrumente		4.585	0,47
<b>US-SCHATZobligationen</b>											
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (a)											
0,125 % fällig am 15.07.2024				0,625 % fällig am 15.01.2026		20.833	2,04				
(e)	38.066	36.929	3,79	0,750 % fällig am 15.07.2028		24.203	2,36	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.389.961	142,83	
0,125 % fällig am 15.10.2024	(e)	75.543	7,49	0,750 % fällig am 15.02.2045		773	0,07				
(e)				0,875 % fällig am 15.02.2047		890	0,08				
0,125 % fällig am 15.04.2025	(e)	36.167	3,54	1,375 % fällig am 15.02.2044		2.993	2,82				
(e)(f)				1,500 % fällig am 15.02.2053		2.143	2,08				
0,125 % fällig am 15.10.2025	(e)	28.523	2,78	1,625 % fällig am 15.10.2027	(e)(f)	95.275	9,65	<b>AKTIEN</b>			
(e)(f)				1,750 % fällig am 15.01.2028		5.137	0,52	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
0,125 % fällig am 15.04.2026	(e)	51.733	4,99	2,375 % fällig am 15.01.2025		17.217	1,75	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
(e)				2,500 % fällig am 15.01.2029		1.708	0,18	PIMCO Select Funds plc -			
0,125 % fällig am 15.07.2026	(e)	6.972	0,67	3,875 % fällig am 15.04.2029		1.201	0,14	PIMCO US Dollar Short-			
(e)								Term Floating NAV			
0,125 % fällig am 15.10.2026	(e)	128.648	12,36					Fund (c)	12.345	123	0,01
0,125 % fällig am 15.07.2031	(e)	1.154	0,11					Summe Investmentfonds	\$ 123	0,01	
0,250 % fällig am 15.01.2025	(e)	44.436	4,38								
0,250 % fällig am 15.07.2029	(e)	1.909	0,18								
0,375 % fällig am 15.07.2025		19.932	1,96								
				Summe USA		824.657	84,74				
						703.818	72,32				
						824.657	84,74				
				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
				<b>COMMERCIAL PAPER</b>							
				Ameren Corp.							

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettvermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 2.394	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (2.442)	\$ 2.394	\$ 2.394	0,25
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (2.442)	\$ 2.394	\$ 2.394	0,25

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	69	\$ 27	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	63	26	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	326	(486)	(0,05)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	16	(17)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	339	376	0,04
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	731	514	0,05
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	114	(215)	(0,02)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	15	12	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	1.208	1.119	0,12
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	48	(177)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	339	229	0,03
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	1.107	2.341	0,24
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.032	(2.044)	(0,21)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	520	174	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	548	(62)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	111	200	0,02
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	4	4	0,00
				\$ 2.021	0,21

**VERKAUFSoPTIONEN****OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 113,000	21.07.2023	153	\$ (108)	\$ (170)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 1.851	0,19

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Commodity Real Return Fund (Forts.)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 200	\$ 13	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.03.2042	£ 7.200	\$ 587	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300	20.09.2027	¥ 74.880	0	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.12.2031	2.466.000	(104)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2047	\$ 1.750	391	0,04
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,428	20.12.2047	400	60	0,01
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,478	20.12.2047	1.115	155	0,02
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,499	20.12.2047	570	79	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,840	21.11.2028	13.800	1.318	0,14
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	5.000	(1.403)	(0,14)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	21.11.2053	2.800	(792)	(0,08)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	18.600	406	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	41.800	(751)	(0,08)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	4.400	26	0,00
Zahlung	3-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	9.900	(252)	(0,03)
Erhalt	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	NZD 900	27	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.07.2023	\$ 5.000	(20)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 1.200	565	0,06
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	04.11.2052	900	413	0,04
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	950	493	0,05
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	1.600	731	0,08
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	200	(9)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	4.900	(520)	(0,05)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	2.400	(250)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	2.100	(220)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	4.700	(441)	(0,05)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	2.100	(197)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	5.800	(74)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,879	15.08.2032	13.400	(165)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	91.100	662	0,07
Zahlung	CPTFEMU	1,066	15.02.2024	3.800	(565)	(0,06)
Zahlung	CPTFEMU	1,168	15.03.2024	3.300	(496)	(0,05)
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	4.000	(891)	(0,09)
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	60	(18)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,421	15.05.2052	700	(115)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	11.900	381	0,04
Zahlung	CPTFEMU	2,488	15.05.2037	4.790	(365)	(0,04)
Erhalt	CPTFEMU	2,570	15.06.2032	8.800	340	0,03
Zahlung	CPTFEMU	2,580	15.03.2052	500	(66)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	2,590	15.03.2052	4.940	(601)	(0,06)
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	10.600	496	0,05
Zahlung	CPTFEMU	2,680	15.04.2053	2.100	(31)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,700	15.04.2053	1.100	(15)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,520	15.09.2024	13.600	(174)	(0,02)
Zahlung	CPTFEMU	3,720	15.09.2024	5.000	(34)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,850	15.09.2024	19.500	(121)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	4,375	15.06.2024	100.000	939	0,10
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	\$ 1.000	144	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	3.000	414	0,04
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	700	(93)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	3.600	(459)	(0,05)
Zahlung	CPURNSA	2,155	17.10.2027	1.900	(216)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,311	24.02.2031	5.100	548	0,06
Zahlung	CPURNSA	2,335	05.02.2028	2.680	(247)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	1.790	(156)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,360	09.05.2028	2.690	(232)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	2.750	(236)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,419	05.03.2026	2.300	215	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,573	26.08.2028	1.100	68	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,645	10.09.2028	1.500	81	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,690	01.06.2026	2.100	157	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	1.270	95	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	3.100	226	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	1.400	99	0,01
Erhalt	FRCPXTOB	1,030	15.03.2024	€ 3.300	316	0,03
Zahlung	FRCPXTOB	1,910	15.01.2038	390	(75)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,100	15.06.2031	£ 2.300	(523)	(0,05)
Zahlung	UKRPI	3,400	15.06.2030	1.610	(437)	(0,04)
Zahlung	UKRPI	3,515	15.02.2041	2.700	(445)	(0,05)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	UKRPI	3,530 %	15.10.2031	£ 540	\$ (150)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	2.700	(552)	(0,06)
Zahlung	UKRPI	3,580	15.03.2036	2.000	(485)	(0,05)
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031	300	(54)	(0,01)
Erhalt	UKRPI	4,125	15.09.2032	590	30	0,00
Erhalt	UKRPI	4,130	15.09.2032	2.610	131	0,01
Erhalt	UKRPI	4,143	15.10.2032	2.300	112	0,01
Erhalt	UKRPI	4,480	15.09.2023	1.500	252	0,03
Erhalt	UKRPI	5,200	15.06.2024	1.200	78	0,01
Erhalt	UKRPI	6,600	15.05.2024	4.200	255	0,03
					\$ (1.760)	(0,18)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (1.747)</b>	<b>(0,18)</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

##### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,237 %	17.11.2023	10.300	\$ 639	\$ 2.260	0,23

##### VERKAUFSOPTIONEN

##### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximalbetrag [[Fertiger Index/anfänglicher Index - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.200	\$ (55)	\$ (68)	(0,01)

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	24.700	\$ (70)	\$ (28)	0,00
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,340	17.11.2023	50.700	(639)	(3.740)	(0,39)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420	21.09.2023	115.100	(655)	(492)	(0,05)
JPM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	12.09.2023	34.500	(96)	(40)	0,00
							\$ (1.460)	\$ (4.300)	(0,44)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

##### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens	
DUB	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 1.500	\$ (104)	\$ 104	\$ 0	0,00	
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	1.800	(94)	93	(1)	0,00	
						\$ (198)	\$ 197	\$ (1)	0,00

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Commodity Real Return Fund (Forts.)

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998 %	20.06.2028	ILS 890	\$ 0	\$ (18)	\$ (18)	0,00
BRC	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	810	0	(17)	(17)	0,00
CKL	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	750	(2)	(13)	(15)	0,00
GLM	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	1.430	0	(27)	(27)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	610	0	(13)	(13)	0,00
HUS	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	480	0	(10)	(10)	0,00
						\$ (2)	\$ (98)	\$ (100)	(0,01)

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BPS	Erhalt	BCOMTR Index	151.171	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 34.887	15.02.2024	\$ 148	\$ (839)	\$ (691)	(0,07)
	Erhalt	BCOMTR1 Index	1.368.505	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	120.736	15.02.2024	0	(2.378)	(2.378)	(0,24)
CBK	Erhalt	BCOMF1TC Index	348.889	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	40.165	15.02.2024	0	(830)	(830)	(0,09)
	Erhalt	BCOMTR Index	55.650	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	12.843	15.02.2024	0	(249)	(249)	(0,03)
	Erhalt	CIXBSTR3 Index	693.551	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	176.505	15.02.2024	0	(3.573)	(3.573)	(0,37)
CIB	Erhalt	BCOMTR Index	179.997	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	41.539	15.02.2024	0	(818)	(818)	(0,08)
FBF	Erhalt	BCOMTR Index	83.595	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	19.292	15.02.2024	0	(380)	(380)	(0,04)
GST	Erhalt	BCOMF1TC Index	235.692	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	87.988	15.02.2024	0	(1.818)	(1.818)	(0,19)
	Erhalt	BCOMTR Index	1.017.108	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	234.725	15.02.2024	0	(4.622)	(4.622)	(0,47)
JPM	Erhalt	BCOMF1TC Index	315.223	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	61.548	15.02.2024	0	(1.272)	(1.272)	(0,13)
	Erhalt	BCOMTR Index	90.706	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	20.933	15.02.2024	0	(412)	(412)	(0,04)
	Erhalt	JMABDEWU Index	494.170	0,053 %	79.161	15.02.2024	0	541	541	0,06
	Erhalt	JMABNIUS Index	164.986	0,000	29.494	15.02.2024	0	(167)	(167)	(0,02)
MAC	Erhalt	PIMCODBU Index	539.651	0,160	84.217	15.09.2023	0	(856)	(856)	(0,09)
MEI	Erhalt	BCOMTR Index	116.009	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	26.772	15.02.2024	0	(527)	(527)	(0,05)
SOG	Erhalt	BCOMTR Index	9.776	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	2.256	15.02.2024	0	(44)	(44)	0,00
							\$ 148	\$ (18.244)	\$ (18.096)	(1,85)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AZD	07.2023	AUD	\$	326	213	\$ (4)	0,00
	07.2023	\$	AUD	907	1.367	0	0,00
	08.2023	AUD	\$	1.367	908	(3)	0,00
BOA	07.2023	DKK	€	2.074	1.354	(26)	0,00
	07.2023	DKK	€	194.210	28.045	(412)	(0,04)
	07.2023	NZD	€	823	500	(5)	0,00
	07.2023	\$	DKK	11.728	79.740	(44)	0,00
	07.2023	€	€	552	510	5	0,00
	08.2023	DKK	\$	79.606	11.728	44	0,00
BPS	07.2023	€	€	2.909	3.171	(3)	0,00
	07.2023	¥	€	8.376.035	60.288	2.335	0,24
	07.2023	NZD	€	74	45	(1)	0,00
	07.2023	\$	AUD	647	977	3	0,00
	07.2023	€	€	288.740	263.534	6	(0,13)
	08.2023	AUD	\$	977	648	(3)	0,00
	08.2023	€	€	261.997	287.474	1.243	0,13
BRC	09.2023	ILS	€	87	24	1	0,00
CBK	07.2023	CAD	€	3.615	2.653	(79)	(0,01)
	07.2023	€	€	1.446	1.560	(17)	0,00
	07.2023	¥	€	88.700	628	14	0,00
	07.2023	\$	€	922	843	(2)	0,00
GLM	07.2023	DKK	DKK	2.347	16.270	37	0,00
JPM	07.2023	AUD	\$	1.993	1.303	(24)	0,00
	07.2023	\$	DKK	1.662	11.360	(4)	0,00
	08.2023	¥	¥	20.157	2.882.631	(213)	(0,02)
	08.2023	¥	\$	2.870.382	20.157	213	0,02
	09.2023	ILS	€	83	23	1	0,00
	09.2023	PEN	€	3.744	1.017	(10)	0,00



Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
MBC	07.2023	£	96.657	\$	119.648	\$	0	(3.237)	\$	(3.237)	(0,33)		
	07.2023	SEK	1.796	\$	167	\$	1	0	\$	1	0,00		
	07.2023	\$	1.083	€	1.011		21	0		21	0,00		
MYI	07.2023	£	5	\$	7		0	0		0	0,00		
	07.2023	SEK	138.692		12.920		80	0		80	0,01		
	07.2023	\$	9.688	DKK	66.084		0	(5)		(5)	0,00		
	07.2023		821	€	754		1	0		1	0,00		
	07.2023		38	£	30		0	0		0	0,00		
	07.2023		13.033	SEK	140.706		0	(6)		(6)	0,00		
	08.2023	DKK	65.973	\$	9.688		5	0		5	0,00		
	08.2023	SEK	140.532		13.033		6	0		6	0,00		
SCX	07.2023	AUD	2.813		1.838		0	(34)		(34)	0,00		
	07.2023	NZD	2.144		1.302		0	(12)		(12)	0,00		
	07.2023	\$	1.332	AUD	2.007		4	0		4	0,00		
	07.2023		40	€	37		0	0		0	0,00		
	07.2023		287	£	228		2	0		2	0,00		
	08.2023	AUD	2.007	\$	1.333		0	(4)		(4)	0,00		
SOG	07.2023		2.152		1.408		0	(24)		(24)	0,00		
	07.2023	€	260.006		279.699		0	(3.967)		(3.967)	(0,41)		
TOR	07.2023	AUD	1.139		745		0	(13)		(13)	0,00		
	07.2023	\$	1.631	AUD	2.470		13	0		13	0,00		
	07.2023		2.733	CAD	3.616		2	(2)		(2)	0,00		
	07.2023		122.822	£	96.657		63	0		63	0,01		
	07.2023		38.762	¥	5.581.716		0	(143)		(143)	(0,02)		
	07.2023		1.852	NZD	3.042		11	0		11	0,00		
	08.2023	AUD	2.470	\$	1.633		0	(13)		(13)	0,00		
	08.2023	CAD	3.614		2.733		2	(2)		(2)	0,00		
	08.2023	£	96.657		122.849		0	(61)		(61)	(0,01)		
	08.2023	¥	5.568.044		38.762		145	0		145	0,01		
	08.2023	NZD	3.042		1.852		0	(11)		(11)	0,00		
UAG	07.2023	AUD	261		171		0	(3)		(3)	0,00		
	07.2023	\$	2.629	AUD	3.937		6	(14)		(8)	0,00		
	08.2023	AUD	3.937	\$	2.631		13	(5)		8	0,00		
	09.2023	ILS	72		20		1	0		1	0,00		
							\$	4.287	\$	(9.637)	\$	(5.350)	(0,55)

## ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
BOA	07.2023	€	1.350	\$	1.460	\$	0	(13)	\$	(13)	0,00		
	07.2023	\$	112.515	€	104.694		1.707	0		1.707	0,17		
BPS	07.2023	€	100.729	\$	110.360		469	(4)		465	0,05		
	07.2023	\$	111.227	€	103.466		1.656	0		1.656	0,17		
	08.2023		98.812		90.055		0	(428)		(428)	(0,04)		
CBK	07.2023	€	92.343	\$	100.383		7	(371)		(364)	(0,04)		
	07.2023	\$	4.918	€	4.496		0	(13)		(13)	0,00		
	08.2023		91.575		84.111		316	0		316	0,03		
JPM	07.2023	€	88.670	\$	96.618		80	0		80	0,01		
	07.2023	\$	13.010	€	12.168		266	0		266	0,03		
	08.2023		96.954		88.670		0	(83)		(83)	(0,01)		
MBC	07.2023	€	6.466	\$	6.934		0	(120)		(120)	(0,01)		
	07.2023	\$	2.526	€	2.316		5	(4)		1	0,00		
MYI	07.2023	€	25.263	\$	27.608		46	0		46	0,00		
SOG	07.2023	\$	111.303	€	103.466		1.580	0		1.580	0,16		
UAG	07.2023	€	16.025	\$	17.197		0	(287)		(287)	(0,03)		
							\$	6.132	\$	(1.323)	\$	4.809	0,49

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
BOA	07.2023	£	2.883	\$	3.664	\$	0	(1)	\$	(1)	0,00		
	07.2023	\$	14.295	£	11.546		387	(3)		384	0,04		
BPS	07.2023	£	10.134	\$	12.906		57	(34)		23	0,00		
	07.2023	\$	416	£	327		0	(1)		(1)	0,00		
CBK	07.2023	£	530	\$	671		0	(3)		(3)	0,00		
	07.2023	\$	713	£	558		0	(3)		(3)	0,00		
JPM	07.2023	£	7.179	\$	9.077		0	(50)		(50)	(0,01)		
	08.2023	\$	9.079	£	7.179		50	0		50	0,01		
MBC	07.2023	£	287	\$	357		0	(7)		(7)	0,00		
	07.2023	\$	14.062	£	11.359		380	0		380	0,04		
MYI	07.2023		14.110		11.353		323	0		323	0,03		
							\$	1.197	\$	(102)	\$	1.095	0,11

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Commodity Real Return Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
GLM	07.2023	SGD	\$	64	\$ 1	\$ 1	0,00
	07.2023	\$	SGD	119	0	0	0,00
JPM	07.2023	SGD	\$	297	0	0	0,00
	07.2023	\$	SGD	410	0	0	0,00
	08.2023			402	0	0	0,00
MBC	07.2023			379	(1)	(1)	0,00
	08.2023	SGD	\$	3	0	0	0,00
MYI	07.2023			295	0	0	0,00
	08.2023	\$	SGD	399	0	0	0,00
UAG	07.2023	SGD	\$	14	0	0	0,00
	07.2023	\$	SGD	414	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (19.751)	(2,03)
Summe Anlagen						\$ 1.372.831	141,07
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (399.665)	(41,07)
Nettovermögen						\$ 973.166	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(b) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar

(c) Mit dem Fonds verbunden.

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(e) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 339.204 USD (31. Dezember 2022: 400.193 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(f) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 22.916 USD (31. Dezember 2022: 17.272 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 157 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 18.308 USD (31. Dezember 2022: 19.275 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 31.670 USD (31. Dezember 2022: 18.770 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.389.738	\$ 223	\$ 1.389.961
Investmentfonds	123	0	0	123
Pensionsgeschäfte	0	2.394	0	2.394
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.183	(20.830)	0	(19.647)
Summen	\$ 1.306	\$ 1.371.302	\$ 223	\$ 1.372.831

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.750.918	\$ 0	\$ 1.750.918
Investmentfonds	120	0	0	120
Pensionsgeschäfte	0	59.113	0	59.113
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	8.938	(13.669)	0	(4.731)
Summen	\$ 9.058	\$ 1.796.362	\$ 0	\$ 1.805.420

<sup>(1)</sup> Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.



## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,160 %	27.06.2023	18.07.2023	\$ (12.093)	\$ (12.100)	(1,24)
	5,180	15.06.2023	13.07.2023	(5.010)	(5.021)	(0,52)
	5,180	20.06.2023	13.07.2023	(193.962)	(194.269)	(19,96)
GRE	5,180	26.06.2023	17.07.2023	(9.043)	(9.049)	(0,93)
IND	5,180	17.05.2023	17.07.2023	(107.165)	(107.859)	(11,08)
	5,210	28.06.2023	05.07.2023	(10.952)	(10.956)	(1,13)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (339.254)	(34,86)

## Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	5,190 %	21.06.2023	05.07.2023	\$ (13.231)	\$ (13.250)	(1,36)
TDM	5,180	28.06.2023	12.07.2023	(2.126)	(2.126)	(0,22)
	5,200	29.06.2023	13.07.2023	(7.703)	(7.705)	(0,79)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (23.081)	(2,37)

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 24 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (4)	\$ 10	\$ 6	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	1.237	(980)	257	(97)	0	(97)
BPS	1.329	480	1.809	(3.167)	4.390	1.223
BRC	6	0	6	311	(320)	(9)
CBK	(4.803)	7.320	2.517	2.368	(1.310)	1.058
CIB	(818)	1.280	462	(334)	470	136
CKL	(15)	0	(15)	(14)	0	(14)
DUB	(1.480)	1.190	(290)	(1.532)	1.480	(52)
FAR	(492)	670	178	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	(380)	430	50	(181)	80	(101)
GLM	(70)	70	0	(384)	260	(124)
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(3)	0	(3)
GST	(6.441)	10.230	3.789	(3.474)	4.890	1.416
HUS	(10)	0	(10)	(10)	0	(10)
JPM	(1.118)	3.150	2.032	(272)	1.520	1.248
MAC	(856)	1.470	614	1.137	(840)	297
MBC	(2.962)	2.240	(722)	(3.160)	2.770	(390)
MEI	(527)	830	303	(251)	320	69
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(26)	260	234
MYI	450	(460)	(10)	(2.190)	1.630	(560)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(6)	100	94
SCX	(44)	0	(44)	4.186	(4.010)	176
SOG	(2.455)	2.010	(445)	(497)	570	73
TOR	(9)	0	(9)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(289)	290	1	(10)	30	20

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	122,37	108,79
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	20,43	18,76
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,03	0,26
Investmentfonds	0,01	0,01
Pensionsgeschäfte	0,25	4,32
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,19	0,64
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,18)	(0,43)
Freiverkehrsfinanzderivate	(2,03)	(0,56)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(34,86)	(31,05)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(2,37)	(1,31)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,73	0,51
Kanada	0,25	0,18
Cayman-Inseln	4,93	5,01
Dänemark	2,48	3,73
Frankreich	7,82	5,36
Deutschland	k. A.	1,07
Irland	5,48	4,58
Italien	10,13	6,97
Japan	6,47	4,89
Niederlande	k. A.	0,03
Neuseeland	0,20	0,14
Peru	0,01	0,04
Katar	k. A.	0,02
Saudi-Arabien	k. A.	0,02
Spanien	5,24	3,61
Schweden	1,35	0,99
Schweiz	0,10	k. A.
Großbritannien	12,43	8,89
USA	84,74	81,68
Kurzfristige Instrumente	0,47	0,09
Investmentfonds	0,01	0,01
Pensionsgeschäfte	0,25	4,32
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,21	0,64
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,02)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen –		
Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,18)	(0,43)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,23	0,22
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Inflation-Capped Options	(0,01)	0,00
Zinsswapoptionen	(0,44)	(0,35)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,01)	(0,01)
Total Return Swaps auf Indizes	(1,85)	(0,68)
Devisenterminkontrakte	(0,55)	(0,62)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,60	0,88
Sonstige Aktiva und Passiva	(41,07)	(31,79)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				
<b>ARGENTINIEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Argentina Government International Bond				
1,000 % fällig am 09.07.2029	\$ 13	\$ 4	0,00	
3,500 % fällig am 09.07.2041	800	258	0,26	
Provincia de Buenos Aires				
88,734 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS 20	0	0,00	
Summe Argentinien		262	0,26	
<b>AUSTRALIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Santos Finance Ltd.				
3,649 % fällig am 29.04.2031	\$ 1.100	914	0,92	
Virgin Australia Holdings Pty. Ltd				
8,125 % fällig am 15.11.2024 ^	377	1	0,00	
Summe Australien		915	0,92	
<b>BERMUDA</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Valaris Ltd.				
8,375 % fällig am 30.04.2030	300	301	0,30	
Weatherford International Ltd.				
6,500 % fällig am 15.09.2028	400	402	0,40	
Summe Bermuda		703	0,70	
<b>BRASILIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Vale Overseas Ltd.				
6,875 % fällig am 10.11.2039	375	393	0,39	
<b>KANADA</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Air Canada Pass-Through Trust				
3,300 % fällig am 15.07.2031	38	34	0,03	
<b>CAYMAN INSELN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Kaisa Group Holdings Ltd.				
11,500 % fällig am 30.01.2023 ^	600	40	0,04	
Sands China Ltd.				
4,875 % fällig am 18.06.2030	300	267	0,27	
Sunac China Holdings Ltd.				
5,950 % fällig am 26.04.2024 ^	450	68	0,07	
Transocean Titan Financing Ltd.				
8,375 % fällig am 01.02.2028	300	307	0,30	
Wynn Macau Ltd.				
5,500 % fällig am 01.10.2027	100	89	0,09	
Summe Cayman Inseln		771	0,77	
<b>CHINA</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	200	4	0,01	
9,250 % fällig am 15.04.2023 ^	200	2	0,00	
Summe China		6	0,01	
<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
EP Infrastructure A/S				
1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 400	307	0,31	
<b>FRANKREICH</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Altice France S.A.				
5,125 % fällig am 15.07.2029	\$ 725	515	0,52	
BNP Paribas S.A.				
3,132 % fällig am 20.01.2033	600	493	0,49	
7,750 % fällig am 16.08.2029 (e)(g)	200	194	0,20	
Societe Generale S.A.				
3,337 % fällig am 21.01.2033	450	361	0,36	

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
6,691 % fällig am 10.01.2034	\$ 500	\$ 509	0,51	
Summe Frankreich		2.072	2,08	
<b>IRLAND</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
AerCap Ireland Capital DAC				
2,875 % fällig am 14.08.2024	1.150	1.106	1,11	
<b>ITALIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Intesa Sanpaolo SpA				
4,950 % fällig am 01.06.2042	200	132	0,13	
Mundys SpA				
1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 300	280	0,28	
Nexi SpA				
2,125 % fällig am 30.04.2029	400	365	0,37	
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA				
3,500 % fällig am 09.10.2025	200	207	0,21	
Summe Italien		984	0,99	
<b>JAPAN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
5,133 % fällig am 20.07.2033	\$ 500	491	0,49	
Nomura Holdings, Inc.				
1,851 % fällig am 16.07.2025	200	183	0,18	
2,999 % fällig am 22.01.2032	375	304	0,31	
Summe Japan		978	0,98	
<b>LUXEMBURG</b>				
<b>STAMMAKTIEN</b>				
Intelsat Emergence S.A. (d)(h)	7.480	172	0,17	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)				
3,000 % fällig am 31.12.2026 (c)	\$ 520	308	0,31	
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % fällig am 15.03.2030	562	513	0,51	
Summe Luxemburg		821	0,82	
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
9,443 % fällig am 01.02.2029	139	139	0,14	
<b>RECHTE</b>				
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025	1.566	9	0,01	
Summe Luxemburg		1.141	1,14	
<b>MEXIKO</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Petroleos Mexicanos				
10,000 % fällig am 07.02.2033	\$ 100	92	0,09	
<b>MULTINATIONAL</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Delta Air Lines, Inc.				
4,750 % fällig am 20.10.2028	400	388	0,39	
NXP BV				
3,250 % fällig am 11.05.2041	875	638	0,64	
Summe multinational		1.026	1,03	
<b>NIEDERLANDE</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Prosus NV				
3,832 % fällig am 08.02.2051	300	184	0,19	

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>SÜDAFRIKA</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
South Africa Government International Bond				
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 26.800	\$ 1.473	1,48	
<b>SPANIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Cellnex Finance Co. S.A.				
1,500 % fällig am 08.06.2028	€ 400	374	0,37	
<b>SCHWEIZ</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Credit Suisse AG				
4,713 % fällig am 31.05.2024	400	435	0,44	
UBS Group AG				
4,988 % fällig am 05.08.2033	\$ 500	464	0,46	
6,442 % fällig am 11.08.2028	400	402	0,40	
6,537 % fällig am 12.08.2033	250	256	0,26	
Summe Schweiz		1.557	1,56	
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Barclays PLC				
5,746 % fällig am 09.08.2033	500	484	0,48	
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				
2,950 % fällig am 27.01.2029	500	312	0,31	
Grainger PLC				
3,000 % fällig am 03.07.2030	£ 200	193	0,19	
HSBC Holdings PLC				
4,600 % fällig am 17.12.2030 (e)(g)	\$ 300	229	0,23	
5,402 % fällig am 11.08.2033	250	244	0,24	
INEOS Quattro Finance PLC				
2,500 % fällig am 15.01.2026	€ 100	98	0,10	
John Lewis PLC				
4,250 % fällig am 18.12.2034	£ 300	238	0,24	
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 800	705	0,71	
National Grid PLC				
5,809 % fällig am 12.06.2033	\$ 50	51	0,05	
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,125 % fällig am 15.08.2030	£ 300	296	0,30	
Vmed O2 UK Financing PLC				
3,250 % fällig am 31.01.2031	€ 375	337	0,34	
Summe Großbritannien		3.187	3,19	
<b>USA</b>				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,975 % fällig am 25.12.2045 ^	\$ 277	210	0,21	
Argent Securities Trust				
5,300 % fällig am 25.09.2036	761	251	0,25	
5,510 % fällig am 25.04.2036	267	88	0,09	
5,710 % fällig am 25.04.2036	653	216	0,22	
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,470 % fällig am 25.12.2036	1.612	906	0,91	
First Franklin Mortgage Loan Trust				
6,575 % fällig am 25.10.2034	290	289	0,29	
GSAMP Trust				
5,240 % fällig am 25.01.2037	370	216	0,22	
5,270 % fällig am 25.12.2036	525	258	0,26	
5,380 % fällig am 25.12.2046	646	326	0,33	
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,630 % fällig am 25.08.2036	471	185	0,18	
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
5,270 % fällig am 25.11.2037	69	24	0,02	
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,280 % fällig am 25.01.2037	343	158	0,16	
5,290 % fällig am 25.10.2036	268	116	0,12	
5,450 % fällig am 25.09.2036	1.769	666	0,67	
5,610 % fällig am 25.09.2036	59	26	0,02	
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				
5,250 % fällig am 25.04.2037	61	32	0,03	
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
6,465 % fällig am 25.09.2046 ^	611	208	0,21	

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
New Century Home Equity Loan Trust 8,150 % fällig am 25.01.2033 ^	\$ 62	\$ 53	0,05	Chenierra Energy Partners LP 4,500 % fällig am 01.10.2029	\$ 700	\$ 643	0,64	Morgan Stanley 4,889 % fällig am 20.07.2033	\$ 1.450	\$ 1.396	1,40
NovaStar Mortgage Funding Trust 5,450 % fällig am 25.06.2036	517	364	0,36	5,950 % fällig am 30.06.2033	100	100	0,10	6,342 % fällig am 18.10.2033	50	53	0,05
5,450 % fällig am 25.09.2036	842	366	0,37	Chesapeake Energy Corp. 5,500 % fällig am 01.02.2026	100	98	0,10	MSCI, Inc. 3,625 % fällig am 01.11.2031	1.100	940	0,94
Option One Mortgage Loan Trust 5,400 % fällig am 25.03.2037	500	247	0,25	6,750 % fällig am 15.04.2029	200	199	0,20	4,000 % fällig am 15.11.2029	100	91	0,09
Residential Asset Mortgage Products Trust 5,610 % fällig am 25.12.2035	1.106	887	0,89	Choice Hotels International, Inc. 3,700 % fällig am 15.01.2031	150	127	0,13	Newell Brands, Inc. 4,875 % fällig am 01.06.2025	275	265	0,27
Residential Asset Securities Corp. Trust 4,916 % fällig am 25.08.2034	361	345	0,34	Comstock Resources, Inc. 6,750 % fällig am 01.03.2029	200	183	0,18	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,450 % fällig am 15.09.2028	500	400	0,40
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 6,110 % fällig am 25.01.2036 ^	112	97	0,10	Continental Resources, Inc. 5,750 % fällig am 15.01.2031	500	475	0,48	Occidental Petroleum Corp. 7,500 % fällig am 01.05.2031	500	547	0,55
Soundview Home Loan Trust 5,330 % fällig am 25.07.2037	247	211	0,21	DCP Midstream Operating LP 3,250 % fällig am 15.02.2032	200	170	0,17	Pacific Gas & Electric Co. 2,500 % fällig am 01.02.2031	200	157	0,16
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 5,450 % fällig am 25.09.2037	348	241	0,24	Diamond Sports Group LLC 5,375 % fällig am 15.08.2026 ^	400	14	0,01	3,150 % fällig am 01.01.2026	300	279	0,28
		6,986	7,00	Duke Energy Corp. 4,500 % fällig am 15.08.2032	100	94	0,09	3,950 % fällig am 01.12.2047 ^	425	290	0,29
				5,000 % fällig am 15.08.2052	100	91	0,09	4,550 % fällig am 01.07.2030	100	91	0,09
<b>AKTIEN</b>				Edison International 6,950 % fällig am 15.11.2029	100	105	0,11	Philip Morris International, Inc. 5,375 % fällig am 15.02.2033	300	299	0,30
<b>STAMMAKTIEEN</b>				Endeavor Energy Resources LP 5,750 % fällig am 30.01.2028	325	318	0,32	PRA Health Sciences, Inc. 2,875 % fällig am 15.07.2026	300	272	0,27
<b>ENERGIE</b>				Energy Transfer LP 5,000 % fällig am 15.05.2044	500	422	0,42	SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	200	170	0,17
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (d)(h)	580.149	63	0,06	EnLink Midstream LLC 6,500 % fällig am 01.09.2030	100	100	0,10	Sealed Air Corp. 1,573 % fällig am 15.10.2026	450	392	0,39
<b>FINANZWERTE</b>				Entergy Corp. 3,750 % fällig am 15.06.2050	100	74	0,07	Southern California Edison Co. 3,650 % fällig am 01.02.2050	400	298	0,30
Stearns Holdings LLC 'B' (d)	157.159	0	0,00	EQM Midstream Partners LP 4,500 % fällig am 15.01.2029	100	89	0,09	Southern California Gas Co. 5,200 % fällig am 01.06.2033	100	99	0,10
Summe Stammaktien		63	0,06	EQT Corp. 5,000 % fällig am 15.01.2029	325	306	0,31	Station Casinos LLC 4,625 % fällig am 01.12.2031	700	590	0,59
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Equifax, Inc. 5,100 % fällig am 01.06.2028	50	49	0,05	Sysco Corp. 3,150 % fällig am 14.12.2051	425	295	0,30
Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029	\$ 322	309	0,31	Equinix, Inc. 3,000 % fällig am 15.07.2050	450	292	0,29	T-Mobile USA, Inc. 3,600 % fällig am 15.11.2060	575	404	0,41
Allegheny Corp. 3,250 % fällig am 15.08.2051	225	161	0,16	Expedia Group, Inc. 3,250 % fällig am 15.02.2030	400	348	0,35	Time Warner Cable Enterprises LLC 8,375 % fällig am 15.07.2033	100	110	0,11
Allstate Corp. 5,750 % fällig am 15.08.2053	100	99	0,10	Global Atlantic Fin Co. 3,125 % fällig am 15.06.2031	300	226	0,23	Travel + Leisure Co. 6,625 % fällig am 31.07.2026	100	99	0,10
American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % fällig am 01.11.2028	360	323	0,32	Global Payments, Inc. 5,400 % fällig am 15.08.2032	600	585	0,59	United Airlines, Inc. 4,375 % fällig am 15.04.2026	250	238	0,24
American Homes 4 Rent LP 3,375 % fällig am 15.07.2051	600	394	0,40	5,950 % fällig am 15.08.2052	400	383	0,38	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 15.08.2029	1.675	1.465	1,47
American Tower Corp. 2,700 % fällig am 15.04.2031	300	249	0,25	GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2030	600	521	0,52	3,875 % fällig am 01.11.2033	300	246	0,25
2,950 % fällig am 15.01.2051	1.125	711	0,71	Goodman U.S. Finance Five LLC 4,625 % fällig am 04.05.2032	50	46	0,05	4,125 % fällig am 15.08.2031	300	258	0,26
5,550 % fällig am 15.07.2033	200	202	0,20	HCA, Inc. 3,500 % fällig am 01.09.2030	350	307	0,31	VICI Properties LP 3,875 % fällig am 15.02.2029	625	549	0,55
Aviation Capital Group LLC 3,500 % fällig am 01.11.2027	400	354	0,35	4,625 % fällig am 15.03.2052	725	596	0,60	Vistra Operations Co. LLC 3,550 % fällig am 15.07.2024	300	290	0,29
Bank of America Corp. 5,015 % fällig am 22.07.2033	1.350	1.321	1,32	Host Hotels & Resorts LP 2,900 % fällig am 15.12.2031	500	394	0,39	3,700 % fällig am 30.01.2027	200	183	0,18
BGC Partners, Inc. 8,000 % fällig am 25.05.2028	50	48	0,05	3,375 % fällig am 15.12.2029	100	86	0,09	Vornado Realty LP 2,150 % fällig am 01.06.2026	600	509	0,51
Boeing Co. 3,950 % fällig am 01.08.2059	600	444	0,45	3,500 % fällig am 15.09.2030	925	785	0,79	Wells Fargo & Co. 3,526 % fällig am 24.03.2028	100	93	0,09
5,705 % fällig am 01.05.2040	600	599	0,60	Howard Midstream Energy Partners LLC 8,875 % fällig am 15.07.2028 (b)	300	302	0,30	4,897 % fällig am 25.07.2033	1.100	1.056	1,06
5,805 % fällig am 01.05.2050	100	100	0,10	Hudson Pacific Properties LP 3,950 % fällig am 01.11.2027	300	218	0,22	Weyerhaeuser Co. 4,000 % fällig am 09.03.2052	1.125	900	0,90
Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % fällig am 15.11.2027	250	199	0,20	5,950 % fällig am 15.02.2028	100	80	0,08	4,750 % fällig am 15.05.2026	100	98	0,10
7,550 % fällig am 15.03.2028	200	180	0,18	Hyundai Capital America 5,500 % fällig am 30.03.2026	100	99	0,10	7,375 % fällig am 15.03.2032	99	111	0,11
British Airways Pass-Through Trust 3,300 % fällig am 15.06.2034	86	75	0,08	Infor, Inc. 1,450 % fällig am 15.07.2023	100	100	0,10				
Broadcom, Inc. 3,187 % fällig am 15.11.2036	5	4	0,00	JPMorgan Chase & Co. 4,912 % fällig am 25.07.2033	1.000	978	0,98	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
3,469 % fällig am 15.04.2034	525	431	0,43	5,000 % fällig am 01.08.2024 (e)	100	97	0,10	Banc of America Funding Trust 6,000 % fällig am 25.07.2037	183	146	0,15
4,150 % fällig am 15.04.2032	675	612	0,61	Marriott International, Inc. 4,900 % fällig am 15.04.2029	50	49	0,05	BCAP LLC Trust 5,590 % fällig am 25.05.2047 ^	157	151	0,15
Brookfield Capital Finance LLC 6,087 % fällig am 14.06.2033	100	102	0,10	Mattel, Inc. 3,375 % fällig am 01.04.2026	900	829	0,83	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 4,222 % fällig am 25.07.2036 ^	45	40	0,04
Caesars Entertainment, Inc. 7,000 % fällig am 15.02.2030	250	251	0,25	Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % fällig am 20.06.2027	80	80	0,08	Countrywide Alternative Loan Trust 5,347 % fällig am 20.09.2046	7	7	0,01
Centene Corp. 2,450 % fällig am 15.07.2028	625	535	0,54	Moody's Corp. 3,100 % fällig am 29.11.2061	475	313	0,31	5,376 % fällig am 25.08.2035	11	11	0,01
CenterPoint Energy Houston Electric LLC 4,950 % fällig am 01.04.2033	100	100	0,10					5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	268	153	0,15
Charter Communications Operating LLC 3,950 % fällig am 30.06.2062	575	354	0,35					5,530 % fällig am 25.09.2046 ^	5	4	0,00
								5,636 % fällig am 25.07.2035	143	129	0,13
								6,000 % fällig am 25.10.2035 ^	12	8	0,01
								6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	113	85	0,09

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
6,500 % fällig am 25.08.2037 ^	\$ 1.880	\$ 825	0,83	5,500 % fällig am 25.08.2035 ^	\$ 19	\$ 15	0,01	JUNGFERNINSELN (BRITISCH)			
7,798 % fällig am 25.09.2037	288	242	0,24	5,900 % fällig am 25.11.2036 ^	513	375	0,38	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Residential Asset Securitization Trust				Studio City Finance Ltd.			
3,287 % fällig am 25.09.2037 ^	70	63	0,06	5,750 % fällig am 25.03.2037 ^	227	75	0,08	5,000 % fällig am 15.01.2029	\$ 150	\$ 111	0,11
5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	7	4	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2036	322	148	0,15	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	480	192	0,19	COMMERCIAL PAPER			
6,000 % fällig am 25.09.2035	229	75	0,08	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				AT+T, Inc.			
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				5,630 % fällig am 25.05.2037 ^	75	66	0,07	5,700 % fällig am 19.03.2024	400	383	0,39
2,796 % fällig am 29.12.2037	638	353	0,35	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Constellation Brands, Inc.			
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				5,500 % fällig am 25.05.2035 ^	1.232	971	0,97	5,580 % fällig am 25.07.2023	250	249	0,25
6,000 % fällig am 25.07.2036	144	76	0,08			7.576	7,59	VW Credit, Inc.			
6,500 % fällig am 25.10.2021 ^	157	10	0,01	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				5,430 % fällig am 01.08.2023	250	249	0,25
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				Ginnie Mae, TBA				Summe kurzfristige Instrumente		881	0,89
5,290 % fällig am 25.07.2047	13	12	0,01	2,500 % fällig am 01.08.2053	100	87	0,09				
5,300 % fällig am 25.02.2047	3.165	1.934	1,94	Uniform Mortgage-Backed Security				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 90.030	90,22	
5,530 % fällig am 25.10.2036 ^	171	54	0,05	3,000 % fällig am 01.05.2052	98	87	0,09	AKTIEN			
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				INVESTMENTFONDS			
3,238 % fällig am 25.08.2035 ^	12	10	0,01	2,000 % fällig am 01.08.2053	100	82	0,08	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				2,500 % fällig am 01.08.2053	1.100	934	0,94	PIMCO Select Funds plc -			
4,226 % fällig am 25.08.2035 ^	5	4	0,00	4,000 % fällig am 01.08.2053	9.200	8.642	8,66	PIMCO US Dollar Short-			
Freddie Mac				4,500 % fällig am 01.08.2053	4.700	4.521	4,53	Term Floating NAV Fund (f)	925.129	9.212	9,23
5,992 % fällig am 25.11.2055	636	367	0,37	5,000 % fällig am 01.09.2053	1.000	980	0,98	PIMCO Specialty Funds Ireland			
Impac Secured Assets Trust						15.333	15,37	p.l.c. - PIMCO China Bond			
5,450 % fällig am 25.11.2036	37	36	0,04	US-SCHATZobligationen				Fund (f)	9.239	121	0,12
IndyMac Mortgage Loan Trust				U.S. Treasury Notes				Summe Investmentfonds		9.333	9,35
3,216 % fällig am 25.12.2034	239	224	0,22	0,500 % fällig am 31.10.2027	9.900	8.452	8,47	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
3,629 % fällig am 25.05.2037 ^	57	48	0,05					PIMCO ETFs plc - PIMCO			
5,650 % fällig am 25.02.2037	22	14	0,01	OPTIONSSCHEINE				US Dollar Short Maturity			
JPMorgan Mortgage Trust				Guaranteed Rate, Inc. -				UCITS ETF (f)	4.000	397	0,40
6,500 % fällig am 25.07.2036 ^	243	98	0,10	Exp. 31.12.2060	753	0	0,00	Summe		\$ 9.730	9,75
Lehman XS Trust				Vistra Corp. - Exp. 02.02.2024	31.815	2	0,00				
5,510 % fällig am 25.07.2037 ^	273	251	0,25			2	0,00				
6,050 % fällig am 25.08.2047 ^	187	157	0,16	Summe USA		71.473	71,62				
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust											
3,103 % fällig am 25.11.2037	194	128	0,13								
Residential Accredited Loans, Inc. Trust											
4,834 % fällig am 25.12.2035 ^	16	13	0,01								
4,873 % fällig am 25.07.2035	2	2	0,00								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,160 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 12.600	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025	\$ (12.869)	\$ 12.600	\$ 12.605	12,63
SSB	2,400	30.06.2023	03.07.2023	553	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	(564)	553	553	0,55
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (13.433)	\$ 13.153	\$ 13.158	13,18

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	50	\$ 340	0,34
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	3	4	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	90	174	0,18
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	53	18	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	52	3	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	13	(26)	(0,03)
				\$ 513	0,51

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111.500	21.07.2023	2	\$ (1)	\$ (1)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115.500	21.07.2023	2	(1)	0	0,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	\$ 123.000	21.07.2023	1	\$ 1	\$ 0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131.000	21.07.2023	1	(1)	0	0,00
				\$ (2)	\$ (1)	0,00

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate \$ 512 0,51

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AutoZone, Inc.	(1,000) %	20.06.2024	\$ 1.400	\$ 26	0,03
Bath & Body Works, Inc.	(1,000)	20.12.2023	350	(28)	(0,03)
ConocoPhillips	(1,000)	20.12.2024	100	(1)	0,00
Johnson Controls International PLC	(1,000)	20.12.2024	1.500	36	0,04
Lowe's Cos., Inc.	(1,000)	20.12.2023	700	14	0,01
Tyson Foods, Inc.	(1,000)	20.06.2024	1.400	30	0,03
				\$ 77	0,08

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2027	\$ 100	\$ 2	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	100	1	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	100	(1)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 100	20	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	200	15	0,02
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	\$ 300	1	0,00
Toll Brothers Finance Corp.	1,000	20.06.2026	200	3	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	100	0	0,00
				\$ 41	0,04

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2028	\$ 2.700	\$ (19)	(0,02)

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 100	\$ 7	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	200	16	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.09.2027	¥ 94.200	6	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	\$ 200	(2)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	21.12.2027	CNY 29.000	(51)	(0,05)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,300	28.04.2027	ZAR 15.500	33	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 440	207	0,20
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	300	1	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	600	(2)	0,00
					\$ 215	0,21

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate \$ 314 0,31

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## OPTIONSKAUF

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021 %	25.10.2023	1.500	\$ 86	\$ 380	0,38

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	100	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	25.10.2023	7.500	(86)	(675)	(0,68)
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	100	0	(1)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	100	0	0	0,00
							\$ (91)	\$ (677)	(0,68)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Mexico Government International Bond	(1,000) %	20.12.2023	\$ 2.200	\$ 25	\$ (35)	\$ (10)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Pertamina Persero PT	1,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ 0	\$ 1	\$ 1	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2023	\$ 100	\$ 10	\$ (7)	\$ 3	0,00
GST	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	200	23	(18)	5	0,01
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	300	39	(32)	7	0,01
					\$ 72	\$ (57)	\$ 15	0,02

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	1,084 %	\$ 4.800	20.03.2024	\$ 58	\$ (51)	\$ 7	0,01



# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

## DEVIENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2023	AUD	46	\$	31	\$	0	0,00	
	08.2023	\$	31	AUD	46		0	0,00	
BOA	07.2023		535	¥	77.192		0	0,00	
	09.2023		30	IDR	455.342		0	0,00	
BPS	07.2023	AUD	33	\$	22		0	0,00	
	07.2023	\$	3.155	€	2.879		(14)	(0,01)	
	07.2023		984	¥	136.749		(38)	(0,04)	
	08.2023	CNH	471	\$	68		3	0,00	
	08.2023	€	2.879		3.159		14	0,01	
	08.2023	\$	22	AUD	33		0	0,00	
	08.2023	ZAR	6.873	\$	373		11	0,01	
	09.2023	\$	30	IDR	443.820		0	0,00	
	10.2023	ZAR	4.960	\$	267		7	0,01	
BRC	08.2023	\$	266	COP	1.134.924		2	0,00	
	08.2023	ZAR	1.862	\$	101		3	0,00	
	09.2023	IDR	1.771		0		0	0,00	
	09.2023	\$	52	PEN	190		0	0,00	
CBK	07.2023	€	262	\$	281		(5)	0,00	
	07.2023	PEN	2.936		756		(55)	(0,05)	
	07.2023	\$	1.108	PEN	4.093		22	0,02	
	08.2023	CLP	177.617	\$	216		(3)	0,00	
	08.2023	\$	217	CLP	177.617		3	0,00	
	08.2023		85	NOK	887		(2)	0,00	
DUB	07.2023	PEN	4.000	\$	1.097		(6)	(0,01)	
	07.2023	\$	129	BRL	701		16	0,02	
	07.2023		547	PEN	2.000		5	0,00	
	10.2023	ZAR	2.201	\$	121		6	0,01	
GLM	07.2023	BRL	704		146		0	0,00	
	07.2023	PEN	736		201		(1)	0,00	
	07.2023	\$	14	PEN	51		0	0,00	
	08.2023		106	NOK	1.128		(1)	0,00	
	08.2023		99	PEN	362		0	0,00	
	09.2023		146	BRL	711		0	0,00	
	09.2023		132	PEN	485		1	0,00	
	10.2023	ZAR	2.847	\$	152		3	0,00	
JPM	07.2023	¥	46.569		326		3	0,00	
	07.2023	MXN	52		3		0	0,00	
	08.2023	CNH	223		32		1	0,00	
	08.2023	\$	326	¥	46.371		(3)	0,00	
	08.2023		39	NOK	416		0	0,00	
	08.2023		101	ZAR	1.856		(4)	0,00	
	09.2023		13	IDR	192.077		0	0,00	
	09.2023		164	INR	13.526		0	0,00	
MBC	07.2023	£	562	\$	696		(19)	(0,02)	
MYI	07.2023	IDR	120.037		8		0	0,00	
	07.2023	\$	29	€	27		0	0,00	
	07.2023		8	IDR	120.037		0	0,00	
	09.2023		45		665.056		0	0,00	
	09.2023		35	INR	2.921		0	0,00	
RBC	07.2023		22	MXN	415		3	0,00	
	08.2023		468		8.114		1	0,00	
SCX	07.2023	AUD	68	\$	45		0	0,00	
	08.2023	CNH	106		15		1	0,00	
	08.2023	\$	45	AUD	68		0	0,00	
	09.2023		182	IDR	2.714.606		(2)	0,00	
	09.2023		103	INR	8.459		0	0,00	
	09.2023		98	PEN	360		1	0,00	
SOG	07.2023	€	2.617	\$	2.815		(41)	(0,04)	
	07.2023	\$	105	AUD	161		2	0,00	
SSB	07.2023		548	PEN	2.000		3	0,00	
	08.2023	PEN	2.000	\$	548		(3)	0,00	
TOR	07.2023	AUD	83		55		0	0,00	
	07.2023	\$	56	AUD	85		1	0,00	
	07.2023		714	£	562		0	0,00	
	08.2023	£	562	\$	714		0	0,00	
	08.2023	\$	55	AUD	83		0	0,00	
UAG	07.2023	AUD	40	\$	27		0	0,00	
	07.2023	\$	19	AUD	29		0	0,00	
	08.2023		27		40		0	0,00	
	08.2023	ZAR	5.607	\$	292		(3)	0,00	
	09.2023		3.978		227		19	0,02	
					\$	131	\$ (200)	\$ (69)	(0,07)



**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE**

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 103	CHF 93	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2023	CHF 4.184	\$ 4.678	2	0	2	0,00
	07.2023	\$ 6.696	CHF 6.058	75	0	75	0,08
	08.2023	4.678	4.172	0	(2)	(2)	0,00
DUB	07.2023	CHF 1.356	\$ 1.499	0	(17)	(17)	(0,02)
MYI	07.2023	21	24	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	\$ 4.949	CHF 4.447	21	0	21	0,02
UAG	07.2023	CHF 4.315	\$ 4.813	0	(9)	(9)	(0,01)
	07.2023	\$ 4.464	CHF 4.011	19	0	19	0,02
	08.2023	4.813	4.302	10	0	10	0,01
				\$ 127	\$ (28)	\$ 99	0,10

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 35	\$ 38	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 9.060	€ 8.430	138	0	138	0,14
BPS	07.2023	€ 8.985	\$ 9.844	42	0	42	0,04
	07.2023	\$ 9.091	€ 8.456	134	0	134	0,13
	08.2023	9.791	8.923	0	(43)	(43)	(0,04)
CBK	07.2023	€ 8.930	\$ 9.709	1	(34)	(33)	(0,03)
	07.2023	\$ 154	€ 143	2	0	2	0,00
	08.2023	9.644	8.858	33	0	33	0,03
JPM	07.2023	€ 8.912	\$ 9.731	8	0	8	0,01
	08.2023	\$ 9.745	€ 8.912	0	(8)	(8)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 68	\$ 73	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 83	€ 77	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	1.533	1.413	8	0	8	0,01
SOG	07.2023	9.047	8.410	128	0	128	0,13
				\$ 495	\$ (86)	\$ 409	0,41

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 155 0,16

Summe Anlagen

\$ 113.894 114,13

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (14.098) (14,13)

Nettovermögen

\$ 99.796 100,00

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.  
 (b) Wertpapier per Emissionstermin.  
 (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.  
 (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.  
 (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
 (f) Mit dem Fonds verbunden.  
 (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 1,99 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 63	\$ 63	0,06
Intelsat Emergence S.A.	12.11.2019	750	172	0,17
		\$ 813	\$ 235	0,23

Barmittel in Höhe von 1.387 USD (31. Dezember 2022: 1.243 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 300 USD (31. Dezember 2022: 290 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

## Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2	\$ 88.633	\$ 1.395	\$ 90.030
Investmentfonds	9.730	0	0	9.730
Pensionsgeschäfte	0	13.153	0	13.153
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	4	977	0	981
<b>Summen</b>	<b>\$ 9.736</b>	<b>\$ 102.763</b>	<b>\$ 1.395</b>	<b>\$ 113.894</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 8	\$ 79.539	\$ 648	\$ 80.195
Investmentfonds	9.253	396	0	9.649
Pensionsgeschäfte	0	6.910	0	6.910
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	33	393	0	426
<b>Summen</b>	<b>\$ 9.294</b>	<b>\$ 87.238</b>	<b>\$ 648</b>	<b>\$ 97.180</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ (14)	\$ 0	\$ (14)
BOA	(158)	300	142	(104)	0	(104)
BPS	198	(260)	(62)	(290)	290	0
BRC	6	0	6	5	0	5
CBK	(45)	0	(45)	555	(550)	5
DUB	4	0	4	4	(40)	(36)
GLM	2	0	2	(23)	0	(23)
GST	5	0	5	9	0	9
JPM	3	0	3	(63)	0	(63)
MBC	(19)	0	(19)	120	0	120
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
MYI	8	(50)	(42)	4	0	4
RBC	4	0	4	3	0	3
SCX	21	0	21	253	0	253
SOG	89	0	89	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	36	0	36	(8)	0	(8)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	42,31	40,41
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,90	40,99
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	1,15
Investmentfonds	9,75	9,93
Pensionsgeschäfte	13,18	7,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,51	0,41
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,31	(0,43)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,16	0,46

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,26	0,24
Australien	0,92	0,90
Bermuda	0,70	k. A.
Brasilien	0,39	0,41
Kanada	0,03	0,94
Cayman-Inseln	0,77	0,64

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
China	0,01	0,02
Tschechische Republik	0,31	k. A.
Frankreich	2,08	1,06
Irland	1,11	k. A.
Italien	0,99	0,34
Japan	0,98	0,80
Luxemburg	1,14	1,17
Mexiko	0,09	k. A.
Multinational	1,03	1,02
Niederlande	0,19	0,95
Peru	k. A.	0,74
Katar	k. A.	0,40
Südafrika	1,48	1,71
Spanien	0,37	0,37
Schweiz	1,56	1,08
Großbritannien	3,19	3,36
USA	71,62	65,91
Jungferninseln (Britisch)	0,11	0,23
Kurzfristige Instrumente	0,89	0,26
Investmentfonds	9,75	9,93
Pensionsgeschäfte	13,18	7,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,51	0,41
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,08	0,08
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	0,04
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,02)	k. A.
Zinsswaps	0,21	(0,55)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,38	0,63
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,68)	(1,06)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes– Schutzverkauf	0,02	0,03
Total Return Swaps auf Indizes	0,01	(0,16)
Devisenterminkontrakte	(0,07)	(0,04)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,51	1,08
Sonstige Aktiva und Passiva	(14,13)	(0,03)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Diversified Income Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
<b>ALBANEN</b>				<b>Avolon Holdings Funding Ltd.</b>				<b>Ecopetrol S.A.</b>						
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				2,528 % fällig am 18.11.2027 \$			12,810	\$	10,814	0,14				
Albania Government International Bond				2,875 % fällig am 15.02.2025			9.400		8.747	0,11				
3,500 % fällig am 16.06.2027	€	16.800	\$	16.928	0,21	3,250 % fällig am 15.02.2027	4.900		4.370	0,06				
<b>ARGENTINIEN</b>				4,226 % fällig am 15.04.2026			3.600		3.356	0,04				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				5,250 % fällig am 15.01.2024			1.200		1.179	0,01				
Argentina Government International Bond				5,500 % fällig am 15.01.2026			10.500		10.180	0,13				
1,500 % fällig am 09.07.2035	\$	26.928		Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % bar oder 9,000 % PIK)										
3,500 % fällig am 09.07.2041		133.299		9,000 % fällig am 22.04.2027										
				(a)		1.468		1.417		0,02				
Summe Argentinien		51.047		0,64										
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>Gaci First Investment Co.</b>				<b>ZYPERN</b>						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,875 % fällig am 14.02.2035			5.000		4.800	0,06				
CIMIC Finance Ltd.				5,125 % fällig am 14.02.2053			12.100		10.905	0,14				
1,500 % fällig am 28.05.2029	€	100		Kaisa Group Holdings Ltd.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
Pacific National Finance Pty. Ltd.				9,375 % fällig am 30.06.2024				Atrium Finance PLC						
4,750 % fällig am 22.03.2028	\$	1.000		9,850		655	0,01	2,625 % fällig am 05.09.2027			€	19.800	15.749	0,20
Santos Finance Ltd.				10,500 % fällig am				<b>DÄNEMARK</b>						
3,649 % fällig am 29.04.2031		3.200		9,750 % fällig am 28.09.2023		22.900	1,532	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
Woodside Finance Ltd.				10,500 % fällig am		21.600	1,445	TDC Net A/S						
3,700 % fällig am 15.09.2026		600		15.01.2025 ^		5.800	370	5,056 % fällig am 31.05.2028			12.000	12.870	0,16	
4,500 % fällig am 04.03.2029		2.200		10,875 % fällig am		17.000	1,137	<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>						
Summe Australien		6.295		23.07.2023 ^		11.500	0,700	<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
				11,250 % fällig am		900	60	Dominican Republic Government International Bond						
				16.04.2025 ^		11,650 % fällig am	9.300	6,500 % fällig am 15.02.2048			\$	40.600	35.183	0,44
				30.01.2023 ^		11,650 % fällig am	622	<b>ECUADOR</b>						
				01.06.2026 ^		11,700 % fällig am	385	<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
				11.11.2025 ^		11,950 % fällig am	358	Ecuador Government International Bond						
				12.11.2023 ^		11,950 % fällig am	885	0,000 % fällig am 31.07.2030						
						12.11.2023 ^	4.400	(c)			20.689	6.018	0,08	
							2.707	1,500 % fällig am 31.07.2040			13.450	4.217	0,05	
							3.400	5,500 % fällig am 31.07.2030			12.800	6.223	0,08	
							8.900	Summe Ecuador				16.458	0,21	
							1.000	<b>ÄGYPTEN</b>						
							1.046	<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
							6.296	Egypt Government International Bond						
							0,01	5,625 % fällig am 16.04.2030			€	2.550	1.549	0,02
							0,09	6,375 % fällig am 11.04.2031			17.600	10.718	0,14	
							885	7,500 % fällig am 16.02.2061			\$	44.000	22.187	0,28
							0,01	8,500 % fällig am 31.01.2047			9.500	5.072	0,06	
							364	Summe Ägypten				39.526	0,50	
							507	<b>FINNLAND</b>						
							498	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
							0,01	Balder Finland Oyj						
							504	1,000 % fällig am 18.01.2027			€	200	165	0,00
							417	1,000 % fällig am 20.01.2029			300	209	0,01	
							0,06	1,375 % fällig am 24.05.2030			4.900	3.199	0,04	
							0,12	2,000 % fällig am 18.01.2031			300	196	0,00	
							0,08	Summe Finnland				3.769	0,05	
							0,04	<b>FRANKREICH</b>						
							0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
							0,06	Accor S.A.						
							0,01	2,375 % fällig am 29.11.2028			1.100	1.080	0,01	
							0,00	Altarea S.C.A.						
							0,00	1,750 % fällig am 16.01.2030			500	381	0,00	
							0,01	1,875 % fällig am 17.01.2028			600	530	0,01	
							0,01	Altareit S.C.A.						
							0,02	2,875 % fällig am 02.07.2025			100	101	0,00	
							0,01	Altice France S.A.						
							0,01	3,375 % fällig am 15.01.2028			3.100	2.477	0,03	
							0,02	4,000 % fällig am 15.07.2029			10.900	8.566	0,11	
							0,00	(h)			20.100	15.835	0,20	
							0,00	4,250 % fällig am 15.10.2029			600	454	0,01	
							0,05	BNP Paribas S.A.						
							0,05	1,904 % fällig am 30.09.2028			35.700	30.444	0,38	
							0,09	5,198 % fällig am 10.01.2030			4.000	3.870	0,05	
							0,02	CGG S.A.						
							0,02	8,750 % fällig am 01.04.2027			6.700	5.619	0,07	
							124.124					1.56		
							147.734					1,86		
								<b>CHILE</b>						
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
								Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.						
								3,650 % fällig am 07.05.2030			3.800	3.486	0,04	
								GNL Quintero S.A.						
								4,634 % fällig am 31.07.2029			3.212	3.126	0,04	
								Summe Chile				6.612	0,08	
								<b>CHINA</b>						
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
								Yango Justice International Ltd.						
								7,500 % fällig am 15.04.2024 ^			28.200	592	0,01	
								7,500 % fällig am						
								17.02.2025 ^			19.100	167	0,00	
								7,875 % fällig am						
								04.09.2024 ^			19.800	297	0,00	
								Summe China				1.056	0,01	
								<b>KOLUMBIEN</b>						

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Electricite de France S.A. 4,500 % fällig am 21.09.2028 6,900 % fällig am 23.05.2053 9,125 % fällig am 15.03.2033 (d)	\$ 5.700	\$ 5.445	0,07	1,750 % fällig am 24.11.2028 €	500	\$ 390	0,00	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,073 % fällig am 15.11.2031 €	7.450	\$ 7.975	0,10
La Mondiale SAM 5,050 % fällig am 17.12.2025 (d)	€ 12.665	13.576	0,17	Summe Guernsey, Kanalinseln		21.648	0,27	CVC Cordatus Loan Fund DAC 3,827 % fällig am 15.10.2031	13.200	14.131	0,18
Loxam S.A.S. 2,875 % fällig am 15.04.2026 3,750 % fällig am 15.07.2026 4,500 % fällig am 15.02.2027 (h)	€ 1.600 1.900	1.624 1.969	0,02 0,03	<b>HONGKONG</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,103 % fällig am 15.08.2032	1.366	1.466	0,02
New Immo Holding S.A. 2,750 % fällig am 26.11.2026 Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026 Societe Generale S.A. 4,000 % fällig am 12.01.2027 7,375 % fällig am 04.10.2023 (d)(f)	€ 200 18.300	196 18.511	0,00 0,23	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	24.300	18.293	0,23	4,008 % fällig am 27.01.2031	1.383	1.482	0,02
TDF Infrastructure SASU 1,750 % fällig am 01.12.2029 Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027 Verallia S.A. 1,875 % fällig am 10.11.2031	€ 45.500 6.000	40.046 5.032	0,50 0,06	Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023 \$	3.000	2.965	0,04	4,103 % fällig am 11.04.2031	2.387	2.555	0,03
	€ 8.100	7.123	0,09	Summe Hongkong		21.258	0,27	Dryden Euro CLO DAC 3,837 % fällig am 15.04.2033	12.800	13.661	0,17
		176.051	2,21	<b>INDONESIEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,163 % fällig am 15.05.2034	14.700	15.694	0,20
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				Pertamina Persero PT 6,500 % fällig am 07.11.2048	33.400	34.777	0,44	Euro-Galaxy CLO DAC 3,765 % fällig am 11.04.2031	1.281	1.373	0,02
Altice France S.A. 8,677 % fällig am 15.08.2028	3.079	2.938	0,04	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 3,000 % fällig am 30.06.2030	17.600	15.071	0,19	3,831 % fällig am 24.04.2034	9.600	10.199	0,13
Summe Frankreich		178.989	2,25	TBD % fällig am 17.07.2030 €	8.000	8.728	0,11	GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 4,100 % fällig am 20.01.2032	1.700	1.809	0,02
<b>DEUTSCHLAND</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>IRLAND</b> <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Griffith Park CLO DAC 4,103 % fällig am 21.11.2031	31.400	33.611	0,42
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032 (g)	\$ 1.100	867	0,01	Accunia European CLO DAC 4,107 % fällig am 15.10.2030	714	774	0,01	Harvest CLO DAC 1,040 % fällig am 15.07.2031	1.600	1.591	0,02
3,547 % fällig am 18.09.2031	19.350	16.081	0,20	Adagio CLO DAC 3,897 % fällig am 15.10.2031	5.800	6.206	0,08	3,880 % fällig am 20.10.2031	18.800	20.093	0,25
3,729 % fällig am 14.01.2032 (g)	2.900	2.195	0,03	Ares European CLO DAC 3,837 % fällig am 15.10.2030	298	319	0,00	3,937 % fällig am 15.07.2031	10.400	11.074	0,14
3,742 % fällig am 07.01.2033	1.900	1.395	0,02	Ares European CLO DAC 3,787 % fällig am 15.04.2030	1.672	1.789	0,02	4,027 % fällig am 15.01.2032	17.600	18.790	0,24
5,882 % fällig am 08.07.2031	37.300	32.688	0,41	3,837 % fällig am 15.10.2030	1.689	1.809	0,02	4,250 % fällig am 26.06.2030	2.393	2.558	0,03
DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	€ 1.200	994	0,01	3,957 % fällig am 15.10.2031	9.900	10.616	0,13	Invesco Euro CLO DAC 3,827 % fällig am 15.07.2031	850	905	0,01
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	€ 17.200	18.277	0,23	4,050 % fällig am 20.04.2032	500	535	0,01	Jubilee CLO DAC 3,777 % fällig am 15.04.2030	4.200	4.476	0,06
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (a)	19.950	20.362	0,26	Armada Euro CLO DAC 3,897 % fällig am 15.07.2031	11.095	11.842	0,15	3,787 % fällig am 15.04.2030	1.900	2.031	0,03
INEOS Styrolution Group GmbH 2,250 % fällig am 16.01.2027	19.000	17.812	0,22	Aurium CLO DAC 3,907 % fällig am 16.01.2031	4.793	5.128	0,06	3,827 % fällig am 15.04.2031	5.850	6.228	0,08
Volksswagen Bank GmbH 2,500 % fällig am 31.07.2026	15.800	16.333	0,20	4,618 % fällig am 23.03.2032	10.400	11.176	0,14	Laurelin DAC 3,920 % fällig am 20.10.2031	10.900	11.677	0,15
ZF Finance GmbH 2,750 % fällig am 25.05.2027 3,750 % fällig am 21.09.2028	16.200 32.000	15.786 31.501	0,20 0,40	Avoca CLO DAC 3,997 % fällig am 15.10.2032	2.900	3.093	0,04	Madison Park Euro Funding DAC 3,927 % fällig am 15.01.2032	35.500	37.920	0,48
		174.291	2,19	Bain Capital Euro CLO DAC 3,940 % fällig am 20.01.2032	5.468	5.834	0,07	3,977 % fällig am 15.07.2032	5.600	5.959	0,08
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				Black Diamond CLO DAC 4,060 % fällig am 20.01.2032	2.092	2.250	0,03	Man GLG Euro CLO DAC 3,987 % fällig am 15.10.2032	5.194	5.520	0,07
SCUR-Alpha 1503 GmbH 10,602 % fällig am 28.03.2030	\$ 2.494	2.366	0,03	4,303 % fällig am 15.05.2032	4.400	4.696	0,06	4,216 % fällig am 15.12.2031	10.690	11.451	0,14
Summe Deutschland		176.657	2,22	Blackrock European CLO DAC 3,797 % fällig am 15.10.2031	10.900	11.620	0,15	Oak Hill European Credit Partners DAC 3,930 % fällig am 20.01.2032	2.040	2.175	0,03
<b>GHANA</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>				BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 1,050 % fällig am 15.01.2031	994	1.000	0,01	3,940 % fällig am 20.10.2031	15.200	16.150	0,20
Ghana Government International Bond 8,125 % fällig am 26.03.2032 ^	4.200	1.815	0,02	3,897 % fällig am 15.01.2031	7.755	8.289	0,10	OCF Euro CLO DAC 3,997 % fällig am 15.01.2032	2.961	3.189	0,04
8,750 % fällig am 11.03.2061 ^	5.100	2.128	0,03	BNPP AM Euro CLO DAC 3,777 % fällig am 15.04.2031	1.000	1.067	0,01	4,091 % fällig am 22.09.2034	12.700	13.495	0,17
8,950 % fällig am 26.03.2051 ^	5.600	2.348	0,03	Bridgepoint CLO DAC 4,387 % fällig am 15.01.2034	1.300	1.399	0,02	OZLME DAC 4,088 % fällig am 27.07.2032	1.999	2.127	0,03
Summe Ghana		6.291	0,08	Cairn CLO DAC 3,957 % fällig am 15.10.2031	8.600	9.197	0,12	Palmer Square European Loan Funding DAC 3,957 % fällig am 15.04.2031	5.852	6.272	0,08
<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Carlyle Euro CLO DAC 3,877 % fällig am 15.01.2031	11.548	12.335	0,16	4,227 % fällig am 15.10.2031	4.751	5.106	0,06
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	€ 7.400	6.086	0,08	3,953 % fällig am 15.08.2030	4.392	4.684	0,06	Palmerston Park CLO DAC 3,825 % fällig am 18.04.2030	994	1.070	0,01
3,000 % fällig am 29.03.2025	16.606	14.992	0,19	4,213 % fällig am 15.08.2032	4.400	4.693	0,06	Sculptor European CLO DAC 3,916 % fällig am 14.01.2032	6.700	7.181	0,09
Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	200	180	0,00	Summe Irland				Segovia European CLO DAC 4,080 % fällig am 20.07.2032	10.100	10.736	0,14
								Takehou CLO DAC 4,144 % fällig am 04.08.2034	9.400	10.021	0,13
								Toro European CLO DAC 3,995 % fällig am 12.01.2032	2.500	2.675	0,03
								2,907 % fällig am 15.07.2030	267	290	0,00
								4,133 % fällig am 15.02.2034	7.650	8.123	0,10
								Summe Irland		514.452	6,48





BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
4,500 % fällig am 01.03.2025	€ 1.808	\$ 1.955	0,03	4,650 % fällig am 09.04.2024 ^	\$ 3.200	\$ 192	0,00	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
United Group BV				MMK International Capital DAC				Grifols S.A.			
3,625 % fällig am 15.02.2028	1.600	1.389	0,02	4,375 % fällig am 13.06.2024 ^	8.600	516	0,01	5,633 % fällig am 15.11.2027	€ 1.296	\$ 1.393	0,02
5,250 % fällig am 01.02.2030	8.600	7.447	0,09			2.052	0,02	Summe Spanien		77.364	0,97
Volkswagen International Finance NV				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>SRI LANKA</b>			
3,500 % fällig am 17.06.2025	10.100	10.365	0,13	Russia Government International Bond				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
(d)		229.948	2,90	2,875 % fällig am 04.12.2025 ^	€ 7.700	4.893	0,06	Sri Lanka Government International Bond			
				4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	\$ 13.800	6.011	0,08	7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	\$ 16.800	7.735	0,10
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				4,750 % fällig am 27.05.2026 ^	200	101	0,00	7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	5.800	2.670	0,03
WP/AP Telecom Holdings BV				5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	3.200	1.424	0,02	Summe Sri Lanka		10.405	0,13
7,498 % fällig am 30.03.2029	39.000	42.068	0,53	5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	28.000	1.680	0,02				
				Summe Russland		14.109	0,18	<b>SCHWEDEN</b>			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>						16.161	0,20	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
EMF-NL Prime BV				<b>SAUDI-ARABIEN</b>				Castellum AB			
3,977 % fällig am 17.04.2041	21	22	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				0,750 % fällig am 04.09.2026	€ 200	180	0,00
Eurosail BV				Saudi Arabia Government International Bond				Sagax AB			
4,677 % fällig am 17.10.2040	99	108	0,00	3,450 % fällig am 02.02.2061	34.500	24.328	0,31	2,000 % fällig am 17.01.2024	119	127	0,00
		130	0,00	4,875 % fällig am 18.07.2033	20.000	20.004	0,25	2,250 % fällig am 13.03.2025	400	412	0,01
Summe Niederlande		272.146	3,43	5,000 % fällig am 18.01.2053	20.000	18.555	0,23	Volvo Car AB			
				Summe Saudi-Arabien		62.887	0,79	4,250 % fällig am 31.05.2028	29.900	31.394	0,39
<b>NIGERIA</b>								(h)			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Serbien		15.722	0,20	Summe Schweden		32.113	0,40
Nigeria Government International Bond				<b>SERBIEN</b>				<b>SCHWEIZ</b>			
7,143 % fällig am 23.02.2030	\$ 8.200	6.895	0,09	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
7,625 % fällig am 28.11.2047	17.700	12.634	0,16	Serbia Government International Bond				Credit Suisse AG			
7,875 % fällig am 16.02.2032	23.600	19.851	0,25	1,650 % fällig am 03.03.2033	€ 8.900	6.480	0,08	6,500 % fällig am 08.08.2023			
Summe Nigeria		39.380	0,50	6,500 % fällig am 26.09.2033	\$ 9.400	9.242	0,12	(f)	\$ 57.800	57.590	0,73
				Summe Serbien				UBS Group AG			
<b>OMAN</b>				<b>SINGAPUR</b>				3,869 % fällig am 12.01.2029	300	271	0,00
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,125 % fällig am 15.04.2026	15.100	14.410	0,18
Oman Government International Bond				Flex Ltd.				4,194 % fällig am 01.04.2031	1.400	1.247	0,02
6,750 % fällig am 17.01.2048	29.300	28.224	0,36	3,750 % fällig am 01.02.2026	14.000	13.315	0,17	4,703 % fällig am 05.08.2027	1.200	1.147	0,01
				<b>SLOWENIEN</b>				6,442 % fällig am 11.08.2028	3.200	3.214	0,04
<b>PANAMA</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,537 % fällig am 12.08.2033	500	513	0,01
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				Summe Schweiz		78.392	0,99
Panama Government International Bond				1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 8.300	8.759	0,11	<b>TÜRKEI</b>			
6,700 % fällig am 26.01.2036	20.600	22.109	0,28	Nova Ljubljanska Banka d.d.				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				3,400 % fällig am 05.02.2030	7.100	6.584	0,08	Turkey Government International Bond			
<b>PERU</b>				Summe Slowenien		15.343	0,19	4,875 % fällig am 16.04.2043	33.067	21.308	0,27
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>SÜDAFRIKA</b>				5,750 % fällig am 11.05.2047	58.300	39.985	0,50
Peru Government International Bond				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Türkei		61.293	0,77
8,750 % fällig am 21.11.2033	15.000	19.062	0,24	AngloGold Ashanti Holdings PLC				<b>UKRAINE</b>			
				3,750 % fällig am 01.10.2030	\$ 2.000	1.718	0,03	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>PHILIPPINEN</b>				Sasol Financing USA LLC				NPC Ukrenergo			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				5,875 % fällig am 27.03.2024	4.100	4.051	0,05	6,875 % fällig am 09.11.2028 ^	1.000	215	0,00
Philippines Government International Bond				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
5,000 % fällig am 17.07.2033	2.000	2.028	0,03	South Africa Government International Bond				State Agency of Roads of Ukraine			
				5,650 % fällig am 27.09.2047	13.700	9.725	0,12	6,250 % fällig am 24.06.2030 ^	1.400	307	0,00
<b>PORTUGAL</b>				Summe Südafrika		15.494	0,20	Ukraine Government International Bond			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>SPANIEN</b>				4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	€ 67.619	16.121	0,20
Banco Espirito Santo S.A.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,750 % fällig am 20.06.2028 ^	6.300	1.477	0,02
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	€ 200	53	0,00	ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.				6,876 % fällig am 21.05.2031 ^	\$ 6.400	1.478	0,02
Galp Energia SGPS S.A.				1,375 % fällig am 17.06.2025	€ 700	716	0,01	7,375 % fällig am 25.09.2034 ^	5.300	1.244	0,02
2,000 % fällig am 15.01.2026	12.300	12.600	0,16	(h)				8,994 % fällig am 01.02.2026 ^	8.200	2.075	0,03
Summe Portugal		12.653	0,16	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				Summe Ukraine		22.917	0,29
				6,000 % fällig am 29.03.2024	2.800	2.963	0,04	<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>			
<b>KATAR</b>				6,000 % fällig am 15.01.2026	9.200	9.443	0,12	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				(d)(f)				DAE Sukuk Dfc Ltd.			
Nakilat, Inc.				6,138 % fällig am 14.09.2028	\$ 15.800	15.850	0,20	3,750 % fällig am 15.02.2026	11.800	11.230	0,14
6,067 % fällig am 31.12.2033	\$ 9.944	10.438	0,13	Banco de Sabadell S.A.				<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
				5,375 % fällig am 08.09.2026	€ 22.100	23.999	0,30	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>RUMÄNIEN</b>				Banco Santander S.A.				AGPS BondCo PLC			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				3,490 % fällig am 28.05.2030	\$ 1.400	1.222	0,01	4,625 % fällig am 14.01.2026 ^	€ 1.100	468	0,01
Romania Government International Bond				Cellnex Finance Co. S.A.				5,500 % fällig am 13.11.2026 ^	2.000	837	0,01
2,000 % fällig am 14.04.2033	€ 1.500	1.159	0,01	2,000 % fällig am 15.09.2032	€ 23.100	19.882	0,25	Barclays PLC			
2,875 % fällig am 13.04.2042	8.000	5.379	0,07	Lorca Telecom Bondco S.A.				0,577 % fällig am 09.08.2029	2.500	2.186	0,03
6,625 % fällig am 27.09.2029	14.500	16.467	0,21	4,000 % fällig am 18.09.2027	1.900	1.896	0,02	6,125 % fällig am 15.12.2025			
7,625 % fällig am 17.01.2053	\$ 3.000	3.305	0,04			75.971	0,95	(d)(f)	\$ 11.100	9.743	0,12
Summe Rumänien		26.310	0,33					7,437 % fällig am 02.11.2033	8.500	9.201	0,12
				<b>RUSSLAND</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ALROSA Finance S.A.</b>							
ALROSA Finance S.A.				3,100 % fällig am 25.06.2027 ^	22.400	1.344	0,01				









BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
4,009 % fällig am 25.03.2036				\$ 169	0,00	6.500 % fällig am 25.09.2037 ^	\$ 9.108	\$ 3.744	0,05		
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				245	128	6.500 % fällig am 25.11.2037 ^	807	401	0,01		
7,396 % fällig am 01.12.2027	\$ 28.435	\$ 28.433	0,36	65	40	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
CenturyLink, Inc.				133	107	2,948 % fällig am 20.10.2035	3	3	0,00		
7,467 % fällig am 15.03.2027	35.060	27.150	0,34	72	61	3,287 % fällig am 25.09.2037 ^	36	33	0,00		
Charter Communications Operating LLC				8.500	7.693	3,367 % fällig am 25.10.2035 ^	217	173	0,00		
6,795 % - 6,834 % fällig am 01.02.2027	48.472	48.240	0,61	83	67	3,611 % fällig am 25.09.2047 ^	4	3	0,00		
CommScope, Inc.						4,006 % fällig am 20.12.2035	20	17	0,00		
8,443 % fällig am 06.04.2026	770	739	0,01			4,085 % fällig am 25.03.2037 ^	45	40	0,00		
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				205	176	4,123 % fällig am 20.11.2035 ^	80	66	0,00		
6,939 % fällig am 22.06.2026	0	0	0,00	194	180	4,936 % fällig am 25.04.2046 ^	747	238	0,00		
INEOS Styrolution U.S. Holding LLC				45	42	5,500 % fällig am 25.10.2034	384	370	0,01		
7,967 % fällig am 29.01.2026	9.272	9.264	0,12	45	13	5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	115	105	0,00		
Level 3 Financing, Inc.				57	25	5,500 % fällig am 25.10.2035	47	27	0,00		
6,967 % fällig am 01.03.2027	17.978	16.792	0,21	113	61	5,650 % fällig am 25.03.2036	87	71	0,00		
Marriott Ownership Resorts, Inc.						5,690 % fällig am 25.04.2046	7.068	2.057	0,03		
6,943 % fällig am 29.08.2025	871	871	0,01	143	118	5,830 % fällig am 25.03.2035 ^	45	40	0,00		
Standard Industries, Inc.				55	47	6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	120	57	0,00		
7,692 % fällig am 22.09.2028	11.255	11.263	0,14			6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	494	357	0,01		
Summer (BC) Holdco SARRL				29	27	6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	31	14	0,00		
7,712 % fällig am 04.12.2026	€ 5.000	5.155	0,06			6,000 % fällig am 25.09.2037 ^	26	14	0,00		
Zayo Group Holdings, Inc.				23	23	6,250 % fällig am 25.09.2036 ^	618	246	0,00		
8,217 % fällig am 09.03.2027	\$ 600	473	0,01	60	54	6,500 % fällig am 25.11.2036 ^	164	63	0,00		
		148.380	1,87	2.893	2.502	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.					
				131	114	4,311 % fällig am 25.06.2033	10	9	0,00		
				69	61	6,000 % fällig am 25.01.2036 ^	199	112	0,00		
				166	151	6,500 % fällig am 25.04.2033	0	0	0,00		
				3	3	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates					
<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>						3,616 % fällig am 27.09.2035	1.449	1.229	0,02		
Massachusetts Port Authority Revenue Bonds, Series 2011						3,906 % fällig am 28.04.2037	157	145	0,00		
6,202 % fällig am 01.07.2031	465	478	0,01	15	15	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust					
				8	8	6,000 % fällig am 25.07.2036	731	385	0,01		
						6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	165	65	0,00		
				43	38	6,500 % fällig am 25.02.2022 ^	616	75	0,00		
				526	455	6,750 % fällig am 25.08.2036 ^	611	333	0,01		
						7,000 % fällig am 25.08.2037 ^	608	388	0,01		
						Credit Suisse Mortgage Capital Trust					
						3,631 % fällig am 25.10.2043	837	784	0,01		
						Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust					
						5,530 % fällig am 25.08.2047	93	83	0,00		
						Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust					
						5,650 % fällig am 25.02.2035	2.715	2.585	0,03		
						Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.					
						3,746 % fällig am 27.11.2036	59	59	0,00		
						First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
						5,549 % fällig am 25.06.2036 ^	39	31	0,00		
						6,250 % fällig am 25.08.2037 ^	63	27	0,00		
						First Horizon Mortgage Pass-Through Trust					
						4,267 % fällig am 25.09.2035	279	263	0,01		
						GreenPoint Mortgage Funding Trust					
						5,550 % fällig am 25.10.2046 ^	176	159	0,00		
						5,690 % fällig am 25.04.2036 ^	82	78	0,00		
						GSR Mortgage Loan Trust					
						3,575 % fällig am 25.03.2047 ^	259	169	0,00		
						3,914 % fällig am 25.04.2035	16	14	0,00		
						3,935 % fällig am 25.01.2036 ^	11	11	0,00		
						4,481 % fällig am 25.11.2035	41	40	0,00		
						4,662 % fällig am 25.09.2035	19	19	0,00		
						4,662 % fällig am 25.09.2035	13	13	0,00		
						5,490 % fällig am 25.12.2034	5	4	0,00		
						5,750 % fällig am 25.02.2036	147	127	0,00		
						5,750 % fällig am 25.03.2036 ^	35	32	0,00		
						5,750 % fällig am 25.01.2037 ^	92	57	0,00		
						6,000 % fällig am 25.02.2036 ^	356	183	0,00		
						6,500 % fällig am 25.09.2036 ^	253	126	0,00		
						6,970 % fällig am 25.04.2032	25	21	0,00		
						HarborView Mortgage Loan Trust					
						4,063 % fällig am 19.06.2036 ^	170	77	0,00		
						4,226 % fällig am 19.08.2036 ^	42	33	0,00		
						4,227 % fällig am 19.07.2035 ^	2	2	0,00		
						4,688 % fällig am 19.08.2036 ^	1	1	0,00		
						5,637 % fällig am 19.06.2035	219	209	0,00		
						5,697 % fällig am 19.03.2035	20	20	0,00		
						5,777 % fällig am 19.11.2035	96	69	0,00		
						5,857 % fällig am 19.01.2035	215	190	0,00		
						HomeBanc Mortgage Trust					
						5,510 % fällig am 25.12.2036	24	23	0,00		
						5,650 % fällig am 25.03.2035	94	76	0,00		
						5,670 % fällig am 25.01.2036	105	100	0,00		
						HSI Asset Securitization Corp. Trust					
						5,590 % fällig am 25.11.2035	1.223	1.144	0,02		





BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (e)	7.821.400	\$ 71.097	0,90	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	9.278.795	\$ 92.398	1,16	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	2.698.640	\$ 268.056	3,37
						527.926	6,65				
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (e)	33.191.429	333.242	4,20					Summe Anlagefonds*		\$ 795.982	10,02

\* Das Engagement des Diversified Income Fund in den Anlagefonds stieg etwas über 10 %. Ab dem 3. Juli 2023 erfüllte der Fonds die Vorgaben wieder.

#### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,080 %	30.06.2023	07.07.2023	\$ 250.000	U.S. Treasury Notes 0,250 % - 1,875 % fällig am 31.07.2025 - 31.08.2027	\$ (255.041)	\$ 250.000	\$ 250.247	3,15
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	1.600	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031	(1.640)	1.600	1.601	0,02
BRC	5,120	30.06.2023	03.07.2023	401.800	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.04.2025	(410.212)	401.800	401.971	5,07
	5,130	30.06.2023	03.07.2023	97.700	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.08.2051	(100.088)	97.700	97.742	1,23
	5,180	30.06.2023	03.07.2023	343.200	U.S. Treasury Bonds 2,250 % - 4,250 % fällig am 15.05.2039 - 15.08.2046	(353.153)	343.200	343.348	4,32
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	37.737	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(38.492)	37.737	37.737	0,48
	5,060	30.06.2023	03.07.2023	67.700	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2027	(69.054)	67.700	67.729	0,85
MBC	5,160	30.06.2023	03.07.2023	36.100	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032	(37.293)	36.100	36.116	0,45
TDM	5,160	30.06.2023	03.07.2023	800	U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 31.03.2028	(821)	800	800	0,01
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.265.794)	\$ 1.236.637	\$ 1.237.291	15,58

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

#### AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	156	\$ (67)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1.739	(2.734)	(0,03)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	8.584	7.405	0,09
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	3.590	(10.143)	(0,13)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	8.296	(16.784)	(0,22)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	7.062	(13.331)	(0,17)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	802	(983)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	2.569	4.369	0,06
				\$ (32.268)	(0,41)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (32.268)	(0,41)

#### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 18.200	\$ 75	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	12.800	(138)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	4.400	32	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	1.300	(7)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	6	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	1.200	6	0,00
CCO Holdings LLC	5,000	20.12.2027	21.000	63	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2023	3.700	(641)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2024	600	8	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	1.300	38	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	800	35	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Diversified Income Fund (Forts.)

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.06.2027	\$ 6.900	\$ 136	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	14.300	389	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	35.000	149	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	4.300	0	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2026	4.200	(339)	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2025	€ 35.900	(4.245)	(0,05)
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2027	26.000	(3.310)	(0,04)
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	18.600	1.003	0,01
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2028	11.000	185	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	40.600	(143)	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	\$ 1.400	6	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2026	€ 19.300	(272)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2027	8.300	282	0,00
				\$ (6.682)	(0,08)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	\$ 55.500	\$ 1.361	0,02
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	69.102	349	0,00
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	527.500	14.785	0,19
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	270.800	1.929	0,02
				\$ 18.424	0,23

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.09.2025	£ 21.100	\$ 3.581	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053	5.100	(459)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	46.400	2.960	0,04
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 12.250.000	(196)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	0,880	03.03.2024	CAD 273.400	(9.072)	(0,11)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2029	91.700	(8.700)	(0,11)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,520	07.07.2027	€ 127.500	(6.726)	(0,09)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	4.400	(54)	0,00
					\$ (18.666)	(0,24)
					\$ (6.924)	(0,09)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.06.2028	\$ 22.000	\$ (1.915)	\$ 375	\$ (1.540)	(0,02)
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2031	61.600	(2.646)	1.374	(1.272)	(0,02)
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 1.200	113	(195)	(82)	0,00
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30.06.2029	\$ 5.000	0	155	155	0,00
FBF	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 4.400	415	(715)	(300)	0,00
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20.12.2026	7.400	(46)	(1.782)	(1.828)	(0,02)
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	41.200	4.386	(7.197)	(2.811)	(0,03)
JPM	Hochtief AG	5,000	20.12.2026	16.400	3.874	(1.560)	2.314	0,03
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	1.000	92	(160)	(68)	0,00
MYC	Intrum AB	5,000	20.12.2024	6.400	650	(1.087)	(437)	(0,01)
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	8.200	893	(1.452)	(559)	(0,01)
					\$ 5.816	\$ (12.244)	\$ (6.428)	(0,08)

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	08.2023	AUD	1.954	\$	1.322	\$	20	0,00		
	08.2023	\$	131	CNY	900	(7)	(7)	0,00		
	08.2023		7.940	€	7.334	(5)	77	0,00		
BPS	08.2023		1.443	£	1.140	0	7	0,00		
	07.2023	€	1.991.475	\$	2.140.851	(31.849)	(31.849)	(0,40)		
	08.2023		5.358		5.745	(113)	(113)	0,00		
	08.2023	\$	155	CNY	1.058	(8)	(8)	0,00		
	08.2023		61.924	€	56.604	(83)	(41)	0,00		
BRC	08.2023		3.032	£	2.381	(4)	(4)	0,00		
	12.2023	MXN	10.668	\$	598	(5)	(5)	0,00		
	08.2023	¥	31.340		237	0	19	0,00		
	08.2023	\$	32.808	€	30.341	0	362	0,00		
	08.2023		24.085	£	19.305	0	464	0,01		
CBK	07.2023		2.165.160	€	1.991.475	0	7.541	0,10		
	08.2023	AUD	199	\$	131	(2)	(2)	0,00		
	08.2023	CAD	458		343	(3)	(3)	0,00		
	08.2023	CNH	43		6	0	0	0,00		
	08.2023	€	2.024.945		2.204.411	(7.855)	(7.855)	(0,10)		
	08.2023	£	288.389		359.632	(7.100)	(7.100)	(0,09)		
	08.2023	NOK	741		71	0	2	0,00		
	08.2023	SEK	2.188		216	0	13	0,00		
	08.2023	\$	12.313	€	11.366	(6)	113	0,00		
	08.2023		1.037	£	837	0	27	0,00		
GLM	08.2023	NOK	941	\$	89	0	1	0,00		
	07.2023	\$	599	MXN	10.335	0	3	0,00		
JPM	08.2023	CAD	752	\$	563	(6)	(6)	0,00		
	08.2023	\$	163	CNY	1.116	(9)	(9)	0,00		
	08.2023		15.106	€	13.975	(2)	172	0,00		
	08.2023		20.786	£	16.411	0	84	0,00		
	09.2023	INR	28.628	\$	347	(1)	(1)	0,00		
MBC	10.2023	MXN	66.385		3.781	(15)	(15)	0,00		
	08.2023	CAD	2.323		1.746	(11)	(11)	0,00		
	08.2023	\$	320.729	€	290.653	(2.971)	(2.971)	(0,04)		
MYI	07.2023	£	173	\$	219	(1)	(1)	0,00		
	07.2023	MXN	1.300		76	0	0	0,00		
	07.2023	\$	50	AUD	76	0	0	0,00		
	07.2023		2.148	€	1.972	0	3	0,00		
	07.2023		5.954	£	4.718	0	45	0,00		
RBC	08.2023	AUD	172	\$	115	0	0	0,00		
	08.2023	€	2.630		2.878	0	2	0,00		
	08.2023	¥	448.787		3.377	0	252	0,00		
	08.2023	\$	6.193	€	5.704	0	43	0,00		
	09.2023	INR	6.183	\$	75	0	0	0,00		
	07.2023	\$	3.836	MXN	73.804	0	460	0,01		
	08.2023	MXN	186	\$	11	0	0	0,00		
	08.2023	\$	4.080	£	3.229	0	26	0,00		
	08.2023	€	26.474	\$	28.686	(257)	(257)	0,00		
	08.2023	\$	3.295	€	3.051	0	40	0,00		
SCX	08.2023	€	26.951	\$	29.590	0	126	0,00		
	08.2023	\$	434	CNY	2.963	(24)	(24)	0,00		
SOG	09.2023	INR	17.904	\$	217	0	0	0,00		
	07.2023	\$	766	PLN	3.302	0	46	0,00		
TOR	08.2023	¥	206.694	\$	1.559	0	120	0,00		
	08.2023		2.411		1.784	(40)	(40)	0,00		
UAG	08.2023	\$	7.132	€	6.577	0	58	0,00		
	08.2023		18.170	£	14.375	0	110	0,00		
	09.2023	SGD	39	\$	29	0	0	0,00		
	09.2023	\$	1.156	ZAR	20.273	0	(91)	(91)	0,00	
				\$	10.291	\$	(50.468)	\$	(40.177)	(0,51)

#### ABGESICHERTE DEISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2023	AUD	2.656	\$	1.763	\$	(5)	0,00
	07.2023	\$	3.278	AUD	5.009	0	56	0,00
	08.2023		1.764		2.656	0	5	0,00
BOA	07.2023	AUD	10	\$	7	0	0	0,00
	07.2023	\$	6.607	AUD	10.160	0	156	0,01
BPS	07.2023	AUD	13.951	\$	9.237	(49)	(49)	0,00
	07.2023	\$	5	AUD	7	0	0	0,00
	08.2023		9.014		13.598	0	45	0,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Diversified Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	AUD 82	\$ 56	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2023	\$ 2.120	AUD 3.250	43	0	43	0,00
JPM	07.2023	3.226	AUD 4.935	59	0	59	0,00
MBC	07.2023	AUD 21	\$ 14	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	4.686	3.111	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	\$ 2.580	AUD 3.948	48	0	48	0,00
	08.2023	3.113	AUD 4.686	8	0	8	0,00
SOG	07.2023	5.127	7.837	89	0	89	0,00
TOR	07.2023	AUD 8.181	\$ 5.404	0	(42)	(42)	0,00
	07.2023	\$ 5.447	AUD 8.329	97	0	97	0,00
	08.2023	5.408	8.181	42	0	42	0,00
UAG	07.2023	AUD 15.788	\$ 10.483	20	(46)	(26)	0,00
	07.2023	\$ 2.624	AUD 4.009	44	0	44	0,00
	08.2023	10.481	15.772	46	(20)	26	0,00
				\$ 759	\$ (170)	\$ 589	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 105.228	CAD 143.182	\$ 2.977	\$ 0	\$ 2.977	0,04
BPS	07.2023	CAD 2.101	\$ 1.589	1	0	1	0,00
CBK	07.2023	700	527	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 3.605	CAD 4.913	107	0	107	0,00
JPM	07.2023	105.613	143.280	2.665	0	2.665	0,03
MBC	07.2023	CAD 2.517	\$ 1.870	0	(32)	(32)	0,00
RBC	07.2023	\$ 3	CAD 4	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	106.146	144.161	2.799	0	2.799	0,04
TOR	07.2023	CAD 256.526	\$ 193.615	80	(326)	(246)	0,00
	08.2023	\$ 193.615	CAD 256.424	327	(79)	248	0,00
				\$ 8.956	\$ (439)	\$ 8.517	0,11

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF 9.120	\$ 10.197	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07.2023	\$ 13.850	CHF 12.530	155	0	155	0,00
	08.2023	10.197	9.094	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07.2023	CHF 39	\$ 43	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	114	127	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 7	CHF 6	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CHF 277	\$ 307	0	(4)	(4)	0,00
RBC	07.2023	577	646	1	0	1	0,00
RYL	07.2023	4	5	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	\$ 10.007	CHF 8.992	43	0	43	0,00
UAG	07.2023	CHF 9.523	\$ 10.623	0	(21)	(21)	0,00
	07.2023	\$ 9.049	CHF 8.131	39	0	39	0,00
	08.2023	10.508	9.392	21	0	21	0,00
				\$ 262	\$ (28)	\$ 234	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) ausschüttend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 4.702	\$ 5.124	\$ 6	\$ (12)	\$ (6)	0,00
	07.2023	\$ 1.094.208	€ 1.018.148	16.593	0	16.593	0,21
BPS	07.2023	€ 1.020.099	\$ 1.117.700	4.777	(5)	4.772	0,06
	07.2023	\$ 1.092.384	€ 1.016.164	16.252	0	16.252	0,20
	08.2023	1.110.013	1.011.642	0	(4.801)	(4.801)	(0,06)
CBK	07.2023	€ 1.034.212	\$ 1.124.010	9	(4.326)	(4.317)	(0,05)
	08.2023	\$ 1.082.832	€ 994.579	3.740	0	3.740	0,05
JPM	07.2023	€ 1.011.775	\$ 1.104.758	910	0	910	0,01
	07.2023	\$ 45.124	€ 42.205	921	0	921	0,01
	08.2023	1.106.303	1.011.775	0	(945)	(945)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 22.691	\$ 24.437	16	(335)	(319)	0,00
SOG	07.2023	\$ 1.093.128	€ 1.016.164	15.509	0	15.509	0,19
				\$ 58.733	\$ (10.424)	\$ 48.309	0,61

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 304	\$ 384	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	07.2023	\$ 86	£ 67	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	£ 1.386	\$ 1.723	2	(42)	(40)	0,00
	07.2023	\$ 359.899	£ 290.972	10.028	0	10.028	0,13
BRC	07.2023	£ 345	\$ 434	1	(5)	(4)	0,00
	07.2023	\$ 1.045	£ 839	22	0	22	0,00
CBK	07.2023	£ 1.141	\$ 1.444	1	(8)	(7)	0,00
	07.2023	\$ 112	£ 88	1	0	1	0,00
JPM	07.2023	£ 292.056	\$ 369.275	0	(2.031)	(2.031)	(0,03)
	08.2023	\$ 369.354	£ 292.056	2.026	0	2.026	0,03
MBC	07.2023	£ 114	\$ 146	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 362.027	£ 292.451	9.780	0	9.780	0,12
MYI	07.2023	£ 118	\$ 147	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	\$ 358.803	£ 288.691	8.224	0	8.224	0,10
TOR	07.2023	£ 292.594	\$ 371.799	0	(190)	(190)	0,00
	08.2023	\$ 371.880	£ 292.594	184	0	184	0,00
				\$ 30.270	\$ (2.283)	\$ 27.987	0,35

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklasse Administrative JPY (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	¥ 3.024	\$ 22	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2023	\$ 884	¥ 122.915	0	(34)	(34)	0,00
BPS	07.2023	884	122.915	0	(34)	(34)	0,00
SCX	07.2023	797	110.715	0	(31)	(31)	0,00
				\$ 1	\$ (99)	\$ (98)	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklasse Institutional MXN (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	MXN 147.822	\$ 8.587	\$ 0	\$ (33)	\$ (33)	0,00
	07.2023	\$ 6.653	MXN 119.686	325	0	325	0,01
	08.2023	8.539	147.822	34	0	34	0,00
BRC	07.2023	MXN 147.434	\$ 8.581	0	(15)	(15)	0,00
	08.2023	\$ 8.533	MXN 147.434	17	0	17	0,00
CBK	07.2023	MXN 147.434	\$ 8.578	0	(18)	(18)	0,00
	07.2023	\$ 6.235	MXN 112.151	304	0	304	0,00
	08.2023	8.994	155.434	20	0	20	0,00
GLM	07.2023	3.127	56.273	154	0	154	0,00
MYI	07.2023	1.286	22.238	11	0	11	0,00
	08.2023	227	3.892	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07.2023	1.247	21.601	12	0	12	0,00
SCX	07.2023	6.165	110.741	292	0	292	0,00
				\$ 1.169	\$ (67)	\$ 1.102	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK 57.153	\$ 5.296	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	08.2023	\$ 5.212	SEK 56.179	0	(5)	(5)	0,00
CBK	07.2023	3.570	38.996	40	0	40	0,00
MBC	07.2023	3.494	37.631	0	(10)	(10)	0,00
MYI	07.2023	SEK 56.273	\$ 5.212	2	0	2	0,00
	07.2023	\$ 5.026	SEK 53.949	0	(31)	(31)	0,00
	08.2023	5.212	56.203	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2023	3.501	37.867	5	0	5	0,00
				\$ 51	\$ (48)	\$ 3	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$ 29.664	SGD 40.139	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
GLM	07.2023	SGD 942	\$ 701	6	0	6	0,00
	07.2023	\$ 542	SGD 729	0	(3)	(3)	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Diversified Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
JPM	07.2023	SGD 40.283	\$ 29.769	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07.2023	\$ 3.907	SGD 5.287	0	0	0	0,00
	08.2023	29.769	40.245	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023	27.101	36.616	0	(45)	(45)	0,00
	08.2023	60	81	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD 39.938	\$ 29.556	46	(1)	45	0,00
	08.2023	\$ 28.847	SGD 38.943	0	(43)	(43)	0,00
UAG	07.2023	29.482	39.880	0	(15)	(15)	0,00
				\$ 55	\$ (114)	\$ (59)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 39.979	0,50
Summe Anlagen						\$ 8.139.607	102,48
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (196.890)	(2,48)
Nettovermögen						\$ 7.942.717	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,18 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc. 2,572 % fällig am 03.06.2031	26.05.2020	\$ 6.900	\$ 5.760	0,07
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	92	92	0,00
Corestate Capital Holding S.A. 15,000 % fällig am 31.07.2023	06.12.2022	1.785	1.873	0,02
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	25.05.2021 - 29.07.2021	1.122	867	0,01
Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032	12.08.2022 - 16.08.2022	2.323	2.195	0,03
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	8.869	8.513	0,11
General Motors Co. 6,800 % fällig am 01.10.2027	07.05.2020	699	728	0,01
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2020 - 29.10.2021	16.083	4.235	0,05
		\$ 37.873	\$ 24.263	0,30

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 62.998 USD (31. Dezember 2022: 6.805 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 4.245 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 288 USD (31. Dezember 2022: 277 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 192.048 USD (31. Dezember 2022: 268.487 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 17.052 USD (31. Dezember 2022: 9.202 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.070.952	\$ 35.249	\$ 6.106.201
Investmentfonds	795.982	0	0	795.982
Pensionsgeschäfte	0	1.236.637	0	1.236.637
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	4.603	(3.971)	155	787
Summen	\$ 800.585	\$ 7.303.618	\$ 35.404	\$ 8.139.607

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.595.189	\$ 25.428	\$ 6.620.617
Investmentfonds	609.289	267.341	0	876.630
Pensionsgeschäfte	0	1.746.323	0	1.746.323
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	69	(18.207)	0	(18.138)
<b>Summen</b>	<b>\$ 609.358</b>	<b>\$ 8.590.646</b>	<b>\$ 25.428</b>	<b>\$ 9.225.432</b>

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	2,750 %	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (17.524)	\$ (19.189)	(0,24)
	3,050	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(666)	(729)	(0,01)
JML	2,500	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(17.980)	(19.681)	(0,25)
	2,500	06.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(2.528)	(2.762)	(0,03)
	2,500	08.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(2.124)	(2.321)	(0,03)
	2,500	12.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(1.273)	(1.390)	(0,02)
MYI	1,500	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(3.011)	(3.293)	(0,04)
	1,750	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(4.384)	(4.794)	(0,06)
	2,500	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(3.343)	(3.655)	(0,05)
	2,500	26.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(4.921)	(5.381)	(0,07)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (63.195)</b>	<b>(0,80)</b>

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 56	\$ (40)	\$ 16	\$ 58	\$ 0	\$ 58
BOA	18.240	(14.110)	4.130	941	(920)	21
BPS	(5.365)	6.570	1.205	650	(800)	(150)
BRC	(494)	670	176	(2.633)	2.650	17
CBK	(7.352)	4.410	(2.942)	(1.931)	1.730	(201)
DUB	155	(180)	(25)	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	(300)	260	(40)	(104)	260	156
GLM	158	0	158	233	(250)	(17)
GST	(4.639)	4.592	(47)	(2.878)	2.952	74
JPM	6.080	(5.590)	490	2.534	(3.820)	(1.286)
MBC	6.393	(3.110)	3.283	27.060	(25.160)	1.900
MYC	(437)	270	(167)	(152)	260	108
MYI	7.982	(5.140)	2.842	(196)	260	64
RBC	499	(300)	199	(385)	430	45
RYL	(217)	280	63	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	3.258	(3.110)	148	561	(330)	231
SOG	15.644	(11.550)	4.094	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	213	(140)	73	(772)	660	(112)
UAG	105	0	105	302	0	302

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	53,21	48,23
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	23,55	25,74
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,12	1,67
Investmentfonds	10,02	10,02
Pensionsgeschäfte	15,58	19,95
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,41)	(0,32)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,09)	(0,15)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,50	0,27
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,80)	(0,08)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Albanien	0,21	0,18
Argentinien	0,64	0,52
Australien	0,08	0,07
Weissrussland	k. A.	0,03
Bermuda	0,82	0,72
Brasilien	0,00	0,00
Kanada	0,45	0,29
Cayman-Inseln	1,86	2,14
Chile	0,08	0,08
China	0,01	0,03
Kolumbien	0,47	0,42
Zypern	0,20	0,17
Dänemark	0,16	0,14
Dominikanische Republik	0,44	0,38
Ecuador	0,21	0,25
Ägypten	0,50	0,56
Finnland	0,05	0,08
Frankreich	2,25	3,16
Deutschland	2,22	3,24
Ghana	0,08	0,06
Guernsey, Kanalinseln	0,27	0,54
Hongkong	0,27	0,98
Indien	k. A.	0,02
Indonesien	0,91	0,60
International	0,11	k. A.
Irland	6,48	6,34
Israel	k. A.	0,11
Italien	3,87	3,95
Elfenbeinküste	0,17	0,12
Japan	0,52	0,92
Jersey, Kanalinseln	1,03	1,02
Jordanien	0,05	k. A.
Kasachstan	0,07	k. A.
Liberia	0,02	k. A.
Luxemburg	3,21	3,92
Mazedonien	0,09	0,08
Mauritius	k. A.	0,08
Mexiko	2,03	1,79
Multinational	0,37	0,33
Niederlande	3,43	3,82
Nigeria	0,50	0,41
Oman	0,36	0,31
Panama	0,28	0,25
Peru	0,24	k. A.
Philippinen	0,03	k. A.
Portugal	0,16	0,14
Katar	0,13	0,12
Rumänien	0,33	0,07
Russland	0,20	0,29
Saudi-Arabien	0,79	k. A.
Serbien	0,20	0,07
Singapur	0,17	0,15
Slowenien	0,19	0,16
Südafrika	0,20	0,09
Spanien	0,97	0,97
Sri Lanka	0,13	0,08
Schweden	0,40	0,37
Schweiz	0,99	1,22
Türkei	0,77	0,70
Ukraine	0,29	0,22
Vereinigte Arabische Emirate	0,14	0,13
Großbritannien	5,55	7,14
USA	28,18	22,65
Venezuela	0,03	0,03
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	0,06
Kurzfristige Instrumente	2,02	2,87
Investmentfonds	10,02	10,02
Pensionsgeschäfte	15,58	19,95
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,41)	(0,32)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,08)	(0,12)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,23	0,18
Zinsswaps	(0,24)	(0,21)
Freiverkehrsinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,08)	(0,02)
Devisenterminkontrakte	(0,51)	(0,76)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,09	1,05
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,48)	(5,41)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>IRLAND</b>				<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>MAZEDONIEN</b>			
Aurium CLO DAC 3,907 % fällig am 16.01.2031	€ 300	\$ 321	0,06	G City Europe Ltd. 1,250 % fällig am 11.09.2025	€ 1.800	\$ 1.718	0,33	North Macedonia Government International Bond 2,750 % fällig am 18.01.2025	€ 300	\$ 312	0,06
Bain Capital Euro CLO DAC 3,940 % fällig am 20.01.2032	1.988	2.122	0,41	Summe Jersey, Kanalinseln		6.593	1,26	<b>MEXIKO</b>			
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 4,100 % fällig am 20.01.2032	200	213	0,04	<b>KASACHSTAN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Harvest CLO DAC 4,027 % fällig am 15.01.2032	2.500	2.670	0,51	KazMunayGas National Co. JSC 6,375 % fällig am 24.10.2048	\$ 400	343	0,07	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Laurelin DAC 3,920 % fällig am 20.10.2031	1.100	1.178	0,23	<b>LUXEMBURG</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Palmerston Park CLO DAC 3,825 % fällig am 18.04.2030	265	285	0,06	<b>STAMMAKTIEN</b>				<b>Mexico Government International Bond</b>			
Sculptor European CLO DAC 3,916 % fällig am 14.01.2032	800	857	0,16	Adler Group S.A. (d)	3.908	2	0,00	3,771 % fällig am 24.05.2061	1.600	1.092	0,21
Toro European CLO DAC 3,995 % fällig am 12.01.2032	300	321	0,06	Adler Group S.A.	8.653	5	0,00	5,400 % fällig am 09.02.2028	2.800	2.854	0,55
4,133 % fällig am 15.02.2034	750	796	0,15	DrillCo Holding Lux S.A. (d)	130	2	0,00			3.946	0,76
		8.763	1,68	DrillCo Holding Lux S.A. (d)(j)	61.666	1.185	0,23	Summe Mexiko		12.039	2,31
				Intelsat Emergence S.A. (d)(j)	14.398	331	0,06	<b>MULTINATIONAL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Stammaktien		1.525	0,29	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC</b>				<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				<b>Allied Universal Holdco LLC</b>			
2,700 % fällig am 11.06.2023 ^	2.800	458	0,09	Corestate Capital Holding S.A. 1,375 % fällig am 31.07.2023 ^	€ 2.000	318	0,06	3,625 % fällig am 01.06.2028	€ 1.700	1.490	0,28
Bank of Ireland Group PLC 6,253 % fällig am 16.09.2026	\$ 700	696	0,13	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Connect Finco SARRL 6,750 % fällig am 01.10.2026	\$ 1.000	972	0,19
		1.154	0,22	Albion Financing SARRL 5,250 % fällig am 15.10.2026	1.300	1.339	0,26	Summe multinational		2.462	0,47
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				6,125 % fällig am 15.10.2026	\$ 500	470	0,09	<b>NIEDERLANDE</b>			
Setanta Aircraft Leasing DAC 7,538 % fällig am 05.11.2028	4.000	4.005	0,77	Altice Financing S.A. 5,750 % fällig am 15.08.2029	3.000	2.327	0,45	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Summe Irland		13.922	2,67	Altice France Holding S.A. 6,000 % fällig am 15.02.2028	700	342	0,06	ASR Nederland NV 7,000 % fällig am 07.12.2043	€ 100	114	0,02
<b>ITALIEN</b>				Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	1.200	889	0,17	Athora Netherlands NV 7,000 % fällig am 19.06.2025 (g)(i)	200	206	0,04
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK) 3,000 % fällig am 31.12.2026 (c)	147	87	0,02	CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	100	97	0,02
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % fällig am 28.04.2025	€ 900	922	0,18	Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % fällig am 31.07.2023 ^	€ 3.500	539	0,10	1,500 % fällig am 27.09.2031	100	76	0,02
8,000 % fällig am 22.01.2030	2.700	2.649	0,51	CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	1.000	595	0,11	Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % fällig am 18.03.2033	2.000	1.581	0,30
Intesa Sanpaolo SpA 5,148 % fällig am 10.06.2030	£ 100	103	0,02	1,750 % fällig am 14.01.2030	1.400	927	0,18	ING Groep NV 6,500 % fällig am 16.04.2025 (g)(i)	\$ 1.300	1.214	0,23
5,500 % fällig am 01.03.2028 (g)(i)	€ 750	686	0,13	Cromwell Ereit Lux Finco SARRL 2,125 % fällig am 19.11.2025	400	377	0,07	6,750 % fällig am 16.04.2024 (g)(i)	€ 600	574	0,11
Mundys SpA 1,625 % fällig am 03.02.2025	300	313	0,06	FORESEA Holding S.A. 7,500 % fällig am 15.06.2030	\$ 638	558	0,11	NE Property BV 3,375 % fällig am 14.07.2027	€ 1.500	1.471	0,28
1,875 % fällig am 12.02.2028	5.000	4.664	0,89	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 4,250 % fällig am 06.04.2024 ^	£ 1.900	2.137	0,41	NN Group NV 4,500 % fällig am 15.01.2026 (g)	1.100	1.162	0,22
SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029 (k)	2.600	2.371	0,45	Greensairf Pipelines Bidco SARRL 6,129 % fällig am 23.02.2038	\$ 1.100	1.125	0,21	Q-Park Holding BV 3,500 % fällig am 01.02.2025	2.600	2.656	0,51
UniCredit SpA 7,296 % fällig am 02.04.2034	\$ 900	849	0,16	Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030	1.072	979	0,19	Syngenta Finance NV 4,892 % fällig am 24.04.2025	\$ 1.276	1.250	0,24
7,830 % fällig am 04.12.2023	4.900	4.929	0,95	Logicor Financing SARRL 3,250 % fällig am 13.11.2028	€ 1.000	934	0,18	United Group BV 5,250 % fällig am 01.02.2030	€ 600	520	0,10
Summe Italien		17.486	3,35	Tierra Mojada Luxembourg SARRL 5,750 % fällig am 01.12.2040	\$ 2.011	1.722	0,33	Volkswagen International Finance NV 3,500 % fällig am 17.06.2025 (g)	900	924	0,18
<b>ELFENBEINKÜSTE</b>						15.347	2,94	ZF Europe Finance BV 2,000 % fällig am 23.02.2026	100	99	0,02
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>						11.944	2,29
Ivory Coast Government International Bond 5,750 % fällig am 31.12.2032	2.985	2.792	0,54	<b>RECHTE</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
				Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025	3.012	18	0,01	<b>WP/AP Telecom Holdings BV</b>			
<b>JAPAN</b>				Summe Luxemburg		19.651	3,77	7,498 % fällig am 30.03.2029	2.900	3.128	0,60
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>AKTIEN</b>				Summe Niederlande		15.072	2,89
Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	3.200	2.913	0,56	<b>RECHTE</b>				<b>NIGERIA</b>			
4,810 % fällig am 17.09.2030	200	175	0,03					<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Summe Japan		3.088	0,59					Nigeria Government International Bond 7,625 % fällig am 28.11.2047	\$ 1.300	928	0,18
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>								7,696 % fällig am 23.02.2038	400	301	0,06
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								7,875 % fällig am 16.02.2032	1.800	1.514	0,29
AA Bond Co. Ltd. 5,500 % fällig am 31.07.2050	£ 2.200	2.440	0,47					Summe Nigeria		2.743	0,53
Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % fällig am 15.08.2024	€ 45	48	0,01					<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Corsair International Ltd. 7,772 % fällig am 28.01.2027	1.600	1.737	0,33					<b>Nigeria Government International Bond</b>			
8,122 % fällig am 28.01.2029	600	650	0,12								



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
<b>OMAN</b>				<b>SCHWEDEN</b>				<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>3,823 % fällig am 03.11.2028</b>				
Oman Government International Bond				Volvo Car AB				6,750 % fällig am 24.06.2024	1.500	\$	1.352	0,26
6,750 % fällig am 17.01.2048	1.600	1.541	0,30	4,250 % fällig am 31.05.2028	€ 2.000	\$ 2.100	0,40	(g)(i)	£	700	835	0,16
<b>PERU</b>				<b>SCHWEIZ</b>				<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>4,250 % fällig am 15.01.2030</b>				
Peru Government International Bond				Credit Suisse AG				Virgin Money UK PLC				
8,750 % fällig am 21.11.2033	1.000	1.271	0,24	6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)	\$ 2.800	2.790	0,54	4,000 % fällig am 03.09.2027	1.400	1.558	0,30	
<b>RUMÄNIEN</b>				<b>TÜRKEI</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>				
Romania Government International Bond				Turkey Government International Bond				5,635 % fällig am 20.10.2051	1.635	2.081	0,40	
2,000 % fällig am 14.04.2033	€ 600	464	0,09	4,875 % fällig am 16.04.2043	1.200	773	0,15	Summe Großbritannien		20.349	3,90	
2,875 % fällig am 13.04.2042	600	403	0,08	5,750 % fällig am 11.05.2047	4.900	3.361	0,64	<b>USA</b>				
5,000 % fällig am 27.09.2026	2.000	2.192	0,42	Summe Schweiz		3.437	0,66	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
Summe Rumänien		3.059	0,59	<b>UKRAINE</b>				<b>Ames Mortgage Investment Trust</b>				
<b>RUSSLAND</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>5,930 % fällig am 25.10.2035</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>6,350 % fällig am 25.06.2035</b>				
Russia Government International Bond				NPC Ukrenergo				Accredited Mortgage Loan Trust				
4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	\$ 600	261	0,05	6,875 % fällig am 09.11.2028 ^	800	172	0,03	5,870 % fällig am 25.09.2035	101	99	0,02	
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	200	89	0,02	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>				
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	1.400	84	0,01	Ukraine Government International Bond				5,520 % fällig am 25.02.2037	2.455	1.065	0,20	
Summe Russland		434	0,08	4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	€ 4.400	1.049	0,20	5,750 % fällig am 25.02.2036	67	66	0,01	
<b>SAUDI-ARABIEN</b>				<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				<b>Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Certificates</b>				
Saudi Arabia Government International Bond				DAE Sukuk Dfvc Ltd.				5,855 % fällig am 25.11.2035	61	60	0,01	
3,450 % fällig am 02.02.2061	1.400	987	0,19	3,750 % fällig am 15.02.2026	900	856	0,16	8,525 % fällig am 25.11.2032 ^	479	468	0,09	
4,500 % fällig am 26.10.2046	1.200	1.054	0,20	<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>Argent Securities Trust</b>				
4,875 % fällig am 18.07.2033	2.500	2.501	0,48	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>5,470 % fällig am 25.05.2036</b>				
Summe Saudi-Arabien		4.542	0,87	AGPS BondCo PLC				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
<b>SERBIEN</b>				<b>AGPS BondCo PLC</b>				<b>4,705 % fällig am 25.12.2035</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>6,155 % fällig am 25.06.2035</b>				
Serbia Government International Bond				Barclays PLC				6,950 % fällig am 25.07.2034	21	21	0,00	
6,500 % fällig am 26.09.2033	1.000	983	0,19	5,875 % fällig am 15.09.2024	£	200	0,04	Carrington Mortgage Loan Trust				
<b>SLOWENIEN</b>				<b>Barclays PLC</b>				<b>5,410 % fällig am 25.02.2037</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>6,200 % fällig am 25.05.2035</b>				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				7,750 % fällig am 15.09.2023	\$	600	0,11	Countrywide Asset-Backed Certificates				
1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 1.000	1.055	0,20	(g)(i)	£	200	0,04	6,250 % fällig am 25.05.2047 ^	796	604	0,12	
Nova Ljubljanska Banka d.d.				Bellis Acquisition Co. PLC				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
3,400 % fällig am 05.02.2030	600	557	0,11	3,250 % fällig am 16.02.2026	£	2.100	0,43	3,221 % fällig am 25.03.2036	68	66	0,01	
Summe Slowenien		1.612	0,31	Greene King Finance PLC				5,330 % fällig am 25.11.2047 ^	537	508	0,10	
<b>SÜDAFRIKA</b>				<b>Greene King Finance PLC</b>				<b>5,630 % fällig am 25.02.2037 ^</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>5,675 % fällig am 25.08.2036</b>				
AngloGold Ashanti Holdings PLC				John Lewis PLC				5,990 % fällig am 25.10.2047	1.854	1.762	0,34	
3,750 % fällig am 01.10.2030	\$ 200	172	0,03	4,250 % fällig am 18.12.2034	£	400	0,06	6,200 % fällig am 25.11.2034	63	62	0,01	
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>John Lewis PLC</b>				<b>6,725 % fällig am 25.11.2034</b>				
South Africa Government International Bond				4,975 % fällig am 11.08.2033	\$	400	0,07	Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				
5,650 % fällig am 27.09.2047	1.200	852	0,17	Market Bidco Finco PLC				5,710 % fällig am 25.04.2034	176	157	0,03	
Summe Südafrika		1.024	0,20	4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 1.500	1.322	0,25	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
<b>SPANIEN</b>				<b>Mitchells &amp; Butlers Finance PLC</b>				<b>4,599 % fällig am 25.01.2032</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Ellington Loan Acquisition Trust</b>				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				5,451 % fällig am 15.12.2030	£	194	0,04	6,200 % fällig am 25.05.2037	323	304	0,06	
6,000 % fällig am 15.01.2026	€ 800	821	0,16	6,002 % fällig am 15.12.2030	\$	777	0,14	First Franklin Mortgage Loan Trust				
6,138 % fällig am 14.09.2028	\$ 600	602	0,11	6,469 % fällig am 15.09.2032	£	332	0,07	6,425 % fällig am 25.07.2034	136	133	0,03	
Banco de Sabadell S.A.				NatWest Group PLC				Fremont Home Loan Trust				
5,375 % fällig am 08.09.2026	€ 1.700	1.846	0,35	6,000 % fällig am 29.12.2025	\$	1.700	0,30	5,690 % fällig am 25.04.2036	282	251	0,05	
Lorca Telecom Bondco S.A.				Pinnacle Bidco PLC				6,080 % fällig am 25.06.2035 ^	700	620	0,12	
4,000 % fällig am 18.09.2027	300	299	0,06	5,500 % fällig am 15.02.2025	€	100	0,02	GSAA Home Equity Trust				
Summe Spanien		3.568	0,68	6,375 % fällig am 15.02.2025	£	200	0,05	5,270 % fällig am 25.11.2036	75	19	0,00	
<b>SRI LANKA</b>				<b>NatWest Group PLC</b>				<b>GSAMP Trust</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>5,200 % fällig am 25.12.2046</b>				
Sri Lanka Government International Bond				5,500 % fällig am 15.02.2025	€	100	0,02	5,240 % fällig am 25.01.2037	24	12	0,00	
7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	\$ 1.000	461	0,09	6,375 % fällig am 15.02.2025	£	200	0,05	5,630 % fällig am 25.06.2036	42	24	0,00	
7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	600	276	0,05	<b>Summe Sri Lanka</b>				<b>5,630 % fällig am 25.08.2036</b>				
Summe Sri Lanka		737	0,14					<b>5,885 % fällig am 25.09.2035 ^</b>				
								<b>Home Equity Asset Trust</b>				
								<b>6,245 % fällig am 25.05.2035</b>				
								<b>Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust</b>				
								<b>5,530 % fällig am 25.06.2036</b>				
								<b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b>				
								<b>3,815 % fällig am 25.07.2036</b>				
								<b>5,340 % fällig am 25.03.2047</b>				
								<b>5,410 % fällig am 25.06.2037</b>				
								<b>5,450 % fällig am 25.07.2036</b>				
								<b>5,450 % fällig am 25.03.2037</b>				



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Zayo Group Holdings, Inc. 4,000 % fällig am 01.03.2027	\$ 300	\$ 212	0,04	5,697 % fällig am 20.10.2045 5,777 % fällig am 19.11.2035	\$ 291 3	\$ 259 2	0,05 0,00	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b> <b>KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>			
		68.106	13,05	HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,590 % fällig am 25.11.2035	1.396	1.306	0,25	Corestate Capital Holding S.A. 15,000 % fällig am 31.07.2023 (j)	€ 200	\$ 220	0,04
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				IndyMac Mortgage Loan Trust 3,103 % fällig am 25.06.2037 ^	10	9	0,00	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
Adient U.S. LLC 8,334 % fällig am 10.04.2028	1		0,00	3,677 % fällig am 25.12.2036 ^	2	2	0,00	(28,578) % fällig am 18.10.2023 (e)(f)	ARS 843	2	0,00
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 7,396 % fällig am 01.12.2027	2.145	2.145	0,41	5,510 % fällig am 25.07.2047	54	37	0,01	(12,549) % fällig am 23.11.2023 (e)(f)	823	2	0,00
CenturyLink, Inc. 7,467 % fällig am 15.03.2027	3.729	2.888	0,56	Lehman Mortgage Trust 6,000 % fällig am 25.09.2037 ^	102	94	0,02			4	0,00
Charter Communications Operating LLC 6,795 % - 6,834 % fällig am 01.02.2027	5.188	5.163	0,99	Luminant Mortgage Trust 5,550 % fällig am 25.10.2046	675	603	0,12	<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
CommScope, Inc. 8,443 % fällig am 06.04.2026	481	462	0,09	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 4,459 % fällig am 25.05.2036 5,810 % fällig am 25.11.2029	3 1	3 1	0,00 0,00	5,238 % fällig am 17.08.2023 (b)(e)(f)(l)	\$ 8.500	8.445	1,62
Level 3 Financing, Inc. 6,967 % fällig am 01.03.2027	1.626	1.519	0,29	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 4,148 % fällig am 25.03.2036 ^	31	20	0,00	Summe kurzfristige Instrumente		8.669	1,66
Standard Industries, Inc. 7,692 % fällig am 22.09.2028	1.313	1.314	0,25	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust 4,937 % fällig am 25.08.2035	1	1	0,00	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 359.563	68,93	
		13.492	2,59	Residential Accredited Loans, Inc. Trust 5,550 % fällig am 25.05.2047	59	53	0,01	<b>AKTIEN</b>			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 5,590 % fällig am 25.06.2037	197	174	0,03	<b>INVESTMENTFONDS</b> <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Banc of America Alternative Loan Trust 5,550 % fällig am 25.01.2037 ^	84	65	0,01	Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,550 % fällig am 25.05.2036 5,570 % fällig am 25.09.2047 ^	446 569	358 471	0,07 0,09	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (h)	250.000	2.235	0,43
Banc of America Funding Trust 4,416 % fällig am 20.01.2047 ^	42	39	0,01	SunTrust Alternative Loan Trust 5,750 % fällig am 25.12.2035 ^	2	2	0,00	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)	651.264	5.920	1,13
BCAP LLC Trust 6,250 % fällig am 26.08.2036	1.928	897	0,17	Thornburg Mortgage Securities Trust 6,400 % fällig am 25.06.2037 ^	11	10	0,00	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (h)	538.168	6.095	1,17
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 6,800 % fällig am 25.02.2036	6	6	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 5,176 % fällig am 25.11.2042	5	5	0,00	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (h)	3.624.810	36.393	6,98
Citigroup Mortgage Loan Trust 3,620 % fällig am 25.10.2046 ^	20	18	0,00	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 4,022 % fällig am 25.09.2036 ^	126	37	0,01	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (h)	19.218	191	0,04
5,410 % fällig am 25.10.2035	63	59	0,01			6.584	1,26			50.834	9,75
Countrywide Alternative Loan Trust 5,456 % fällig am 25.01.2036	10	10	0,00	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>							
5,550 % fällig am 25.07.2036 ^	3	1	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.12.2052	954	950	0,18	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
5,577 % fällig am 20.05.2046 ^	279	237	0,05	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2053	10.100	9.899	1,90	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)	5.570	553	0,10
5,650 % fällig am 25.04.2036	555	209	0,04	5,500 % fällig am 01.08.2053	9.400	9.354	1,79				
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	137	75	0,01	6,000 % fällig am 01.08.2053	4.200	4.236	0,81				
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	852	379	0,07	6,500 % fällig am 01.07.2053	6.200	6.331	1,22				
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	198	115	0,02			30.770	5,90				
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 4,085 % fällig am 25.03.2037 ^	8	7	0,00	Summe USA		144.573	27,71				
4,936 % fällig am 25.04.2046 ^	17	5	0,00	<b>VENEZUELA</b>							
5,690 % fällig am 25.04.2046	1.715	499	0,10	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	334	145	0,03	Petroleos de Venezuela S.A. 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	1.600	62	0,01				
6,000 % fällig am 25.07.2037	66	25	0,01	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
6,500 % fällig am 25.11.2036 ^	107	41	0,01	Venezuela Government International Bond 6,000 % fällig am 09.12.2020 ^		15	0,00				
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 6,500 % fällig am 25.04.2033	0	0	0,00	7,000 % fällig am 31.03.2038 ^		134	0,03				
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 3,387 % fällig am 26.04.2038	75	72	0,01	7,750 % fällig am 13.10.2019 ^		114	0,02				
3,616 % fällig am 27.09.2035	98	83	0,02			263	0,05				
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust 4,267 % fällig am 25.09.2035	12	11	0,00	Summe Venezuela		325	0,06				
HarborView Mortgage Loan Trust 5,597 % fällig am 19.05.2035	149	136	0,03								
5,637 % fällig am 19.06.2035	3	3	0,00								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOS	5,170 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 91.100	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	\$ (93.785)	\$ 91.100	\$ 91.139	17,47
BPS	5,100	30.06.2023	03.07.2023	100	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 %, fällig am 15.01.2030	(102)	100	100	0,02
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	7.100	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025	(7.251)	7.100	7.103	1,36
	5,170	30.06.2023	03.07.2023	5.800	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.10.2051	(6.004)	5.800	5.802	1,11
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	3.266	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(3.331)	3.266	3.266	0,63
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (110.473)	\$ 107.366	\$ 107.410	20,59

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	24	\$ (33)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	344	(983)	(0,19)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	242	(482)	(0,09)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	556	(1.095)	(0,21)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	117	32	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	201	329	0,06
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2023	23	(24)	0,00
				\$ (2.256)	(0,43)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (2.256)	(0,43)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 1.900	\$ (19)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	300	2	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	2	0,00
CCO Holdings LLC	5,000	20.12.2027	1.000	4	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	1.000	26	0,01
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2025	€ 3.300	(390)	(0,08)
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	4.100	222	0,04
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	4.000	(13)	0,00
				\$ (166)	(0,03)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000 %	20.12.2027	\$ 4.455	\$ 162	0,03
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	33.600	942	0,18
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	26.400	198	0,04
				\$ 1.302	0,25

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabel Zinssatz	variabel Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day	GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	20.09.2028	£ 13.300	\$ 851	0,16
Erhalt	1-Day	JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	¥ 940.000	(32)	(0,01)
Zahlung	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	\$ 22.300	(318)	(0,06)
Zahlung	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	17.09.2023	33.800	(463)	(0,09)
Erhalt	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	67.100	70	0,01
Erhalt	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	22.300	4.150	0,80
Erhalt	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2025	33.800	3.959	0,76
Erhalt	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	20.600	(151)	(0,03)
Erhalt	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	14.000	(16)	0,00
Erhalt	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	30.200	1.787	0,34
Erhalt	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	56.400	2.531	0,49
Erhalt	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	82.400	2.675	0,51
Zahlung	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2026	27.700	(429)	(0,08)
Erhalt	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	55.700	1.219	0,23
Erhalt	3-Month	USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	22.300	320	0,06
Erhalt	3-Month	USD-LIBOR	0,000	17.09.2023	33.800	465	0,09
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month	EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 2.000	(27)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month	EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	34.500	(115)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month	EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	2.100	(23)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month	EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	26.800	(9)	0,00
						\$ 16.444	3,15
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 17.580	3,37

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.06.2028	\$ 2.000	\$ (174)	\$ 34	\$ (140)	(0,03)
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2031	5.500	(236)	122	(114)	(0,02)
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20.12.2026	€ 700	(5)	(168)	(173)	(0,03)
JPM	Hochtief AG	5,000	20.12.2026	2.700	643	(262)	381	0,07
					\$ 228	\$ (274)	\$ (46)	(0,01)

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2023	\$ 5.057	€ 4.647	\$ 23	\$ 0	\$ 23	0,01
BPS	07.2023	123.254	€ 112.489	0	(529)	(529)	(0,10)
	08.2023	€ 113.365	\$ 124.367	532	(17)	515	0,10
	08.2023	\$ 9.906	€ 9.061	12	(12)	0	0,00
BRC	08.2023	3.528	\$ 3.258	34	0	34	0,01
	08.2023	714	€ 563	2	0	2	0,00
CBK	08.2023	€ 3.047	\$ 3.297	0	(34)	(34)	(0,01)
	08.2023	€ 15.761	\$ 19.655	0	(388)	(388)	(0,07)
	08.2023	\$ 1.929	€ 1.776	13	(1)	12	0,00
GLM	07.2023	BRL 2.961	\$ 550	0	(64)	(64)	(0,01)
	07.2023	\$ 615	BRL 2.970	1	0	1	0,00
	09.2023	BRL 3.003	\$ 615	0	(1)	(1)	0,00
JPM	08.2023	€ 399	\$ 496	0	(12)	(12)	0,00
	08.2023	\$ 1.433	€ 1.131	6	0	6	0,00
MBC	08.2023	10.058	€ 9.115	0	(93)	(93)	(0,02)
MYI	07.2023	149	€ 137	0	0	0	0,00
	07.2023	1.407	€ 1.115	11	0	11	0,00
	08.2023	¥ 33.066	\$ 249	18	0	18	0,01
	08.2023	\$ 456	€ 421	4	0	4	0,00
RBC	08.2023	276	€ 219	2	0	2	0,00
	08.2023	98	MXN 1.707	0	0	0	0,00
RYL	08.2023	€ 2.879	\$ 3.120	0	(28)	(28)	(0,01)
SCX	08.2023	2.917	\$ 3.203	14	0	14	0,00
	08.2023	\$ 564	€ 455	15	0	15	0,00
SOG	07.2023	€ 112.489	\$ 121.009	0	(1.717)	(1.717)	(0,33)
SSB	09.2023	\$ 322	BRL 1.634	13	0	13	0,00
TOR	08.2023	¥ 15.229	\$ 115	9	0	9	0,00
UAG	08.2023	\$ 1.343	€ 1.238	11	0	11	0,00
	08.2023	1.252	€ 991	8	0	8	0,00
				\$ 728	\$ (2.896)	\$ (2.168)	(0,42)

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 123	\$ 134	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 52.328	€ 48.691	793	0	793	0,15
BPS	07.2023	€ 48.084	\$ 52.685	225	0	225	0,04
	07.2023	\$ 52.299	€ 48.649	777	0	777	0,15
	08.2023	52.470	€ 47.820	0	(227)	(227)	(0,04)
CBK	07.2023	€ 49.186	\$ 53.491	8	(179)	(171)	(0,03)
	07.2023	\$ 94	€ 87	2	0	2	0,00
	08.2023	50.210	€ 46.117	173	0	173	0,03
JPM	07.2023	€ 47.687	\$ 52.069	43	0	43	0,01
	08.2023	\$ 52.142	€ 47.687	0	(44)	(44)	(0,01)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2023	€ 1.079	\$ 1.165	\$ 1	\$ (13)	\$ (12)	0,00
	07.2023	\$ 31	€ 29	1	0	1	0,00
SOG	07.2023	52.268	48.588	742	0	742	0,14
				\$ 2.765	\$ (463)	\$ 2.302	0,44

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	\$ 91.940	£ 74.332	\$ 2.563	\$ 0	\$ 2.563	0,49
BRC	07.2023	£ 149	\$ 189	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 2	£ 1	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£ 146	\$ 183	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	\$ 10	£ 8	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	£ 75.705	\$ 95.722	0	(527)	(527)	(0,10)
	08.2023	\$ 95.742	£ 75.705	525	0	525	0,10
MBC	07.2023	£ 45	\$ 58	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 93.623	£ 75.625	2.523	0	2.523	0,49
MYI	07.2023	93.094	74.903	2.134	0	2.134	0,41
TOR	07.2023	£ 75.975	\$ 96.541	0	(49)	(49)	(0,01)
	08.2023	\$ 96.562	£ 75.975	48	0	48	0,01
				\$ 7.793	\$ (579)	\$ 7.214	1,39
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 7.302	1,40
Summe Anlagen						\$ 540.942	103,71
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (19.375)	(3,71)
Nettovermögen						\$ 521.567	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (j) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,17 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 18	\$ 18	0,00
Corestate Capital Holding S.A. 15,000 %, fällig am 31.07.2023	06.12.2022	210	220	0,04
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	1.233	1.185	0,23
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2020 - 01.05.2020	1.289	331	0,06
		\$ 2.750	\$ 1.754	0,33

- (k) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 365 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.
- (l) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 391 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von 740 USD (31. Dezember 2022: 1.278 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.
- Barmittel in Höhe von 27.426 USD (31. Dezember 2022: 19.045 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.



Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 5	\$ 356.569	\$ 2.989	\$ 359.563
Investmentfonds	51.387	0	0	51.387
Pensionsgeschäfte	0	107.366	0	107.366
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(57)	22.683	0	22.626
<b>Summen</b>	<b>\$ 51.335</b>	<b>\$ 486.618</b>	<b>\$ 2.989</b>	<b>\$ 540.942</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 399.799	\$ 1.785	\$ 401.584
Investmentfonds	55.254	552	0	55.806
Pensionsgeschäfte	0	102.832	0	102.832
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.425	12.723	0	14.148
<b>Summen</b>	<b>\$ 56.679</b>	<b>\$ 515.906</b>	<b>\$ 1.785</b>	<b>\$ 574.370</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
JML	2,500 %	06.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (337)	\$ (368)	(0,07)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (368)</b>	<b>(0,07)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ (14)	\$ 0	\$ (14)
BOA	676	(470)	206	(31)	0	(31)
BPS	3.324	(2.750)	574	104	0	104
BRC	(78)	0	(78)	(270)	208	(62)
CBK	(409)	391	(18)	1.636	(1.510)	126
GLM	(64)	20	(44)	(204)	270	66
GST	(173)	0	(173)	(179)	0	(179)
JPM	372	(410)	(38)	27	(80)	(53)
MBC	2.419	(1.790)	629	(1.015)	800	(215)
MYI	2.167	(1.550)	617	4	(28)	(24)
RBC	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(28)	0	(28)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	29	0	29	1.547	(1.450)	97
SOG	(975)	720	(255)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	13	0	13	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	8	(10)	(2)	65	(120)	(55)
UAG	19	0	19	26	0	26

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	43,25	38,87
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	25,45	30,57
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,23	1,69
Investmentfonds	9,85	9,88
Pensionsgeschäfte	20,59	18,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,43)	0,25
Zentral abgerechnete Finanzderivate	3,37	1,95
Freiverkehrsfinanzderivate	1,40	0,30
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,07)	k. A.



Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,65	0,45
Weissrussland	k. A.	0,05
Bermuda	0,70	0,54
Brasilien	0,00	0,00
Kanada	0,59	0,42
Cayman-Inseln	2,09	2,11
Chile	k. A.	0,09
China	0,06	0,08
Kolumbien	0,44	0,40
Zypern	0,20	0,17
Dänemark	0,17	0,15
Dominikanische Republik	0,43	0,38
Ecuador	0,20	0,24
Ägypten	0,51	0,59
Finnland	0,15	0,09
Frankreich	2,22	3,32
Deutschland	1,57	3,45
Ghana	0,07	0,06
Guernsey, Kanalinseln	0,17	0,43
Hongkong	0,31	1,08
Indien	k. A.	0,05
Indonesien	0,69	0,45
Irland	2,67	2,38
Italien	3,35	4,15
Elfenbeinküste	0,54	k. A.
Japan	0,59	1,11
Jersey, Kanalinseln	1,26	1,16
Kasachstan	0,07	k. A.
Luxemburg	3,77	5,22
Mazedonien	0,06	0,05
Mauritius	k. A.	0,13
Mexiko	2,31	1,67
Multinational	0,47	0,42
Niederlande	2,89	3,96
Nigeria	0,53	0,44
Oman	0,30	0,27
Peru	0,24	k. A.
Katar	k. A.	0,22
Rumänien	0,59	0,14
Russland	0,08	0,14
Saudi-Arabien	0,87	k. A.
Serbien	0,19	k. A.
Slowenien	0,31	0,27
Südafrika	0,20	0,07
Spanien	0,68	0,62
Sri Lanka	0,14	0,09
Schweden	0,40	0,35
Schweiz	0,66	0,58
Türkei	0,79	0,85
Ukraine	0,26	0,20
Vereinigte Arabische Emirate	0,16	0,15
Großbritannien	3,90	4,30
USA	27,71	22,26
Jungferinseln (Britisch)	k. A.	0,08
Venezuela	0,06	0,07
Kurzfristige Instrumente	1,66	5,18
Investmentfonds	9,85	9,88
Pensionsgeschäfte	20,59	18,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,43)	0,25
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	(0,03)	(0,12)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,25	0,23
Zinsswaps	3,15	1,84
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	(0,01)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,42)	(0,46)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,83	0,77
Sonstige Aktiva und Passiva	(3,71)	(1,72)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ECUADOR STAATSEMISSIONEN</b>				<b>INDONESIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
<b>ARGENTINIEN STAATSEMISSIONEN</b>				Ecuador Government International Bond				Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia						
Argentina Government International Bond				2,500 % fällig am 31.07.2035	\$ 400	\$ 140	0,24	4,700 % fällig am 06.06.2032	\$ 500	\$ 496	0,86			
3,500 % fällig am 09.07.2041	\$ 900	\$ 290	0,50	<b>ÄGYPTEN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>IRLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
<b>AUSTRALIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Egypt Government International Bond				Bank of Ireland Group PLC						
FMG Resources Pty. Ltd.				6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 400	243	0,42	6,253 % fällig am 16.09.2026	200	199	0,34			
4,375 % fällig am 01.04.2031	200	171	0,30	<b>FINNLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				GE Capital UK Funding Unlimited Co.						
<b>BERMUDA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Nokia Oyj				5,875 % fällig am 18.01.2033				€ 50	61	0,11
NCL Corp. Ltd.				3,125 % fällig am 15.05.2028	100	103	0,18	Perrigo Finance Unlimited Co.						
8,375 % fällig am 01.02.2028	200	209	0,36	4,375 % fällig am 21.08.2031	100	108	0,18	4,650 % fällig am 15.06.2030	\$ 200	177	0,30			
<b>BRASILIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>												437	0,75	
Banco BTG Pactual S.A.				<b>FRANKREICH UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ITALIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
2,750 % fällig am 11.01.2026	100	91	0,16	Accor S.A.				Intesa Sanpaolo SpA						
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				2,375 % fällig am 29.11.2028				8,248 % fällig am 21.11.2033				50	52	0,09
Brazil Government International Bond				Altice France S.A.				Mundys SpA						
5,000 % fällig am 27.01.2045	200	157	0,27	5,125 % fällig am 15.07.2029				1,875 % fällig am 12.02.2028				€ 200	187	0,32
Summe Brasilien		248	0,43	AXA S.A.				Nexi SpA						
<b>KANADA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,500 % fällig am 11.07.2043				2,125 % fällig am 30.04.2029				100	91	0,16
Air Canada Pass-Through Trust				Chrome Bidco SASU				Telecom Italia SpA						
5,250 % fällig am 01.10.2030	411	399	0,69	3,500 % fällig am 31.05.2028				1,625 % fällig am 18.01.2029				100	84	0,14
B. C. Unlimited Liability Co.				Crown European Holdings S.A.									414	0,71
4,000 % fällig am 15.10.2030	350	300	0,52	2,875 % fällig am 01.02.2026										
		699	1,21	Forvia				<b>ELFENBEINKÜSTE STAATSEMISSIONEN</b>						
<b>CAYMAN INSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				JCDecaux SE				Ivory Coast Government International Bond						
Avolon Holdings Funding Ltd.				5,000 % fällig am 11.01.2029				6,125 % fällig am 15.06.2033				\$ 100	88	0,15
2,528 % fällig am 18.11.2027	100	84	0,14	Loxam S.A.S.				<b>JAPAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
Seagate HDD Cayman				4,500 % fällig am 15.02.2027				Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.						
3,125 % fällig am 15.07.2029	50	39	0,07	Societe Generale S.A.				5,475 % fällig am 22.02.2031				200	199	0,34
5,750 % fällig am 01.12.2034	200	178	0,31	6,691 % fällig am 10.01.2034				Mizuho Financial Group, Inc.						
		301	0,52	Vilmorin & Cie S.A.				3,490 % fällig am 05.09.2027				€ 300	319	0,55
<b>CHILE STAATSEMISSIONEN</b>				1,375 % fällig am 26.03.2028				Norinchukin Bank						
Chile Government International Bond								5,430 % fällig am 09.03.2028				\$ 200	202	0,35
3,100 % fällig am 07.05.2041	300	226	0,39					Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.						
<b>KOLUMBIEN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>DEUTSCHLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,472 % fällig am 14.01.2029				100	85	0,15
Colombia Government International Bond				Deutsche Bank AG				Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.						
5,000 % fällig am 15.06.2045	300	210	0,36	1,625 % fällig am 20.01.2027				5,500 % fällig am 09.03.2028				200	202	0,35
7,500 % fällig am 02.02.2034	300	294	0,51	1,875 % fällig am 23.02.2028									1.007	1,74
		504	0,87	3,742 % fällig am 07.01.2033				<b>KASACHSTAN STAATSEMISSIONEN</b>						
<b>COSTA RICA STAATSEMISSIONEN</b>				Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				Kazakhstan Government International Bond						
Costa Rica Government International Bond				1,875 % fällig am 31.03.2028				6,500 % fällig am 21.07.2045				200	212	0,37
5,625 % fällig am 30.04.2043	250	215	0,37	€ 50				<b>LIBERIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
<b>DÄNEMARK UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Schaeffler AG				Royal Caribbean Cruises Ltd.						
TDC Net A/S				3,375 % fällig am 12.10.2028				4,250 % fällig am 01.07.2026				350	322	0,56
5,618 % fällig am 06.02.2030	€ 300	321	0,55	ZF Finance GmbH				<b>LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK STAATSEMISSIONEN</b>				2,000 % fällig am 06.05.2027				Altice Financing S.A.						
Dominican Republic Government International Bond								5,750 % fällig am 15.08.2029				200	155	0,27
4,500 % fällig am 30.01.2030	\$ 300	264	0,45	<b>HONGKONG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Logicor Financing SARL						
6,500 % fällig am 15.02.2048	400	346	0,60	Lenovo Group Ltd.				1,625 % fällig am 17.01.2030				€ 200	162	0,28
		610	1,05	6,536 % fällig am 27.07.2032									317	0,55
<b>INDIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNGARN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>MEXIKO STAATSEMISSIONEN</b>						
ReNew Power Pvt Ltd.				Hungary Government International Bond				Mexico Government International Bond						
5,875 % fällig am 05.03.2027	275	258	0,44	2,125 % fällig am 22.09.2031				4,875 % fällig am 19.05.2033				\$ 500	478	0,82
				6,750 % fällig am 25.09.2052				5,750 % fällig am 12.10.2110				175	157	0,27
													635	1,09

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>MAROKKO</b>				<b>PERU</b>				<b>HSBC Holdings PLC</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>3,973 % fällig am 22.05.2030</b>			
Morocco Government International Bond				Peru Government International Bond				Land Securities Capital Markets PLC			
3,000 % fällig am 15.12.2032	\$ 200	159	0,27	3,000 % fällig am 15.01.2034	\$ 200	167	0,29	4,875 % fällig am 15.09.2034	£ 100	121	0,21
<b>MULTINATIONAL</b>				<b>PHILIPPINEN</b>				<b>Lloyds Banking Group PLC</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>7,500 % fällig am 27.06.2024</b>			
Allied Universal Holdco LLC				Philippines Government International Bond				(a)(c)	\$ 50	48	0,08
3,625 % fällig am 01.06.2028	€ 100	88	0,15	5,500 % fällig am 17.01.2048	250	257	0,44	Marks & Spencer PLC			
American Airlines, Inc.				<b>POLEN</b>				4,500 % fällig am 10.07.2027	£ 100	113	0,20
5,500 % fällig am 20.04.2026	\$ 50	49	0,09	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				National Grid PLC			
5,750 % fällig am 20.04.2029	300	291	0,50	Poland Government International Bond				3,875 % fällig am 16.01.2029	€ 300	325	0,56
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>RUMANIEN</b>				<b>NatWest Group PLC</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>0,780 % fällig am 26.02.2030</b>			
AerCap Holdings NV				Romania Government International Bond				Standard Chartered PLC			
5,875 % fällig am 10.10.2079	200	189	0,32	1,750 % fällig am 13.07.2030	€ 100	84	0,14	0,800 % fällig am 17.11.2029	200	178	0,31
Citycon Treasury BV				6,625 % fällig am 27.09.2029	75	85	0,15	6,301 % fällig am 09.01.2029	\$ 50	50	0,09
1,625 % fällig am 12.03.2028	€ 100	80	0,14	7,625 % fällig am 17.01.2053	\$ 200	220	0,38	Virgin Media Secured Finance PLC			
Cooperative Rabobank UA				<b>SERBIEN</b>				4,125 % fällig am 15.08.2030	£ 100	99	0,17
3,758 % fällig am 06.04.2033	\$ 300	261	0,45	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Vmed O2 UK Financing PLC			
CTP NV				Serbia Government International Bond				4,500 % fällig am 15.07.2031	200	194	0,33
1,250 % fällig am 21.06.2029	€ 100	79	0,13	1,650 % fällig am 03.03.2033	€ 200	146	0,25	Vodafone Group PLC			
Digital Dutch Finco BV				<b>SINGAPUR</b>				5,125 % fällig am 04.06.2081	\$ 300	218	0,38
1,000 % fällig am 15.01.2032	200	154	0,26	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Weir Group PLC			
Enel Finance International NV				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				2,200 % fällig am 13.05.2026	200	179	0,31
2,250 % fällig am 12.07.2031	\$ 50	39	0,07	<b>SUDAFRIKA</b>							
2,875 % fällig am 11.04.2029	£ 300	317	0,55	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
ING Groep NV				South Africa Government International Bond							
4,125 % fällig am 24.08.2033	€ 100	103	0,18	4,850 % fällig am 30.09.2029	60	53	0,09	<b>USA</b>			
JDE Peet's NV				5,650 % fällig am 27.09.2047	60	42	0,07	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
2,250 % fällig am 24.09.2031	\$ 50	39	0,07	5,750 % fällig am 30.09.2049	300	213	0,37	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust			
NE Property BV				<b>SPANIEN</b>				5,520 % fällig am 15.02.2055	97	92	0,16
3,375 % fällig am 14.07.2027	€ 100	98	0,17	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
Prosus NV				Abertis Infraestructuras S.A.				5,450 % fällig am 25.08.2036	45	44	0,08
3,061 % fällig am 13.07.2031	\$ 200	157	0,27	3,375 % fällig am 27.11.2026	€ 100	113	0,19				
Sensata Technologies BV				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.							
4,000 % fällig am 15.04.2029	300	267	0,46	6,138 % fällig am 14.09.2028	\$ 200	201	0,35				
Universal Music Group NV				Banco de Sabadell S.A.							
4,000 % fällig am 13.06.2031	€ 100	109	0,19	0,875 % fällig am 16.06.2028	€ 100	92	0,16				
Wabtec Transportation Netherlands BV				CaixaBank S.A.							
1,250 % fällig am 03.12.2027	50	47	0,08	3,750 % fällig am 07.09.2029	100	108	0,19				
		1.939	3,34	Cellnex Finance Co. S.A.							
<b>OMAN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Oman Government International Bond				Grifols S.A.							
6,000 % fällig am 01.08.2029	\$ 100	100	0,17	2,250 % fällig am 15.11.2027	300	297	0,51				
6,750 % fällig am 17.01.2048	200	193	0,34			1.155	1,99				
		293	0,51	<b>SCHWEDEN</b>							
<b>PANAMA</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
Carnival Corp.				Atlantica Sustainable Infrastructure PLC							
4,000 % fällig am 01.08.2028	100	89	0,15	4,125 % fällig am 15.06.2028	\$ 250	223	0,38				
<b>PARAGUAY</b>				<b>GROSSBRITANNIEN</b>							
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Paraguay Government International Bond				Barclays PLC							
5,400 % fällig am 30.03.2050	300	257	0,44	7,437 % fällig am 02.11.2033	200	216	0,37				
				Berkeley Group PLC							
				2,500 % fällig am 11.08.2031	£ 100	83	0,14				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
CCO Holdings LLC				Kraft Heinz Foods Co.				Topaz Solar Farms LLC			
4,250 % fällig am 01.02.2031	\$ 100	\$ 81	0,14	3,750 % fällig am 01.04.2030	\$ 50	\$ 46	0,08	5,750 % fällig am 30.09.2039	\$ 200	\$ 196	0,34
4,500 % fällig am 01.05.2032	275	220	0,38	6,500 % fällig am 09.02.2040	100	108	0,19	TopBuild Corp.			
CenterPoint Energy Houston Electric LLC				Lamb Weston Holdings, Inc.				3,625 % fällig am 15.03.2029	250	218	0,38
5,300 % fällig am 01.04.2053	200	205	0,35	4,375 % fällig am 31.01.2032	200	179	0,31	Travel + Leisure Co.			
Charter Communications Operating LLC				Level 3 Financing, Inc.				4,625 % fällig am 01.03.2030	250	212	0,37
3,950 % fällig am 30.06.2062	200	123	0,21	3,625 % fällig am 15.01.2029	50	30	0,05	Twilio, Inc.			
Chobani LLC				LPL Holdings, Inc.				3,625 % fällig am 15.03.2029	200	170	0,29
4,625 % fällig am 15.11.2028	300	273	0,47	4,000 % fällig am 15.03.2029	50	44	0,08	Uber Technologies, Inc.			
Clearway Energy Operating LLC				Marvell Technology, Inc.				4,500 % fällig am 15.08.2029	200	184	0,32
3,750 % fällig am 15.02.2031	275	228	0,39	4,875 % fällig am 22.06.2028	50	49	0,08	United Airlines Pass-Through Trust			
Comcast Corp.				Moody's Corp.				5,875 % fällig am 15.04.2029	72	71	0,12
4,650 % fällig am 15.02.2033	200	199	0,34	2,000 % fällig am 19.08.2031	250	202	0,35	United Airlines, Inc.			
CommScope Technologies LLC				Morgan Stanley				4,625 % fällig am 15.04.2029	200	182	0,31
6,000 % fällig am 15.06.2025	100	93	0,16	5,123 % fällig am 01.02.2029	330	326	0,56	United Rentals North America, Inc.			
CommScope, Inc.				MPH Acquisition Holdings LLC				3,875 % fällig am 15.02.2031	200	173	0,30
4,750 % fällig am 01.09.2029	200	158	0,27	5,750 % fällig am 01.11.2028	100	75	0,13	Verizon Communications, Inc.			
Community Health Systems, Inc.				MSCI, Inc.				1,500 % fällig am 18.09.2030	50	40	0,07
4,750 % fällig am 15.02.2031	200	151	0,26	3,625 % fällig am 01.09.2030	50	43	0,07	2,850 % fällig am 03.09.2041	300	214	0,37
Coty, Inc.				National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.				VMware, Inc.			
5,000 % fällig am 15.04.2026	300	288	0,50	1,350 % fällig am 15.03.2031	200	153	0,26	2,200 % fällig am 15.08.2031	200	157	0,27
Covanta Holding Corp.				NCR Corp.				4,500 % fällig am 15.05.2025	50	49	0,08
4,875 % fällig am 01.12.2029	200	173	0,30	5,125 % fällig am 15.04.2029	200	177	0,31	Wells Fargo & Co.			
Credit Acceptance Corp.				Netflix, Inc.				4,540 % fällig am 15.08.2026	100	98	0,17
6,625 % fällig am 15.03.2026	200	192	0,33	4,875 % fällig am 15.06.2030	300	296	0,51	Wisconsin Power & Light Co.			
Cross, Inc.				Newell Brands, Inc.				4,950 % fällig am 01.04.2033	200	198	0,34
4,250 % fällig am 15.03.2029	50	43	0,07	6,000 % fällig am 01.04.2046	240	190	0,33	WMG Acquisition Corp.			
Crown Castle, Inc.				OneMain Finance Corp.				2,250 % fällig am 15.08.2031	€ 400	348	0,60
2,500 % fällig am 15.07.2031	300	247	0,43	3,500 % fällig am 15.01.2027	250	215	0,37	Yum! Brands, Inc.			
3,100 % fällig am 15.11.2029	50	44	0,08	Open Text Holdings, Inc.				4,625 % fällig am 31.01.2032	\$ 100	91	0,16
CVS Health Corp.				4,125 % fällig am 15.02.2030	100	85	0,15	ZF North America Capital, Inc.			
3,750 % fällig am 01.04.2030	300	275	0,47	Organon & Co.				7,125 % fällig am 14.04.2030	200	204	0,35
DaVita, Inc.				2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 300	285	0,49			20,301	35,01
4,625 % fällig am 01.06.2030	30	26	0,05	Owens & Minor, Inc.							
Dell International LLC				6,625 % fällig am 01.04.2030	\$ 200	182	0,31	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
3,375 % fällig am 15.12.2041	100	71	0,12	Pacific Gas & Electric Co.				Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
6,020 % fällig am 15.06.2026	50	51	0,09	6,700 % fällig am 01.04.2053	225	221	0,38	5,997 % fällig am 19.09.2044			
DISH DBS Corp.				Park Intermediate Holdings LLC				29	26	0,04	
5,250 % fällig am 01.12.2026	100	80	0,14	4,875 % fällig am 15.05.2029	100	86	0,15	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Edgewell Personal Care Co.				PNC Financial Services Group, Inc.				Uniform Mortgage-Backed Security			
5,500 % fällig am 01.06.2028	50	47	0,08	2,200 % fällig am 01.11.2024	300	285	0,49	5,000 % fällig am 01.04.2053			
Elanco Animal Health, Inc.				Post Holdings, Inc.				5,500 % fällig am 01.11.2052 -			
6,650 % fällig am 28.08.2028	200	195	0,34	5,500 % fällig am 15.12.2029	300	277	0,48	01.05.2053			
Embecta Corp.				Prime Security Services Borrower LLC				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
5,000 % fällig am 15.02.2030	200	166	0,29	6,250 % fällig am 15.01.2028	250	235	0,41	5,000 % fällig am 01.08.2053			
Equinix, Inc.				Quanta Services, Inc.				200	196	0,34	
2,500 % fällig am 15.05.2031	150	122	0,21	2,350 % fällig am 15.01.2032	200	158	0,27	2,355			
Ford Motor Co.				Ritchie Bros Holdings, Inc.				4,06			
3,250 % fällig am 12.02.2032	275	217	0,37	7,750 % fällig am 15.03.2031	50	52	0,09	<b>US-SCHATZobligationen</b>			
Frontier Communications Holdings LLC				Rocket Mortgage LLC				U.S. Treasury Bonds			
8,750 % fällig am 15.05.2030	48	47	0,08	4,000 % fällig am 15.10.2033	200	157	0,27	4,000 % fällig am 15.11.2042			
Goldman Sachs Group, Inc.				Santander Holdings USA, Inc.				175	174	0,30	
3,102 % fällig am 24.02.2033	100	85	0,15	5,807 % fällig am 09.09.2026	200	197	0,34	Summe USA			
Graphic Packaging International LLC				SBA Communications Corp.				22,992			
3,500 % fällig am 01.03.2029	200	175	0,30	3,125 % fällig am 01.02.2029	500	424	0,73	39,65			
Haleon U.S. Capital LLC				Scripps Escrow, Inc.				<b>URUGUAY</b>			
3,375 % fällig am 24.03.2029	350	318	0,55	3,875 % fällig am 15.01.2029	100	81	0,14	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
HAT Holdings LLC				Sirius XM Radio, Inc.				Uruguay Government International Bond			
3,375 % fällig am 15.06.2026	50	45	0,08	3,875 % fällig am 01.09.2031	150	116	0,20	5,100 % fällig am 18.06.2050			
HCA, Inc.				SLM Corp.				400	399	0,69	
4,125 % fällig am 15.06.2029	350	324	0,56	3,125 % fällig am 02.11.2026	150	130	0,22	Summe Übertragbare Wertpapiere			
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				Southern California Edison Co.				\$ 44,287			
3,625 % fällig am 15.02.2032	200	167	0,29	2,500 % fällig am 01.06.2031	500	416	0,72	76,37			
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC				Sprint Capital Corp.				<b>AKTIEN</b>			
4,875 % fällig am 01.07.2031	200	168	0,29	8,750 % fällig am 15.03.2032	400	483	0,84	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Host Hotels & Resorts LP				Standard Industries, Inc.				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
2,900 % fällig am 15.12.2031	250	197	0,34	4,375 % fällig am 15.07.2030	200	173	0,30	PIMCO Funds: Global Investors			
Ingevity Corp.				T-Mobile USA, Inc.				Series plc - Emerging			
3,875 % fällig am 01.11.2028	50	43	0,07	2,250 % fällig am 15.02.2026	100	92	0,16	Markets Bond ESG			
IQVIA, Inc.				TEGNA, Inc.				Fund (b)			
2,250 % fällig am 15.01.2028	€ 250	241	0,42	5,000 % fällig am 15.09.2029	200	173	0,30	344,725			
JPMorgan Chase & Co.				Tenet Healthcare Corp.				3,582			
2,580 % fällig am 22.04.2032	\$ 600	499	0,86	4,625 % fällig am 15.06.2028	350	327	0,56	6,17			
Kilroy Realty LP				TerraForm Power Operating LLC				147,887			
2,650 % fällig am 15.11.2033	200	136	0,24	5,000 % fällig am 31.01.2028	200	184	0,32	1,482			
								2,56			
								\$ 5,064			
								8,73			

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

### PENSIONS-GESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
MBC	5,160 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 7.400	U.S. Treasury Notes 0,500 % fällig am 28.02.2026	\$ (7.643)	\$ 7.400	\$ 7.403	12,76
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (7.643)</b>	<b>\$ 7.400</b>	<b>\$ 7.403</b>	<b>12,76</b>

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1	\$ (2)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	7	12	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	6	(8)	(0,01)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	2	2	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	15	(46)	(0,08)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	5	(10)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	15	18	0,03
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	7	13	0,03
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	1	1	0,00
				<b>\$ (20)</b>	<b>(0,03)</b>
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ (20)</b>	<b>(0,03)</b>

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2028	\$ 100	\$ 0	0,00

#### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		3,250 %	20.09.2053	£ 30	\$ (3)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		3,500	20.09.2033	100	(9)	(0,01)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		3,750	20.09.2028	150	10	0,02
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		4,000	20.09.2025	150	5	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,400	15.06.2032	¥ 10.000	0	0,00
						<b>\$ 3</b>	<b>0,01</b>
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 3</b>	<b>0,01</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2028	\$ 300	\$ (17)	\$ 7	\$ (10)	(0,02)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	200	(16)	2	(14)	(0,02)
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2028	300	0	2	2	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2027	100	(17)	3	(14)	(0,02)
GST	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2028	100	0	1	1	0,00

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2027	\$ 150	\$ (8)	\$ 5	\$ (3)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2028	200	(36)	6	(30)	(0,05)
					\$ (94)	\$ 26	\$ (68)	(0,12)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 18.284	\$ 19.650	\$ 0	\$ (298)	\$ (298)	(0,51)
	08.2023	261	281	0	(4)	(4)	(0,01)
BRC	08.2023	14.342	15.424	0	(255)	(255)	(0,44)
	08.2023	£ 297	373	0	(5)	(5)	(0,01)
	08.2023	\$ 149	€ 136	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	18.992	17.468	66	0	66	0,11
	08.2023	€ 17.468	\$ 19.018	0	(66)	(66)	(0,11)
MBC	08.2023	CAD 4	3	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 20.005	€ 18.129	0	(185)	(185)	(0,32)
MYI	07.2023	43	39	0	0	0	0,00
	08.2023	€ 14.342	\$ 15.424	0	(255)	(255)	(0,44)
	08.2023	£ 568	708	0	(14)	(14)	(0,02)
SCX	08.2023	\$ 3.579	€ 3.271	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	105	£ 85	3	0	3	0,00
UAG	08.2023	£ 203	\$ 256	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 20.923	€ 19.058	0	(88)	(88)	(0,15)
				\$ 69	\$ (1.174)	\$ (1.105)	(1,90)

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 179	\$ 194	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2023	\$ 15.822	€ 14.722	240	0	240	0,41
BRC	07.2023	€ 111	\$ 121	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 2	€ 2	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	€ 15.272	\$ 16.596	0	(64)	(64)	(0,11)
	08.2023	\$ 15.970	€ 14.668	55	0	55	0,09
GLM	07.2023	310	290	7	0	7	0,01
MBC	07.2023	€ 95	\$ 102	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 15.906	€ 14.880	328	0	328	0,57
SCX	07.2023	15.922	14.878	310	0	310	0,53
UAG	07.2023	€ 77	\$ 84	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 940	\$ (68)	\$ 872	1,50

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2023	\$ 79	£ 64	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,01
MYI	07.2023	79	64	2	0	2	0,00
UAG	07.2023	81	65	2	0	2	0,00
				\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,01

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (295) (0,51)

Summe Anlagen

\$ 56.439 97,33

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 1.550 2,67

Nettovermögen

\$ 57.989 100,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

(a) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(b) Mit dem Fonds verbunden.

(c) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 222 USD (31. Dezember 2022: 113 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 473 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 44.261	\$ 26	\$ 44.287
Investmentfonds	5.064	0	0	5.064
Pensionsgeschäfte	0	7.400	0	7.400
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	5	(317)	0	(312)
<b>Summen</b>	<b>\$ 5.069</b>	<b>\$ 51.344</b>	<b>\$ 26</b>	<b>\$ 56.439</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 9.978	\$ 0	\$ 9.978
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	41	(54)	0	(13)
<b>Summen</b>	<b>\$ 41</b>	<b>\$ 9.924</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 9.965</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (87)	\$ 0	\$ (87)	\$ 1	\$ 0	\$ 1
BRC	(273)	243	(30)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(9)	0	(9)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	7	(10)	(3)	2	0	2
GST	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	144	0	144	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(33)	0	(33)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(267)	0	(267)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	310	0	310	(57)	0	(57)
UAG	(88)	230	142	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	51,93	61,68
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,44	39,58
Investmentfonds	8,73	k. A.
Pensionsgeschäfte	12,76	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	0,31
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,51)	(0,54)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,50	0,58
Australien	0,30	k. A.



Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Bermuda	0,36	k. A.
Brasilien	0,43	3,50
Kanada	1,21	0,72
Cayman-Inseln	0,52	1,75
Chile	0,39	1,46
Kolumbien	0,87	1,39
Costa Rica	0,37	k. A.
Dänemark	0,55	1,07
Dominikanische Republik	1,05	1,68
Ecuador	0,24	0,47
Ägypten	0,42	k. A.
Finnland	0,36	1,03
Frankreich	2,40	6,29
Deutschland	1,01	3,73
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,95
Hongkong	0,35	k. A.
Ungarn	0,62	k. A.
Indien	0,44	1,95
Indonesien	0,86	k. A.
Irland	0,75	1,24
Italien	0,71	0,88
Elfenbeinküste	0,15	0,77
Japan	1,74	1,71
Kasachstan	0,37	k. A.
Liberia	0,56	k. A.
Jersey, Kanalinseln	k. A.	0,91
Luxemburg	0,55	1,95
Mexiko	1,09	0,86
Marokko	0,27	1,40
Mehrere Länder	k. A.	1,01
Multinational	1,17	0,49
Niederlande	3,34	2,45
Oman	0,51	1,91
Panama	1,45	1,06
Paraguay	0,44	k. A.
Peru	0,82	0,74
Philippinen	0,44	k. A.
Polen	0,21	k. A.
Rumänien	0,67	0,76
Serbien	0,25	k. A.
Singapur	0,08	0,96
Südafrika	0,53	k. A.
Spanien	1,99	3,85
Schweden	0,40	0,75
Großbritannien	4,29	7,18
USA	39,65	27,59
Uruguay	0,69	k. A.
Kurzfristige Instrumente	k. A.	16,22
Investmentfonds	8,73	k. A.
Pensionsgeschäfte	12,76	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,03)	0,31
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	0,01	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	(0,12)	k. A.
Devisenterminkontrakte	(1,90)	(0,61)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,51	0,07
Sonstige Aktiva und Passiva	2,67	(1,13)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Dynamic Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
American Airlines, Inc. 10,000 % fällig am 20.04.2028	\$ 900	\$ 921	0,03	Balder Finland Oyj 1,000 % fällig am 18.01.2027	€ 1.800	\$ 1.481	0,04	Deutsche Bank AG 0,898 % fällig am 28.05.2024 (j)	\$ 1.900	\$ 1.806	0,05
BCP Modular Services Holdings Ltd. 8,023 % fällig am 15.12.2028	€ 4.900	5.032	0,15	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % fällig am 02.03.2026	6.500	7.108	0,21	1,375 % fällig am 17.02.2032	€ 4.600	3.724	0,11
Carnival Corp. 8,217 % fällig am 30.06.2025	\$ 2.619	2.618	0,08	Banco Santander S.A. 4,375 % fällig am 14.01.2026 (g)(i)	3.200	2.934	0,09	1,625 % fällig am 20.01.2027	€ 1.900	1.843	0,05
Charter Communications Operating LLC 6,795 % - 6,834 % fällig am 01.02.2027	187	186	0,01	5,147 % fällig am 18.08.2025	\$ 4.400	4.324	0,13	2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 1.200	1.420	0,04
Delos Finance SARL 7,288 % fällig am 06.10.2023	3.220	3.222	0,10	Bank of America Corp. 2,687 % fällig am 22.04.2032	200	166	0,00	3,035 % fällig am 28.05.2032 (j)	\$ 800	631	0,02
Hertz Corp. 8,443 % fällig am 30.06.2028	2.800	2.799	0,08	3,864 % fällig am 23.07.2024	5.300	5.294	0,16	3,742 % fällig am 07.01.2033	€ 1.200	881	0,03
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % fällig am 22.06.2026	4.774	4.775	0,14	4,300 % fällig am 28.01.2025 (g)	3.600	3.222	0,10	3,875 % fällig am 12.02.2024	€ 3.500	4.353	0,13
Intelsat Jackson Holdings S.A. 9,443 % fällig am 01.02.2025	347	346	0,01	Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025 (g)(i)	€ 3.700	3.967	0,12	6,119 % fällig am 14.07.2026	\$ 8.902	8.806	0,26
IRB Holding Corp. 8,202 % fällig am 15.12.2027	1.808	1.798	0,05	Barclays PLC 2,645 % fällig am 24.06.2031	\$ 900	723	0,02	Digital Dutch Finco BV 1,500 % fällig am 15.03.2030	€ 1.100	944	0,03
Acquisition Holdings LLC 9,726 % fällig am 01.09.2028	4.421	3.963	0,12	3,330 % fällig am 24.11.2042	€ 1.100	1.186	0,03	DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	€ 3.500	2.901	0,09
Nouryon Finance BV 6,478 % fällig am 03.04.2028	€ 5.476	5.878	0,17	3,375 % fällig am 02.04.2025	\$ 300	283	0,01	EQT AB 2,375 % fällig am 06.04.2028	1.200	1.155	0,03
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % fällig am 16.11.2025	\$ 4.479	4.160	0,12	4,337 % fällig am 10.01.2028	\$ 300	284	0,01	Equinix, Inc. 0,250 % fällig am 15.03.2027	€ 1.500	1.427	0,04
United Airlines, Inc. 9,292 % fällig am 21.04.2028	1.170	1.171	0,04	4,972 % fällig am 16.05.2029	2.500	2.440	0,07	3,900 % fällig am 15.04.2032	\$ 300	270	0,01
		36.869	1,10	5,304 % fällig am 09.08.2026	€ 600	586	0,02	Erste Group Bank AG 6,500 % fällig am 15.04.2024 (g)(i)	€ 200	212	0,01
				5,501 % fällig am 09.08.2028	€ 1.700	1.871	0,06	Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % fällig am 29.04.2030	\$ 2.500	2.345	0,07
				7,125 % fällig am 15.06.2025 (g)(i)	\$ 2.500	2.606	0,08	Ford Motor Credit Co. LLC 2,330 % fällig am 25.11.2025	€ 200	205	0,01
				7,385 % fällig am 02.11.2028	€ 2.700	2.923	0,09	2,700 % fällig am 10.08.2026	\$ 3.900	3.486	0,10
				7,437 % fällig am 02.11.2033	€ 800	786	0,02	2,748 % fällig am 14.06.2024	€ 2.300	2.799	0,08
				7,750 % fällig am 15.09.2023 (g)(i)	€ 400	379	0,01	2,900 % fällig am 16.02.2028	\$ 1.800	1.543	0,05
				8,000 % fällig am 15.06.2024 (g)(i)	€ 4.400	3.745	0,11	3,021 % fällig am 06.03.2024	€ 900	971	0,03
				Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	\$ 1.100	1.016	0,03	3,250 % fällig am 15.09.2025	€ 100	105	0,00
				BGC Partners, Inc. 4,375 % fällig am 15.12.2025	€ 4.500	3.429	0,10	4,535 % fällig am 06.03.2025	€ 200	242	0,01
				Blue Owl Finance LLC 3,125 % fällig am 10.06.2031	€ 4.500	3.429	0,10	G City Europe Ltd. 4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 1.200	1.145	0,03
				BNP Paribas S.A. 1,904 % fällig am 30.09.2028	€ 7.800	6.652	0,20	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	1.300	1.069	0,03
				2,000 % fällig am 13.09.2036	€ 2.100	1.676	0,05	3,000 % fällig am 29.03.2025	€ 3.100	2.799	0,08
				2,125 % fällig am 23.01.2027	€ 2.400	2.455	0,07	Goldman Sachs Group, Inc. 1,000 % fällig am 16.12.2025	€ 2.500	2.933	0,09
				4,400 % fällig am 14.08.2028	\$ 4.800	4.536	0,13	1,875 % fällig am 16.12.2030	€ 2.500	2.360	0,07
				BPCE S.A. 2,125 % fällig am 13.10.2046 (i)	€ 3.800	2.970	0,09	2,615 % fällig am 22.04.2032	\$ 200	164	0,00
				Brown & Brown, Inc. 4,200 % fällig am 15.09.2024	\$ 7.500	7.327	0,22	3,615 % fällig am 15.03.2028	€ 2.000	1.878	0,06
				CaixaBank S.A. 6,750 % fällig am 13.06.2024 (g)(i)	€ 1.000	1.059	0,03	3,691 % fällig am 05.06.2028	3.000	282	0,01
				CapitaLand Ascendas REIT 0,750 % fällig am 27.06.2022	€ 3.200	2.794	0,08	3,750 % fällig am 22.05.2025	400	386	0,01
				CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % fällig am 27.01.2028	2.000	1.726	0,05	6,491 % fällig am 15.05.2026	800	810	0,02
				0,900 % fällig am 12.10.2029	€ 2.300	1.837	0,05	HSBC Holdings PLC 1,750 % fällig am 24.07.2027	€ 3.200	3.469	0,10
				Cooperative Rabobank UA 4,375 % fällig am 29.06.2027 (g)(i)	1.800	1.719	0,05	2,357 % fällig am 18.08.2031	\$ 2.200	1.757	0,05
				Coventry Building Society 2,625 % fällig am 07.12.2026	1.100	1.153	0,03	2,804 % fällig am 24.05.2032	€ 800	647	0,02
				CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	5.400	3.212	0,10	2,871 % fällig am 22.11.2032	5.000	4.035	0,12
				1,625 % fällig am 23.04.2027	€ 6.650	5.303	0,16	3,973 % fällig am 22.05.2030	4.700	4.225	0,13
				1,750 % fällig am 14.01.2030	100	66	0,00	4,583 % fällig am 19.06.2029	€ 4.170	3.928	0,12
				2,750 % fällig am 12.05.2026	€ 1.100	977	0,03	4,750 % fällig am 04.07.2029 (g)(i)	€ 2.200	2.032	0,06
				2,750 % fällig am 22.01.2028	€ 5.950	5.067	0,15	5,210 % fällig am 11.08.2028	\$ 2.600	2.544	0,08
				4,875 % fällig am 16.07.2025 (g)	€ 2.200	869	0,03	6,254 % fällig am 09.03.2034	€ 3.800	3.897	0,12
				Credit Suisse AG 0,250 % fällig am 01.09.2028	€ 3.700	3.244	0,10	6,375 % fällig am 30.03.2025 (g)(i)	500	480	0,01
				0,495 % fällig am 02.02.2024	\$ 1.800	1.732	0,05	Huarong Finance Co. Ltd. 3,375 % fällig am 24.02.2030	900	683	0,02
				6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)	€ 6.000	5.978	0,18	3,625 % fällig am 30.09.2030	€ 2.600	1.975	0,06
				7,500 % fällig am 15.02.2028	300	319	0,01	3,875 % fällig am 13.11.2029	€ 2.300	1.776	0,05
				Credit Suisse AG AT1 Claim ^ 2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 3.100	2.919	0,09	4,250 % fällig am 07.11.2027	€ 500	417	0,01
				Crown Castle, Inc. 3,100 % fällig am 15.11.2029	\$ 250	218	0,01	4,500 % fällig am 29.05.2029	€ 1.700	1.364	0,04
				3,800 % fällig am 15.02.2028	€ 2.250	2.099	0,06	4,750 % fällig am 27.04.2027	€ 1.300	1.126	0,03
				CTP NV 0,625 % fällig am 27.09.2026	€ 1.800	1.588	0,05	4,950 % fällig am 07.11.2047	€ 1.200	800	0,02
				1,250 % fällig am 21.06.2029	€ 5.100	4.042	0,12	Hyundai Capital Services, Inc. 0,750 % fällig am 15.09.2023	€ 3.500	3.463	0,10
				1,500 % fällig am 27.09.2031	€ 1.700	1.294	0,04	ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026 (g)(i)	€ 900	796	0,02
								Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % fällig am 16.03.2028	€ 3.100	2.886	0,09
								Intesa Sanpaolo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2024	\$ 5.800	5.566	0,16
								4,000 % fällig am 23.09.2029	€ 400	348	0,01
								5,148 % fällig am 10.06.2030	€ 1.400	1.440	0,04
								JAB Holdings BV 2,200 % fällig am 23.11.2030	\$ 4.900	3.857	0,11
								JPMorgan Chase & Co. 2,595 % fällig am 24.02.2026	€ 6.400	6.072	0,18
								3,220 % fällig am 01.03.2025	€ 3.050	2.990	0,09
								4,005 % fällig am 23.04.2029	€ 4.500	4.241	0,13



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Dynamic Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % fällig am 09.07.2027	€ 1.900	\$ 1.904	0,06	3,300 % fällig am 15.02.2051 3,875 % fällig am 15.04.2030	\$ 4.200	3.872	0,12	Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021	\$ 1.900	\$ 1.832	0,05	
Global Payments, Inc. 5,300 % fällig am 15.08.2029	\$ 1.800	1.755	0,05	TD SYNnex Corp. 2,375 % fällig am 09.08.2028	5.800	4.757	0,14	Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010	696	751	0,02	
GN Store Nord A/S 0,875 % fällig am 25.11.2024	€ 3.400	3.461	0,10	TDF Infrastructure SASU 1,750 % fällig am 01.12.2029	€ 6.400	5.633	0,17	Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007	23.300	2.203	0,07	
Grifols Escrow Issuer S.A. 3,875 % fällig am 15.10.2028	3.100	2.903	0,09	Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,875 % fällig am 29.05.2026	2.200	\$ 2.192	0,07	Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020	1.500	1.247	0,04	
Haleon U.S. Capital LLC 3,375 % fällig am 24.03.2029	\$ 1.850	1.682	0,05	Toyota Tsusho Corp. 3,625 % fällig am 13.09.2023	\$ 3.400	3.385	0,10	3,301 % fällig am 01.06.2033	800	661	0,02	
Haleon UK Capital PLC 3,125 % fällig am 24.03.2025	3.000	2.868	0,09	United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.04.2029	3.090	3.068	0,09					
HCA, Inc. 5,375 % fällig am 01.09.2026	900	893	0,03	United Airlines, Inc. 4,625 % fällig am 15.04.2029	200	182	0,01					
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,750 % fällig am 01.05.2029	300	267	0,01	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 01.11.2033	6.400	5.249	0,16	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				
4,000 % fällig am 01.05.2031	3.200	2.782	0,08	6,250 % fällig am 15.01.2030	4.800	4.766	0,14	Fannie Mae 0,000 % fällig am 25.09.2060 (a)	13.399	1.145	0,03	
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC 5,000 % fällig am 01.06.2029	4.000	3.554	0,11	Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£ 4.000	4.014	0,12	0,469 % fällig am 25.07.2042 (a)	20.080	267	0,01	
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 0,125 % fällig am 16.09.2025	€ 1.600	1.577	0,05	Vmed O2 UK Financing PLC 4,500 % fällig am 15.07.2031	2.800	2.710	0,08	0,612 % fällig am 25.06.2042 (a)	15.872	187	0,01	
0,625 % fällig am 16.09.2028	2.200	1.965	0,06	Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	€ 4.600	4.362	0,13	0,750 % fällig am 25.12.2056 (a)	3.596	466	0,01	
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)	3.200	3.266	0,10	WAG Acquisition Corp. 2,250 % fällig am 15.08.2031	2.300	1.998	0,06	0,900 % fällig am 25.07.2059 (a)	8.938	950	0,03	
Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % fällig am 18.03.2033	1.700	1.344	0,04	Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 15.01.2026	\$ 400	372	0,01	0,925 % fällig am 25.11.2046 (a)	5.676	117	0,00	
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030	\$ 1.406	1.284	0,04	5,500 % fällig am 01.10.2027	200	178	0,01	1,050 % fällig am 25.05.2048 (a)	1.801	190	0,01	
JetBlue Pass-Through Trust 2,750 % fällig am 15.11.2033	168	144	0,00					1,350 % fällig am 25.03.2042 (a)	7.029	690	0,02	
Kraft Heinz Foods Co. 5,000 % fällig am 15.07.2035	73	72	0,00	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				1,450 % fällig am 25.11.2035 (a)	77	1	0,00	
Las Vegas Sands Corp. 3,900 % fällig am 08.08.2029	200	179	0,01	AES Corp. 2,450 % fällig am 15.01.2031	2.200	1.779	0,05	1,480 % fällig am 25.10.2039 (a)	1.234	20	0,00	
Lendlease Europe Finance PLC 3,500 % fällig am 02.12.2033	£ 899	748	0,02	CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 1,500 % fällig am 17.10.2031	€ 2.500	2.164	0,06	2,000 % fällig am 25.11.2050 (a)	4.090	401	0,01	
Melco Resorts Finance Ltd. 5,375 % fällig am 04.12.2029	\$ 200	166	0,00	2,625 % fällig am 17.10.2034	£ 2.500	2.091	0,06	2,226 % fällig am 25.06.2043 (a)	5.088	341	0,01	
Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % fällig am 20.06.2027	5.280	5.298	0,16	Entergy Corp. 2,400 % fällig am 15.06.2031	\$ 300	243	0,01	3,795 % fällig am 01.12.2034	2	2	0,00	
Acquisition Holdings LLC 5,500 % fällig am 01.09.2028	3.300	2.817	0,08	Georgia Power Co. 4,700 % fällig am 15.05.2032	1.200	1.161	0,04	3,956 % fällig am 01.02.2035	3	3	0,00	
Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 10.100	9.422	0,28	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 4,625 % fällig am 15.07.2027	350	342	0,01	4,000 % fällig am 25.06.2050 (a)	5.746	1.130	0,03	
Nidec Corp. 0,046 % fällig am 30.03.2026	1.100	1.079	0,03	ONEOK, Inc. 4,350 % fällig am 15.03.2029	100	93	0,00	4,944 % fällig am 01.11.2042	11	10	0,00	
Nissan Motor Co. Ltd. 3,522 % fällig am 17.09.2025	\$ 7.500	6.980	0,21	Pacific Gas & Electric Co. 3,000 % fällig am 15.06.2028	2.400	2.071	0,06	5,249 % fällig am 25.02.2032	24	24	0,00	
4,345 % fällig am 17.09.2027	1.700	1.547	0,05	3,150 % fällig am 01.01.2026	500	464	0,01	5,258 % fällig am 17.10.2034	28	28	0,00	
4,810 % fällig am 17.09.2030	500	439	0,01	3,250 % fällig am 01.06.2031	2.400	1.954	0,06	5,268 % fällig am 25.11.2031	4	4	0,00	
Penske Truck Leasing Co. LP 3,950 % fällig am 10.03.2025	2.000	1.923	0,06	3,300 % fällig am 01.12.2027 ^	3.000	2.633	0,08	5,307 % fällig am 25.11.2032	7	7	0,00	
Petroleos Mexicanos 6,700 % fällig am 16.02.2032	4.981	3.792	0,11	3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	200	189	0,01	5,500 % fällig am 25.03.2037	18	18	0,00	
10,000 % fällig am 07.02.2033	900	825	0,02	3,500 % fällig am 01.08.2050	300	191	0,01	5,550 % fällig am 25.09.2032	2	2	0,00	
Prosus NV 3,680 % fällig am 21.01.2030	600	510	0,02	4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	500	357	0,01	5,596 % fällig am 18.10.2030	3	3	0,00	
Sabine Pass Liquefaction LLC 4,200 % fällig am 15.03.2028	4.000	3.793	0,11	4,550 % fällig am 01.07.2030	4.100	3.714	0,11	5,682 % fällig am 25.03.2036	256	271	0,01	
5,000 % fällig am 15.03.2027	800	788	0,02	4,950 % fällig am 08.06.2025	1.500	1.455	0,04					
Sands China Ltd. 3,350 % fällig am 08.03.2029	900	751	0,02	5,450 % fällig am 15.06.2027	200	195	0,01	Freddie Mac 0,000 % fällig am 15.08.2042	1.053	733	0,02	
3,750 % fällig am 08.08.2031	1.100	896	0,03	6,150 % fällig am 15.01.2033	3.800	3.719	0,11	0,737 % fällig am 15.12.2037 (a)	301	20	0,00	
5,900 % fällig am 08.08.2028	7.800	7.442	0,22	Southern California Gas Co. 2,950 % fällig am 15.04.2027	1.900	1.774	0,05	0,950 % fällig am 25.06.2050 (a)	9.212	920	0,03	
Scripps Escrow, Inc. 5,375 % fällig am 15.01.2031	1.600	1.129	0,03	Southern Co. Gas Capital Corp. 2,450 % fällig am 01.10.2023	500	496	0,02	0,957 % fällig am 15.07.2047 (a)	134	14	0,00	
Southern Co. 3,700 % fällig am 30.04.2030	400	367	0,01	Sprint LLC 7,125 % fällig am 15.06.2024	800	808	0,02	1,000 % fällig am 25.06.2050 (a)	12.368	1.414	0,04	
Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029	600	445	0,01	<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				1,417 % fällig am 15.04.2042 (a)	152	14	0,00	
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 1.000	1.048	0,03	ie Unternehmensanleihen und Wechsel				1,500 % fällig am 25.12.2035 (a)	8.373	370	0,01	
T-Mobile USA, Inc. 2,250 % fällig am 15.11.2031	\$ 2.300	1.841	0,05	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,000 % fällig am 25.12.2050 (a)	19.940	1.842	0,06	
				California State General Obligation Bonds, (BABs), (AGM/CR Insured), Series 2010	6.875	2.345	2.481	0,07	4,000 % fällig am 15.01.2033 - 25.07.2050 (a)	17.392	3.397	0,10
				Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022	40	20	0,00	4,000 % fällig am 01.07.2047	110	105	0,00	
				0,000 % fällig am 01.11.2043				4,575 % fällig am 01.09.2027	1	1	0,00	
								5,290 % fällig am 25.09.2031	84	84	0,00	
								5,376 % fällig am 25.07.2044	332	309	0,01	
								5,500 % fällig am 01.04.2027 - 01.01.2040	448	455	0,01	
								Ginnie Mae 2,625 % fällig am 20.09.2031	104	101	0,00	
								2,750 % fällig am 20.11.2029	2	2	0,00	
								3,500 % fällig am 15.07.2045	10.809	10.107	0,30	
								4,000 % fällig am 20.10.2042 (a)	3.626	612	0,02	
								4,000 % fällig am 15.02.2052	4.435	4.239	0,13	
								4,500 % fällig am 20.10.2045 (a)	2.405	473	0,01	
								Ginnie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	3.000	2.860	0,09	
								Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.04.2037 - 01.07.2048	12.259	11.333	0,34	
								4,000 % fällig am 01.05.2047 - 01.03.2049	9.303	8.893	0,26	
								4,500 % fällig am 01.04.2028	5	5	0,00	
								5,500 % fällig am 01.07.2026 - 01.08.2040	463	466	0,01	
								6,000 % fällig am 01.10.2025 - 01.05.2041	248	253	0,01	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				4,336 % fällig am 25.01.2035	\$ 35	\$ 31	0,00	5,500 % fällig am 25.04.2035	\$ 120	\$ 85	0,00
2,500 % fällig am 01.08.2053	\$ 30.200	\$ 25.651	0,76	4,374 % fällig am 25.08.2033	98	94	0,00	5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	241	148	0,00
3,000 % fällig am 01.08.2053	50.300	44.341	1,32	4,513 % fällig am 25.04.2033	3	3	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	171	103	0,00
3,500 % fällig am 01.08.2053	119.800	109.294	3,25	4,517 % fällig am 25.01.2035	22	21	0,00	5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	106	47	0,00
4,000 % fällig am 01.08.2053	160.200	150.482	4,47	4,670 % fällig am 25.11.2034	38	32	0,00	5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	3.167	2.074	0,06
4,500 % fällig am 01.07.2053	120.300	115.689	3,44	4,752 % fällig am 25.07.2034	43	40	0,00	5,500 % fällig am 25.12.2035	1.077	483	0,01
5,000 % fällig am 01.08.2053	192.600	188.763	5,60	Bear Stearns ALT-A Trust				5,500 % fällig am 25.01.2036	21	13	0,00
		690.041	20,48	3,250 % fällig am 25.02.2034	8	7	0,00	5,500 % fällig am 25.05.2036 ^	418	327	0,01
				3,634 % fällig am 25.09.2035 ^	3.846	1.654	0,05	5,510 % fällig am 25.05.2047	800	689	0,02
				3,651 % fällig am 25.04.2035	46	39	0,00	5,520 % fällig am 25.02.2037 ^	1.963	600	0,02
				3,731 % fällig am 25.11.2036 ^	1.198	568	0,02	5,530 % fällig am 25.07.2046 ^	296	286	0,01
				3,781 % fällig am 25.11.2036	3.175	1.803	0,05	5,530 % fällig am 25.09.2046 ^	17	16	0,00
				3,920 % fällig am 25.09.2034	95	88	0,00	5,577 % fällig am 20.03.2046	51	42	0,00
				3,971 % fällig am 25.05.2035 ^	489	247	0,01	5,577 % fällig am 25.02.2037 ^	300	255	0,01
				3,989 % fällig am 25.03.2036 ^	224	171	0,01	5,630 % fällig am 25.01.2037	2.202	1.794	0,05
				4,195 % fällig am 25.05.2035	304	287	0,01	5,710 % fällig am 25.02.2037	753	623	0,02
				4,812 % fällig am 25.01.2034	43	38	0,00	5,730 % fällig am 25.02.2036 ^	1.683	1.490	0,04
				5,470 % fällig am 25.02.2034	136	121	0,00	5,750 % fällig am 25.02.2035	140	100	0,00
				5,490 % fällig am 25.08.2036 ^	179	170	0,01	5,750 % fällig am 25.07.2035 ^	675	435	0,01
				5,550 % fällig am 25.02.2034	672	600	0,02	5,750 % fällig am 25.05.2036	434	186	0,01
				5,590 % fällig am 25.04.2036 ^	415	352	0,01	5,750 % fällig am 25.03.2037 ^	389	221	0,01
				5,630 % fällig am 25.02.2036	299	261	0,01	5,803 % fällig am 20.11.2035	21	18	0,00
				Bear Stearns Mortgage Funding Trust				5,860 % fällig am 25.07.2036 ^	552	209	0,01
				5,330 % fällig am 25.06.2037	611	552	0,02	6,000 % fällig am 25.10.2035 ^	1.316	917	0,03
				Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				6,000 % fällig am 25.04.2036	594	308	0,01
				3,484 % fällig am 25.12.2046 ^	456	344	0,01	6,000 % fällig am 25.04.2038 ^	120	62	0,00
				Canada Square Funding PLC				6,000 % fällig am 25.08.2038 ^	95	51	0,00
				5,316 % fällig am 17.01.2059	£ 2.291	2.896	0,09	6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	1.243	76	0,00
				Canterbury Finance PLC				6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	227	104	0,00
				5,377 % fällig am 16.05.2058	392	498	0,02	6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	287	115	0,00
				Charter Mortgage Funding PLC				6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	559	277	0,01
				5,327 % fällig am 16.01.2057	1.429	1.815	0,05	6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	94	48	0,00
				Chase Mortgage Finance Trust				6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	645	335	0,01
				3,848 % fällig am 25.03.2037 ^	\$ 326	297	0,01	6,050 % fällig am 25.12.2036 ^	645	216	0,01
				4,086 % fällig am 25.03.2037 ^	26	25	0,00	6,500 % fällig am 25.08.2032	40	39	0,00
				4,483 % fällig am 25.02.2037	15	15	0,00	6,500 % fällig am 25.09.2037 ^	562	231	0,01
				ChaseFlex Trust				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
				5,750 % fällig am 25.07.2037	11	9	0,00	3,514 % fällig am 25.04.2035	29	23	0,00
				ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust				3,573 % fällig am 20.05.2036 ^	648	596	0,02
				4,176 % fällig am 25.08.2037 ^	552	471	0,01	3,677 % fällig am 20.02.2036	496	425	0,01
				4,176 % fällig am 25.08.2037 ^	247	205	0,01	3,734 % fällig am 20.04.2036 ^	2	2	0,00
				Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				3,937 % fällig am 25.05.2036	361	325	0,01
				5,330 % fällig am 25.05.2036	27	24	0,00	4,241 % fällig am 20.07.2034	76	70	0,00
				Citicorp Mortgage Securities Trust				5,250 % fällig am 25.12.2027 ^	22	14	0,00
				6,000 % fällig am 25.09.2037	34	32	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	4	2	0,00
				Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.				5,610 % fällig am 25.05.2035	36	30	0,00
				5,650 % fällig am 25.05.2032	27	27	0,00	5,730 % fällig am 25.04.2035	26	24	0,00
				Citigroup Mortgage Loan Trust				5,730 % fällig am 25.04.2035	14	13	0,00
				3,620 % fällig am 25.10.2046 ^	306	272	0,01	5,750 % fällig am 25.02.2037 ^	365	175	0,01
				4,288 % fällig am 25.07.2037 ^	8	7	0,00	5,750 % fällig am 25.05.2037 ^	23	12	0,00
				4,321 % fällig am 25.03.2034	68	64	0,00	5,790 % fällig am 25.03.2035	2.073	1.133	0,03
				4,418 % fällig am 25.08.2035	42	41	0,00	5,810 % fällig am 25.02.2035	265	219	0,01
				5,351 % fällig am 25.09.2037 ^	82	72	0,00	5,810 % fällig am 25.02.2035	37	32	0,00
				6,470 % fällig am 25.11.2035	68	67	0,00	5,890 % fällig am 25.02.2035	773	668	0,02
				6,980 % fällig am 25.05.2035	42	42	0,00	5,910 % fällig am 20.02.2036 ^	25	21	0,00
				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				6,000 % fällig am 25.09.2037 ^	85	46	0,00
				4,163 % fällig am 25.02.2034	13	11	0,00	6,500 % fällig am 25.12.2037	1.430	629	0,02
				6,430 % fällig am 25.09.2035	1	1	0,00	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust			
				CitiMortgage Alternative Loan Trust				6,500 % fällig am 25.11.2034 ^	15	13	0,00
				5,750 % fällig am 25.01.2037	1.114	920	0,03	6,500 % fällig am 25.03.2035 ^	403	389	0,01
				5,750 % fällig am 25.06.2037	1.603	1.312	0,04	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
				5,800 % fällig am 25.09.2036	1.494	1.228	0,04	5,449 % fällig am 25.03.2032	27	25	0,00
				6,000 % fällig am 25.10.2037 ^	684	600	0,02	6,000 % fällig am 25.01.2036 ^	480	306	0,01
				Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				6,500 % fällig am 25.04.2033	3	3	0,00
				6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	98	59	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-through Certificates			
				Countrywide Alternative Loan Trust				5,276 % fällig am 25.10.2033	8	8	0,00
				0,000 % fällig am 25.12.2035 (a)	1.075	66	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
				4,976 % fällig am 25.12.2035	2.209	1.861	0,06	3,519 % fällig am 30.11.2037	3.809	3.497	0,10
				5,000 % fällig am 25.03.2035	5	4	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
				5,337 % fällig am 20.02.2047 ^	319	249	0,01	5,750 % fällig am 25.02.2037	3.804	1.801	0,05
				5,347 % fällig am 20.03.2047	5.058	4.166	0,12	6,250 % fällig am 25.08.2036 ^	43	17	0,00
				5,350 % fällig am 25.04.2047	224	211	0,01	7,000 % fällig am 25.08.2037 ^	375	240	0,01
				5,352 % fällig am 20.12.2046 ^	11.118	9.317	0,28	Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
				5,430 % fällig am 25.06.2037	681	613	0,02	3,474 % fällig am 25.06.2050	1.844	1.548	0,05
				5,430 % fällig am 25.04.2047	1.212	1.080	0,03	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
				5,437 % fällig am 25.09.2046	578	416	0,01	5,290 % fällig am 25.07.2047	373	341	0,01
				5,470 % fällig am 25.09.2047	575	499	0,02	5,450 % fällig am 25.03.2037 ^	238	225	0,01
				5,490 % fällig am 25.05.2047	563	485	0,01	5,450 % fällig am 25.09.2047 ^	688	586	0,02
								5,480 % fällig am 25.08.2037 ^	1.400	1.187	0,04





BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Towd Point Mortgage Funding PLC				Argent Securities Trust				5,400 % fällig am 25.10.2036	936	735	0,02
5,635 % fällig am 20.10.2051	£ 11.512	\$ 14.657	0,44	5,300 % fällig am 25.09.2036	\$ 2.031	669	0,02	5,630 % fällig am 25.06.2036	1.053	998	0,03
5,841 % fällig am 20.07.2045	2.938	3.738	0,11	5,370 % fällig am 25.05.2036	542	135	0,00	6,050 % fällig am 25.05.2034	421	402	0,01
				5,450 % fällig am 25.06.2036	1.692	473	0,01				
				5,450 % fällig am 25.07.2036	5.817	4.961	0,15	Centex Home Equity Loan Trust			
				5,470 % fällig am 25.05.2036	3.630	900	0,03	6,080 % fällig am 25.09.2034	305	293	0,01
Tower Bridge Funding PLC				Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				CIT Mortgage Loan Trust			
5,629 % fällig am 20.12.2063	2.170	2.746	0,08	5,630 % fällig am 25.05.2035	2.000	1.803	0,05	6,500 % fällig am 25.10.2037	357	357	0,01
				Armada Euro CLO DAC	€ 1.549	1.654	0,05	6,650 % fällig am 25.10.2037	10.500	10.222	0,30
Trinity Square PLC				3,897 % fällig am 15.07.2031				Citigroup Mortgage Loan Trust			
5,316 % fällig am 15.07.2059	2.039	2.589	0,08	Asset-Backed Funding Certificates Trust				5,320 % fällig am 25.07.2045	1.345	939	0,03
				5,260 % fällig am 25.01.2037	\$ 1.011	586	0,02	5,350 % fällig am 25.05.2037	4.048	2.671	0,08
				5,310 % fällig am 25.01.2037	413	239	0,01	5,470 % fällig am 25.12.2036	249	162	0,01
				5,850 % fällig am 25.06.2034	712	692	0,02	5,650 % fällig am 25.08.2036	2.644	2.564	0,08
				6,200 % fällig am 25.03.2034 ^	352	328	0,01	5,670 % fällig am 25.09.2036	678	589	0,02
				Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				7,250 % fällig am 25.05.2034	539	287	0,01
				6,245 % fällig am 25.02.2035	822	830	0,02	Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates			
				Aurium CLO DAC				6,095 % fällig am 25.10.2034	315	298	0,01
				3,907 % fällig am 16.01.2031	€ 5.692	6.090	0,18	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
				4,618 % fällig am 23.03.2032	5.000	5.373	0,16	5,410 % fällig am 25.03.2037	418	354	0,01
				Avoca CLO DAC				Clarinda Park CLO DAC			
				3,867 % fällig am 15.07.2030	4.285	4.598	0,14	4,223 % fällig am 15.02.2034	€ 7.550	8.044	0,24
				3,895 % fällig am 12.01.2031	2.154	2.308	0,07				
				4,067 % fällig am 15.04.2033	3.500	3.728	0,11	Contego CLO DAC			
				Babson CLO Ltd.				3,851 % fällig am 23.01.2030	4.189	4.480	0,13
				6,240 % fällig am 20.01.2031	\$ 5.575	5.528	0,16	Countrywide Asset-Backed Certificates			
				Barings CLO Ltd.				5,830 % fällig am 25.12.2036 ^	\$ 89	66	0,00
				6,210 % fällig am 15.04.2031	5.000	4.938	0,15	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
				Barings Euro CLO DAC				4,450 % fällig am 25.10.2032 ^	1.002	974	0,03
				4,302 % fällig am 25.11.2029	€ 2.327	2.526	0,08	4,473 % fällig am 25.07.2036	2.669	2.386	0,07
				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				5,290 % fällig am 25.06.2035	430	374	0,01
				4,037 % fällig am 25.07.2036	\$ 43	41	0,00	5,290 % fällig am 25.07.2037	1.222	1.111	0,03
				4,477 % fällig am 25.11.2035 ^	768	721	0,02	5,290 % fällig am 25.08.2037 ^	157	138	0,00
				4,800 % fällig am 25.06.2043	51	45	0,00	5,330 % fällig am 25.11.2047 ^	46	51	0,00
				5,087 % fällig am 25.08.2034	146	141	0,00	5,350 % fällig am 25.09.2037	640	556	0,02
				5,368 % fällig am 25.02.2036	1.262	1.258	0,04	5,350 % fällig am 25.06.2047 ^	5.072	4.389	0,13
				5,380 % fällig am 25.02.2037	3.784	3.442	0,10	5,360 % fällig am 25.05.2047 ^	1.916	1.667	0,05
				5,450 % fällig am 25.11.2036	1.124	1.081	0,03	5,370 % fällig am 25.09.2037 ^	255	256	0,01
				5,500 % fällig am 25.08.2036	13	13	0,00	5,370 % fällig am 25.09.2047 ^	1.714	1.639	0,05
				6,005 % fällig am 25.07.2034	1.529	1.472	0,04	5,610 % fällig am 25.05.2037	236	222	0,01
				6,200 % fällig am 25.08.2037	93	78	0,00	5,859 % fällig am 25.10.2046 ^	17	17	0,00
				Belle Haven ABS CDO Ltd.				6,095 % fällig am 25.08.2035	124	118	0,00
				5,156 % fällig am 03.11.2044	11.399	3.438	0,10	6,245 % fällig am 25.04.2036 ^	300	282	0,01
				Black Diamond CLO DAC				6,875 % fällig am 25.05.2035	752	739	0,02
				4,060 % fällig am 20.01.2032	€ 1.088	1.170	0,04	7,100 % fällig am 25.08.2035	1.485	1.365	0,04
				4,303 % fällig am 15.05.2032	5.500	5.871	0,17	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
				Blackrock European CLO DAC				4,599 % fällig am 25.01.2032	2	2	0,00
				3,797 % fällig am 15.10.2031	3.100	3.305	0,10	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
				BlueMountain CLO Ltd.				3,044 % fällig am 25.12.2036 ^	574	457	0,01
				6,340 % fällig am 15.07.2031	\$ 3.900	3.849	0,11	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust			
				BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				3,287 % fällig am 25.03.2037 ^	9.571	3.650	0,11
				1,050 % fällig am 15.01.2031	€ 497	500	0,02	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
				3,897 % fällig am 15.01.2031	9.445	10.096	0,30	2,959 % fällig am 25.01.2037 ^	141	44	0,00
				4,007 % fällig am 15.04.2034	2.200	2.340	0,07	3,075 % fällig am 25.07.2036	1.974	1.839	0,05
				BNPP AM Euro CLO DAC				3,156 % fällig am 25.01.2037 ^	145	45	0,00
				3,827 % fällig am 15.10.2031	1.478	1.577	0,05	CSAB Mortgage-Backed Trust			
				4,031 % fällig am 22.07.2032	5.800	6.183	0,18	6,220 % fällig am 25.09.2036 ^	3.475	1.157	0,03
				Bosphorus CLO DAC				CVC Cordatus Loan Fund DAC			
				4,346 % fällig am 15.12.2030	1.202	1.291	0,04	3,855 % fällig am 21.07.2030	€ 12.782	13.715	0,41
				4,496 % fällig am 12.12.2032	3.400	3.627	0,11	4,156 % fällig am 15.09.2031	2.999	3.202	0,10
				Cairn CLO BV				4,305 % fällig am 26.08.2032	500	534	0,02
				3,957 % fällig am 15.10.2031	5.300	5.668	0,17	Delta Funding Home Equity Loan Trust			
				Cairn CLO DAC				6,013 % fällig am 15.09.2029	\$ 5	5	0,00
				3,842 % fällig am 30.04.2031	2.168	2.318	0,07	Dryden Euro CLO DAC			
				3,912 % fällig am 31.01.2030	3.664	3.937	0,12	3,837 % fällig am 15.04.2033	€ 8.900	9.498	0,28
				4,212 % fällig am 20.10.2028	36	39	0,00	4,157 % fällig am 17.01.2033	5.000	5.313	0,16
				Carlyle Euro CLO DAC				4,183 % fällig am 15.05.2034	5.800	6.192	0,18
				3,877 % fällig am 15.01.2031	6.471	6.912	0,21	EMC Mortgage Loan Trust			
				3,953 % fällig am 15.08.2030	1.449	1.545	0,05	5,890 % fällig am 25.05.2040	\$ 108	104	0,00
				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				Euro-Galaxy CLO DAC			
				4,137 % fällig am 16.01.2033	5.600	5.921	0,18	3,831 % fällig am 24.04.2034	€ 3.800	4.037	0,12
				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				Fieldstone Mortgage Investment Trust			
				4,073 % fällig am 15.11.2031	11.100	11.882	0,35	5,458 % fällig am 25.11.2036	\$ 1.150	669	0,02
				Carrington Mortgage Loan Trust				5,818 % fällig am 25.04.2047	3.908	2.758	0,08
				5,310 % fällig am 25.10.2036	\$ 2.835	2.730	0,08	First Franklin Mortgage Loan Trust			
								5,430 % fällig am 25.12.2036	1.139	484	0,01





BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>STAMMAKTIE</b>				<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>				
Toro European CLO DAC	€	6.200	6,635	0,20				(0,197) % fällig am 31.07.2023	¥	10.079.000	69,741	2,07
3,995 % fällig am 12.01.2032		423	459	0,01	Intelsat Emergence S.A. (d)(j)	19.324	444	0,01				
4,097 % fällig am 15.07.2030												
<b>Triaxx Prime CDO Ltd.</b>				0,00								
5,453 % fällig am 02.10.2039	\$	1.842	34	0,00	<b>LUXUSGÜTER</b>							
<b>Voya Euro CLO DAC</b>					Royal Caribbean Cruises Ltd. (d)	5.356	556	0,02				
3,927 % fällig am 15.10.2030	€	2.156	2.323	0,07								
<b>WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust</b>					<b>ENERGIE</b>							
5,300 % fällig am 25.01.2037	\$	9.863	4.536	0,13	Constellation Oil Services	1.038.200	112	0,00				
5,375 % fällig am 25.05.2037		3.333	3.054	0,09	Holding S.A. 'B' (d)(j)							
<b>Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust</b>					<b>FINANZWERTE</b>							
5,450 % fällig am 25.05.2036		822	621	0,02	National Bank of Greece S.A. (d)	307.710	2.000	0,06				
5,630 % fällig am 25.05.2036		672	510	0,02	<b>IMMOBILIEN</b>							
<b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b>					Adler Group S.A. (d)	33.602	18	0,00				
5,750 % fällig am 25.04.2037		2.967	2.045	0,06	Adler Group S.A.	74.405	45	0,00				
6,875 % fällig am 25.11.2035		5.889	5.798	0,17								
<b>Willow Park CLO DAC</b>												
4,017 % fällig am 15.01.2031	€	873	939	0,03								
		600.484	17,83		<b>RECHTE</b>							
<b>STAATSEMISSIONEN</b>					Intelsat Jackson Holdings S.A. -	4.046	24	0,00				
Argentina Government International Bond					Exp. 05.12.2025							
0,500 % fällig am 09.07.2030	\$	3.875	1.221	0,04	<b>OPTIONSSCHEINE</b>							
1,000 % fällig am 09.07.2029		483	158	0,00	Constellation Oil Services							
1,500 % fällig am 09.07.2035		10.189	3.062	0,09	Holding S.A. 'D' - Exp.							
15,500 % fällig am 17.10.2026	ARS	17.300	7	0,00	10.06.2071 (j)	1	0	0,00				
<b>Mexico Government International Bond</b>					<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>							
6,350 % fällig am 09.02.2035	\$	3.700	3.899	0,12	Nationwide Building Society	6.982	1.023	0,03				
<b>Peru Government International Bond</b>					10,250 % (g)							
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	3.800	1.030	0,03								
<b>Provincia de Buenos Aires</b>												
88,734 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS	315.510	571	0,02								
<b>Republic of Greece Government International Bond</b>												
1,875 % fällig am 24.01.2052	€	1.700	1.186	0,04	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
3,750 % fällig am 30.01.2028		360	397	0,01	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>							
3,900 % fällig am 30.01.2033		2.035	2.282	0,07	Warnermedia Holdings, Inc.	\$	3.100	3,045	0,09			
4,000 % fällig am 30.01.2037		1.120	1.239	0,04	3,528 % fällig am 15.03.2024							
<b>Romania Government International Bond</b>					<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>							
1,750 % fällig am 13.07.2030		5.100	4.254	0,13	(54,758) % fällig am							
<b>Russia Government International Bond</b>					18.09.2023 (e)(f)	ARS	50.061	99	0,00			
4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	\$	400	174	0,01	(28,578) % fällig am							
4,750 % fällig am 27.05.2026 ^		400	202	0,01	18.10.2023 (e)(f)	620.219	1.226	0,04				
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		200	89	0,00	(12,549) % fällig am							
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		600	36	0,00	23.11.2023 (e)(f)	1.637.189	3.302	0,10				
5,625 % fällig am 04.04.2042 ^		200	136	0,00								
<b>South Africa Government International Bond</b>					<b>HUNGARY TREASURY BILLS</b>							
4,850 % fällig am 30.09.2029		10.100	8.904	0,26	16,220 % fällig am							
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	894.100	49.153	1,46	06.07.2023 (e)(f)	HUF	13.520.000	39,465	1,17			
<b>Turkey Government International Bond</b>												
5,750 % fällig am 22.03.2024	\$	1.800	1.774	0,05								
6,350 % fällig am 10.08.2024		9.400	9.255	0,27								
		89.029	2,65									

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BRC	5,130 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 466.900	Fannie Mae 4,000 % - 5,000 % fällig am 01.05.2051 - 01.09.2052	\$ (395.977)	\$ 466.900	\$ 467.100	13,87
					Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.08.2051	(83.801)			
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	3.658	U.S. Treasury Notes	(3.731)	3.658	3.658	2,53
					4,625 % fällig am 30.06.2025				
SAL	5,130	30.06.2023	03.07.2023	85.300	U.S. Treasury Notes	(87.091)	85.300	85.336	0,11
					0,250 % fällig am 31.07.2025				
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						\$ (570.600)	\$ 555.858	\$ 556.094	16,51

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Dynamic Bond Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	925	\$ 1.704	0,05
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	614	806	0,03
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	1.140	1.055	0,03
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	2.230	(6.300)	(0,19)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	4.343	(8.652)	(0,26)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	4.710	8.302	0,25
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	919	768	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	536	(56)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	877	(1.710)	(0,05)
				\$ (4.083)	(0,12)

### VERKAUFSoPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	4	\$ (3)	\$ 0	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	4	(4)	(19)	0,00
				\$ (7)	\$ (19)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (4.102)	(0,12)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AES Corp.	5,000 %	20.12.2025	\$ 500	\$ (47)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	5.300	39	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.700	(30)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	300	2	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	100	2	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	€ 7.000	47	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	\$ 4.300	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	400	0	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	€ 4.300	23	0,00
				\$ 39	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	\$ 87	\$ (5)	0,00
CDX.HY-40 5-Year Index	(5,000)	20.06.2028	45.800	(1.070)	(0,03)
				\$ (1.075)	(0,03)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 200	\$ (1)	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	700	(7)	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	3.300	23	0,00
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000	20.06.2028	€ 15.400	530	0,01
				\$ 545	0,01

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500 %	20.09.2033	£ 93.300	\$ (5.114)	(0,15)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	80.100	5.110	0,15
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	\$ 345.100	4.761	0,14
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	20.09.2023	104.830	(1.465)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	345.100	(6.839)	(0,20)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	24.100	1.788	0,05
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,827	03.07.2028	85.800	(7.981)	(0,23)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,857	15.07.2032	29.520	(4.158)	(0,12)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,999	03.07.2053	17.500	3.896	0,12
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	10.12.2029	40	5	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	20.06.2028	104.830	2.496	0,07
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	31.200	78	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	2.500	(46)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	3.500	(59)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	3.700	(52)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	3.600	(46)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	8.400	(104)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	7.300	(79)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	9.600	(161)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	7.400	(61)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,206	04.01.2027	BRL 13.900	(63)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,045	04.01.2027	136.700	161	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,050	04.01.2027	126.600	154	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,086	04.01.2027	82.400	100	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,098	04.01.2027	126.200	163	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,115	04.01.2027	271.000	2.201	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,460	04.01.2027	145.000	641	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,734	02.01.2025	127.000	(15)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,800	02.01.2025	128.000	16	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,814	04.01.2027	76.300	447	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,835	02.01.2025	129.000	33	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,868	04.01.2027	68.000	420	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,500	04.01.2027	185.800	1.850	0,05
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,000	14.11.2023	CAD 54.100	(664)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,060	28.10.2023	516.600	(4.000)	(0,12)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	387.200	(2.812)	(0,08)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	01.11.2023	NZD 144.800	(1.242)	(0,04)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023	203.200	(1.699)	(0,05)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	\$ 345.100	(4.734)	(0,14)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	20.09.2023	104.830	1.475	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.09.2023	40	0	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	€ 6.700	(712)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	5.800	(604)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	3.400	(356)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	7.200	(675)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	3.500	(328)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	8.800	(131)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	9.000	(135)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	40.700	366	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,160	16.09.2027	PLN 93.100	(1.562)	(0,05)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,210	26.04.2027	116.600	(1.061)	(0,03)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,240	23.09.2027	78.600	(1.399)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,250	23.09.2027	55.300	(990)	(0,03)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,270	20.09.2027	89.800	(1.621)	(0,05)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,280	26.09.2027	26.700	(490)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,310	19.09.2027	94.800	(1.757)	(0,05)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,985	11.10.2027	113.000	(2.969)	(0,09)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,156	13.10.2027	58.300	(1.643)	(0,05)
					\$ (31.666)	(0,93)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (32.157)</b>	<b>(0,95)</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Dynamic Bond Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021 %	25.10.2023	7.600	\$ 434	\$ 1.926	0,06
FAR	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021	15.09.2023	12.200	640	2.939	0,09
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021	15.09.2023	12.800	696	3.187	0,09
							\$ 1.770	\$ 8.052	0,24

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020 %	25.10.2023	38.000	\$ (435)	\$ (3.420)	(0,10)
FAR	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	15.09.2023	61.000	(640)	(5.666)	(0,17)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	3.700	(24)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	3.700	(24)	(75)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	3.700	(26)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	3.700	(26)	(71)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	3.700	(26)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	3.700	(26)	(69)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	3.700	(26)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	3.700	(26)	(68)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	3.700	(25)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	3.700	(25)	(77)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	3.700	(25)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	3.700	(25)	(81)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	10.800	(34)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	10.800	(34)	(135)	(0,01)
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	6.400	(22)	(8)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	6.400	(22)	(26)	0,00
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	15.09.2023	64.000	(697)	(6.032)	(0,18)
							\$ (2.188)	\$ (15.732)	(0,47)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitstermin	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	\$ 2.100	\$ (154)	\$ 145	\$ (9)	0,00
BRC	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(14)	13	(1)	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(2)	3	1	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	400	(6)	9	3	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	15.500	(686)	688	2	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(37)	31	(6)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(6)	7	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.100	(32)	40	8	0,00
JPM	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(12)	12	0	0,00
MYC	California State General Obligation Bonds, Series 2003	1,000	20.09.2024	2.900	23	9	32	0,00
					\$ (926)	\$ 957	\$ 31	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitstermin	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 800	\$ (24)	\$ 21	\$ (3)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	11.000	(379)	334	(45)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	10.900	(378)	334	(44)	0,00
					\$ (781)	\$ 689	\$ (92)	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 3.106	\$ 2.061	\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00
	07.2023	\$ 380	AUD 581	6	0	6	0,00
	08.2023	2.063	3.106	6	0	6	0,00
BOA	07.2023	¥ 330.100	\$ 2.344	60	0	60	0,00
	07.2023	MXN 75.161	4.083	0	(289)	(289)	(0,01)
	07.2023	PLN 19.596	4.700	0	(120)	(120)	0,00
	07.2023	\$ 3.054	AUD 4.677	59	0	59	0,00
	07.2023	142	DKK 964	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	2.924	£ 2.317	22	0	22	0,00
	07.2023	406	PEN 1.489	4	0	4	0,00
	07.2023	3.800	PLN 15.765	77	0	77	0,00
	08.2023	DKK 962	\$ 142	1	0	1	0,00
	08.2023	NZD 756	479	16	0	16	0,00
	08.2023	\$ 490	CNY 3.364	0	(25)	(25)	0,00
	08.2023	808	ZAR 14.777	0	(29)	(29)	0,00
	08.2023	ZAR 1.949	\$ 101	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	HKD 6.434	823	1	0	1	0,00
	09.2023	KRW 71.850	57	2	0	2	0,00
	09.2023	TWD 1.292	43	1	0	1	0,00
	09.2023	\$ 8.467	INR 700.307	46	0	46	0,00
BPS	07.2023	AUD 2.220	\$ 1.471	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	DKK 535	77	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	£ 177	219	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	PLN 6.174	1.497	0	(21)	(21)	0,00
	07.2023	\$ 88	BRL 425	0	0	0	0,00
	07.2023	4.133	€ 3.783	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	1.130	£ 882	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	52.799	¥ 7.339.012	0	(2.023)	(2.023)	(0,06)
	07.2023	266	PLN 1.100	5	0	5	0,00
	08.2023	BRL 425	\$ 87	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH 2.554	370	17	0	17	0,00
	08.2023	TWD 647	21	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 1.472	AUD 2.220	7	0	7	0,00
	08.2023	579	CNY 3.956	0	(31)	(31)	0,00
	08.2023	242	ZAR 4.512	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	ZAR 32.267	\$ 1.758	57	0	57	0,00
	09.2023	\$ 177	PEN 648	1	0	1	0,00
	10.2023	ZAR 264.036	\$ 14.186	356	0	356	0,01
BRC	07.2023	PLN 5.604	1.342	0	(36)	(36)	0,00
	08.2023	\$ 2.436	COP10.375.848	19	0	19	0,00
	08.2023	295	ZAR 5.460	0	(8)	(8)	0,00
	09.2023	62	ILS 221	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	164	PEN 600	1	0	1	0,00
BSH	07.2023	1.315	4.838	20	0	20	0,00
CBK	07.2023	CAD 3.496	\$ 2.565	0	(76)	(76)	0,00
	07.2023	CLP 6.717.507	8.300	0	(65)	(65)	0,00
	07.2023	PEN 9.420	2.594	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	\$ 1.317	AUD 2.019	27	0	27	0,00
	07.2023	8.776	€ 8.100	64	(3)	61	0,00
	07.2023	4.380	PEN 16.175	81	0	81	0,00
	07.2023	931	PLN 3.833	11	0	11	0,00
	08.2023	PEN 10.169	\$ 2.603	0	(192)	(192)	(0,01)
	08.2023	TWD 623	20	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 8.329	CLP 6.814.398	105	0	105	0,00
CLY	07.2023	DKK 1.558	\$ 225	0	(3)	(3)	0,00
DUB	07.2023	PEN 9.420	2.576	0	(23)	(23)	0,00
	07.2023	\$ 24.689	BRL 133.775	3.043	0	3.043	0,09
	07.2023	5.168	PEN 18.841	28	0	28	0,00
	09.2023	9	34	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	BRL 134.200	\$ 27.793	0	(26)	(26)	0,00
	07.2023	\$ 18.415	MXN 323.929	440	0	440	0,01
	07.2023	1.175	PLN 4.929	37	0	37	0,00
	09.2023	27.793	BRL 135.687	22	0	22	0,00
	10.2023	ZAR 27.186	\$ 1.449	25	0	25	0,00
JPM	07.2023	¥ 2.386.857	16.690	176	0	176	0,01
	07.2023	\$ 2.937	AUD 4.493	53	0	53	0,00
	07.2023	659.427	€ 603.926	0	(543)	(543)	(0,02)
	07.2023	474	PLN 2.010	20	0	20	0,00
	08.2023	CNH 2.050	\$ 297	14	0	14	0,00
	08.2023	€ 603.926	660.349	563	0	563	0,02
	08.2023	HUF 24.175	69	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 610	CNY 4.173	0	(33)	(33)	0,00
	08.2023	757	HUF 260.912	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	16.690	¥ 2.376.714	0	(177)	(177)	(0,01)
	08.2023	1.777	ZAR 32.513	0	(62)	(62)	0,00
	08.2023	87	\$ 5	0	0	0	0,00
	09.2023	PEN 42.510	11.545	0	(112)	(112)	0,00
	09.2023	\$ 60	ILS 212	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	624	INR 51.438	1	0	1	0,00
	09.2023	2.680	PEN 9.788	4	0	4	0,00
	10.2023	8.427	MXN 147.958	34	0	34	0,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Dynamic Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2023	CAD 3.427	\$ 2.569	\$ 0	\$ (21)	\$ (21)	0,00
	07.2023	€ 1.916	2.049	0	(41)	(41)	0,00
	07.2023	£ 144.165	178.456	0	(4.828)	(4.828)	(0,14)
	07.2023	\$ 2.592	€ 2.416	44	0	44	0,00
	07.2023	1.027	£ 824	21	0	21	0,00
	07.2023	93	PLN 403	6	0	6	0,00
	08.2023	HUF 828.406	\$ 2.428	35	0	35	0,00
	09.2023	KRW 133.187	104	3	0	3	0,00
	07.2023	£ 508	640	0	(5)	(5)	0,00
MYI	07.2023	\$ 126	DKK 859	0	0	0	0,00
	07.2023	8	€ 7	0	0	0	0,00
	07.2023	1.233	£ 977	9	0	9	0,00
	07.2023	1.035	PLN 4.367	39	0	39	0,00
	08.2023	DKK 858	\$ 126	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD 696	23	1	0	1	0,00
	09.2023	KRW 149.681	117	3	0	3	0,00
	09.2023	\$ 135	INR 11.110	0	0	0	0,00
	07.2023	5.034	£ 3.938	0	(27)	(27)	0,00
RBC	07.2023	5	MXN 90	1	0	1	0,00
	08.2023	MXN 76.881	\$ 4.436	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	\$ 33	PLN 138	1	0	1	0,00
	07.2023	AUD 4.562	\$ 3.028	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	\$ 4.144	AUD 6.342	77	0	77	0,00
	08.2023	CNH 972	\$ 141	7	0	7	0,00
	08.2023	NZD 268	168	3	0	3	0,00
	08.2023	\$ 3.031	AUD 4.562	8	0	8	0,00
	08.2023	795	CNH 5.455	0	(42)	(42)	0,00
SCX	08.2023	1.623	CNY 11.080	0	(90)	(90)	0,00
	09.2023	TWD 1.080	\$ 35	1	0	1	0,00
	09.2023	\$ 391	INR 32.170	0	0	0	0,00
	09.2023	975	PEN 3.591	10	0	10	0,00
	07.2023	€ 616.171	\$ 662.839	0	(9.404)	(9.404)	(0,28)
	07.2023	PLN 241.184	55.985	0	(3.329)	(3.329)	(0,10)
	07.2023	\$ 2.512	AUD 3.839	44	0	44	0,00
	07.2023	¥ 23.470.000	\$ 177.970	14.951	0	14.951	0,45
	07.2023	PEN 14.259	3.909	0	(22)	(22)	0,00
SSB	07.2023	\$ 8.374	CLP 6.727.138	3	0	3	0,00
	08.2023	CLP 6.746.566	\$ 8.374	1	0	1	0,00
	08.2023	\$ 3.904	PEN 14.259	20	0	20	0,00
	07.2023	AUD 5.614	\$ 3.708	0	(29)	(29)	0,00
	07.2023	\$ 1.329	AUD 2.032	24	0	24	0,00
	07.2023	5.232	CAD 6.923	4	(4)	0	0,00
	07.2023	173.299	£ 136.381	89	0	89	0,00
	08.2023	CAD 6.920	\$ 5.232	4	(4)	0	0,00
	08.2023	£ 136.381	173.337	0	(86)	(86)	0,00
TOR	08.2023	HUF 15.313	44	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 3.711	AUD 5.614	29	0	29	0,00
	07.2023	AUD 8.947	\$ 5.974	31	(12)	19	0,00
	07.2023	€ 138	148	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 304	AUD 465	5	0	5	0,00
	08.2023	5.979	8.947	12	(31)	(19)	0,00
	08.2023	ZAR 678.817	\$ 35.349	10	(441)	(431)	(0,01)
	09.2023	SGD 23.771	17.786	171	0	171	0,01
	09.2023	\$ 51	ILS 184	0	(2)	(2)	0,00
UAG	09.2023	8.014	INR 662.512	39	0	39	0,00
				\$ 21.238	\$ (22.391)	\$ (1.153)	(0,04)

### ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 1.179	\$ 782	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07.2023	\$ 1.499	AUD 2.291	26	0	26	0,00
	08.2023	783	1.179	2	0	2	0,00
BOA	07.2023	AUD 237	\$ 158	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 3.075	AUD 4.727	72	0	72	0,01
BPS	07.2023	AUD 6.229	\$ 4.127	1	(20)	(19)	0,00
	08.2023	\$ 3.962	AUD 5.976	20	0	20	0,00
CBK	07.2023	AUD 24	\$ 16	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 1.028	AUD 1.574	20	0	20	0,00
JPM	07.2023	1.533	2.345	28	0	28	0,00
MBC	07.2023	AUD 246	\$ 164	0	0	0	0,00
RBC	07.2023	101	68	1	0	1	0,00
	07.2023	2.212	1.469	1	(4)	(3)	0,00
SCX	07.2023	\$ 1.222	AUD 1.870	23	0	23	0,00
	08.2023	1.382	2.079	4	0	4	0,00
SOG	07.2023	2.439	3.728	42	0	42	0,00



Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
TOR	07.2023	AUD 3.631	\$ 2.398	\$ 0	\$ (19)	\$ (19)	0,00
	07.2023	\$ 2.592	AUD 3.963	46	0	46	0,00
	08.2023	2.400	3.631	19	0	19	0,00
UAG	07.2023	AUD 7.503	\$ 4.989	15	(20)	(5)	0,00
	07.2023	\$ 1.200	AUD 1.833	20	0	20	0,00
	08.2023	4.599	6.921	20	(9)	11	0,00
				\$ 361	\$ (74)	\$ 287	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen fur die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2023	\$ 2.804	CAD 3.815	\$ 79	\$ 0	\$ 79	0,01
CBK	07.2023	47	64	1	0	1	0,00
JPM	07.2023	2.811	3.814	71	0	71	0,00
MBC	07.2023	CAD 24	\$ 18	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	\$ 2.811	CAD 3.818	74	0	74	0,00
				\$ 225	\$ 0	\$ 225	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	07.2023	CHF 20.207	\$ 22.594	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
	07.2023	\$ 34.628	CHF 31.324	385	0	385	0,01
	08.2023	22.594	20.149	0	(8)	(8)	0,00
CLY	07.2023	CHF 10.680	\$ 11.890	0	(48)	(48)	0,00
	08.2023	\$ 11.890	CHF 10.650	48	0	48	0,00
MBC	07.2023	CHF 9.238	\$ 10.304	0	(22)	(22)	0,00
MYI	07.2023	2.713	3.035	3	0	3	0,00
SCX	07.2023	\$ 104	CHF 94	1	0	1	0,00
	07.2023	25.909	23.280	112	0	112	0,01
UAG	07.2023	CHF 20.861	\$ 23.271	0	(46)	(46)	0,00
	07.2023	\$ 23.294	CHF 20.931	102	0	102	0,00
	08.2023	23.252	20.784	46	0	46	0,00
				\$ 705	\$ (124)	\$ 581	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und G Retail EUR (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2023	€ 368	\$ 399	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	07.2023	\$ 83.445	€ 77.645	1.265	0	1.265	0,04
BPS	07.2023	€ 64.459	\$ 70.625	302	(1)	301	0,01
	07.2023	\$ 83.342	€ 77.527	1.240	0	1.240	0,04
	08.2023	69.680	63.505	0	(301)	(301)	(0,01)
CBK	07.2023	€ 68.333	\$ 74.268	3	(287)	(284)	(0,01)
	07.2023	\$ 700	€ 652	12	0	12	0,00
	08.2023	68.962	63.341	238	0	238	0,01
JPM	07.2023	€ 63.368	\$ 69.192	57	0	57	0,00
	08.2023	€ 69.288	€ 63.368	0	(59)	(59)	0,00
MBC	07.2023	€ 36.882	\$ 40.304	103	(38)	65	0,00
	07.2023	\$ 49	€ 46	1	0	1	0,00
SOG	07.2023	83.399	77.527	1.183	0	1.183	0,03
				\$ 4.404	\$ (689)	\$ 3.715	0,11

Zum 30. Juni 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschuttend und Class E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2023	\$ 1.188	£ 942	\$ 10	\$ 0	\$ 10	0,00
BPS	07.2023	832.907	673.387	23.205	(1)	23.204	0,69
BRC	07.2023	£ 53.910	\$ 67.251	0	(1.287)	(1.287)	(0,04)
	07.2023	\$ 1.659	£ 1.322	22	(1)	21	0,00
CBK	07.2023	£ 453	£ 577	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 1.956	£ 1.549	14	0	14	0,00
JPM	07.2023	£ 654.483	\$ 827.528	0	(4.549)	(4.549)	(0,14)
	08.2023	\$ 827.704	£ 654.483	4.540	0	4.540	0,13
MBC	07.2023	831.823	671.949	22.463	(4)	22.459	0,67
MYI	07.2023	832.450	669.785	19.082	0	19.082	0,57
TOR	07.2023	£ 656.585	\$ 834.323	0	(427)	(427)	(0,01)
	08.2023	\$ 834.505	£ 656.585	412	0	412	0,01
				\$ 69.749	\$ (6.269)	\$ 63.480	1,88

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Dynamic Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	NOK 9	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 113	NOK 1.243	3	0	3	0,00
BPS	07.2023	NOK 879	\$ 82	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 82	NOK 878	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	101	1.138	5	0	5	0,00
GLM	07.2023	NOK 930	\$ 86	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 86	NOK 929	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	90	999	3	0	3	0,00
				\$ 12	\$ (1)	\$ 11	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK 19.648	\$ 1.821	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07.2023	\$ 16	SEK 173	0	0	0	0,00
	08.2023	1.808	19.483	0	(1)	(1)	0,00
BRC	07.2023	SEK 125	\$ 12	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	\$ 1.190	SEK 13.001	13	0	13	0,00
GLM	07.2023	SEK 25	\$ 2	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	18	2	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 1.237	SEK 13.320	0	(4)	(4)	0,00
MYI	07.2023	SEK 19.516	\$ 1.808	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 1.777	SEK 19.076	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	1.808	19.492	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2023	SEK 80	\$ 7	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 1.237	SEK 13.381	2	0	2	0,00
				\$ 18	\$ (17)	\$ 1	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 59.406 1,76

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2053	\$ 96.900	\$ (79.045)	(2,35)
2,000 % fällig am 01.08.2053	4.000	(3.268)	(0,09)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (82.313)	(2,44)
Summe Anlagen		\$ 3.844.962	114,19
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (477.669)	(14,19)
Nettovermögen		\$ 3.367.293	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.

## (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,24 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 112	\$ 112	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071	10.06.2022	0	0	0,00
Deutsche Bank AG 0,898 % fällig am 28.05.2024	25.05.2021	1.900	1.806	0,05
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	25.05.2021	800	631	0,02
Intelsat Emergence S.A.	05.09.2018	2.000	444	0,01
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	29.07.2022	2.458	2.250	0,07
		\$ 7.270	\$ 5.243	0,15

(k) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 213 USD (31. Dezember 2022: 2.041 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(l) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 3.486 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von 14.370 USD (31. Dezember 2022: 48.797 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 55.345 USD (31. Dezember 2022: 45.907 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 601	\$ 3.006.528	\$ 4.391	\$ 3.011.520
Investmentfonds	336.750	0	0	336.750
Pensionsgeschäfte	0	555.858	0	555.858
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	3.565	19.582	0	23.147
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(82.313)	0	(82.313)
<b>Summen</b>	<b>\$ 340.916</b>	<b>\$ 3.499.655</b>	<b>\$ 4.391</b>	<b>\$ 3.844.962</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.707.373	\$ 4.828	\$ 2.712.201
Investmentfonds	217.139	131.583	0	348.722
Pensionsgeschäfte	0	1.145.692	0	1.145.692
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(2.766)	(83.089)	0	(85.855)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(82.152)	0	(82.152)
<b>Summen</b>	<b>\$ 214.373</b>	<b>\$ 3.819.407</b>	<b>\$ 4.828</b>	<b>\$ 4.038.608</b>

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,000 %	21.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (199)	\$ (217)	(0,01)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (217)</b>	<b>(0,01)</b>

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 32	\$ (30)	\$ 2	\$ 36	\$ 0	\$ 36
BOA	(252)	0	(252)	(3.100)	3.170	70
BPS	23.165	(16.310)	6.855	(3.900)	3.880	(20)
BRC	(1.293)	806	(487)	(359)	320	(39)
BSH	20	0	20	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(32)	0	(32)	4.410	(4.530)	(120)
CLY	(3)	0	(3)	(250)	0	(250)
DUB	3.048	(2.920)	128	24	(100)	(76)
FAR	(2.727)	2.640	(87)	(1.982)	1.690	(292)
GLM	(82)	0	(82)	(17.283)	17.179	(104)

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
GST	\$ (4)	\$ 0	\$ (4)	\$ (48)	\$ 208	\$ 160
HUS	9	0	9	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(14)	0	(14)	(2.303)	310	(1.993)
MBC	17.718	(12.860)	4.858	2.683	(3.440)	(757)
MYC	(2.858)	2.780	(78)	(2.059)	1.970	(89)
MYI	19.122	(12.730)	6.392	1.202	(910)	292
RBC	(35)	0	(35)	(86)	60	(26)
RYL	1	0	1	(76)	0	(76)
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(40)	0	(40)
SCX	178	(100)	78	(8.642)	8.280	(362)
SOG	(11.464)	8.950	(2.514)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	14.953	(15.240)	(287)	(2.124)	1.540	(584)
TOR	57	0	57	(12.777)	9.630	(3.147)
UAG	(133)	2.680	2.547	(667)	560	(107)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	42,13	30,35
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,29	46,36
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	1,16
Investmentfonds	10,00	10,00
Pensionsgeschäfte	16,51	32,89
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,12)	0,08
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,95)	(1,19)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,76	(1,36)
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,44)	(2,36)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,01)	(0,06)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,10	1,91
Unternehmensanleihen und Wechsel	23,48	22,11
Wandelanleihen & Wechsel	0,26	0,40
Kommunalanleihen und Wechsel	0,27	0,35
US-Regierungsbehörden	20,48	8,36
US-Schatzobligationen	2,72	2,61
Non-Agency-MBS	8,26	8,21
Forderungsbesicherte Wertpapiere	17,83	18,00
Staatsemissionen	2,65	3,20
Stammaktien	0,09	0,05
Bezugsrechte	0,00	0,00
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,03	0,17
Kurzfristige Instrumente	12,26	12,50
Investmentfonds	10,00	10,00
Pensionsgeschäfte	16,51	32,89
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,12)	0,08
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen -		
Schutzverkauf	0,00	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzkauf	(0,03)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,01	0,03
Zinsswaps	(0,93)	(1,19)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,24	0,34
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,47)	(0,95)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen -		
Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	k. A.	0,02
Devisenterminkontrakte	(0,04)	(1,05)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	2,03	0,29
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,44)	(2,36)
Sonstige Aktiva und Passiva	(14,19)	(15,93)
Nettovermögen	100,00	100,00







BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>STAMMAKTIVEN LUXUSGÜTER</b>								<b>SCHATZTITEL DES EUROPÄISCHEN STABILITÄTSMECHANISMUS</b>			
BYD Co. Ltd. 'H'	542.554	€ 15.944	0,38	LONGi Green Energy Technology Co. Ltd. 'A'	2.481.197	€ 8.998	0,21	3,328 % fällig am 23.11.2023 (b)(c)	€ 32.100	€ 31.652	0,75
Luminar Technologies, Inc. (a)	679.800	4.287	0,10	MediaTek, Inc.	193.008	3.916	0,09	3,337 % fällig am 07.09.2023 (b)(c)	550	547	0,01
Panasonic Holdings Corp.	2.947.740	33.075	0,78	Nanya Technology Corp.	1.762.907	3.684	0,09				
QuantumScape Corp. (a)	78.600	576	0,01	Novatek Microelectronics Corp.	350.204	4.407	0,10				
		53.882	1,27	NXP Semiconductors NV	85.100	15.965	0,38	<b>SCHATZTITEL DER EUROPÄISCHEN UNION</b>			
<b>ENERGIE</b>								3,105 % fällig am 08.09.2023 (b)(c)			
Neste Oyj	342.000	12.067	0,28	Ouster, Inc. (a)	25.215	114	0,00	15.000	14.907	0,35	
SK Innovation Co. Ltd. (a)	88.449	9.829	0,23	Power Integrations, Inc.	56.500	4.903	0,12	6.250	6.232	0,14	
		21.896	0,51	Realtek Semiconductor Corp.	411.407	4.702	0,11	300	299	0,01	
<b>FINANZWERTE</b>								3,173 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)			
Bank of America Corp.	475.000	12.491	0,29	Samsung Electronics Co. Ltd.	301.100	15.197	0,36	550	548	0,01	
Citigroup, Inc.	302.700	12.774	0,30	Samsung SDI Co. Ltd.	20.071	9.394	0,22	450	449	0,01	
JPMorgan Chase & Co.	103.200	13.757	0,32	SMA Solar Technology AG (a)	158.978	17.820	0,42	5.000	4.999	0,12	
Wells Fargo & Co.	352.600	13.794	0,33	SolarEdge Technologies, Inc. (a)	117.100	28.878	0,68	3,326 % fällig am 08.09.2023 (b)(c)	350	348	0,01
		52.816	1,24	Synopsys, Inc. (a)	18.000	7.184	0,17	3,387 % fällig am 08.09.2023 (b)(c)	2.600	2.584	0,06
<b>INDUSTRIEWERTE</b>											
ABB Ltd.	463.440	16.719	0,39	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	1.088.809	18.436	0,43				
Aker Carbon Capture ASA (a)	6.124.174	7.381	0,17	Trimble, Inc. (a)	270.100	13.106	0,31				
Ballard Power Systems, Inc. (a)	208.500	838	0,02	Unimicron Technology Corp.	1.026.100	5.348	0,13				
Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. 'A'	142.660	4.131	0,10	United Microelectronics Corp.	7.498.819	10.799	0,25				
Daifuku Co. Ltd.	623.700	11.755	0,28	Xinyi Solar Holdings Ltd.	11.726.500	12.478	0,29				
FuelCell Energy, Inc. (a)	467.500	926	0,02	Zebra Technologies Corp. 'A' (a)	65.800	17.842	0,42				
Generac Holdings, Inc. (a)	37.600	5.140	0,12			357.792	8,40				
GXO Logistics, Inc. (a)	373.500	21.506	0,51	<b>BAUSTOFFE</b>				<b>FRANCE TREASURY BILLS</b>			
Hitachi Zosen Corp.	3.432.700	20.785	0,49	Calix Ltd. (a)	1.188.128	3.043	0,07	2,902 % fällig am 05.07.2023 (b)(c)	2.550	2.550	0,06
ITM Power PLC (a)	1.371.816	1.158	0,03	Canfor Corp. (a)	1.155.200	19.029	0,45	3,127 % fällig am 02.08.2023 (b)(c)	3.250	3.242	0,08
NEL ASA (a)	11.600.925	12.517	0,29	Hanwha Solutions Corp.	338.017	9.991	0,23	3,135 % fällig am 02.08.2023 (b)(c)	900	898	0,02
Plug Power, Inc. (a)	429.200	4.087	0,10	Holmen AB 'B'	512.100	16.845	0,40	3,146 % fällig am 02.08.2023 (b)(c)	700	698	0,02
PowerCell Sweden AB (a)	133.581	953	0,02	LG Chem Ltd.	40.600	18.944	0,45	3,149 % fällig am 02.08.2023 (b)(c)	700	698	0,02
Schneider Electric SE	189.600	31.567	0,74	Stora Enso Oyj 'R'	1.392.400	14.805	0,35	3,349 % fällig am 30.08.2023 (b)(c)	650	647	0,01
Sensata Technologies Holding PLC	456.276	18.816	0,44	thyssenkrupp AG	584.900	4.198	0,10	3,358 % fällig am 23.08.2023 (b)(c)	6.450	6.420	0,15
Siemens Energy AG (a)	1.735.400	28.120	0,66	Umicore S.A.	156.400	4.007	0,09	3,370 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	650	646	0,02
Titan Wind Energy Suzhou Co. Ltd. 'A'	2.304.747	4.436	0,10	UPM-Kymmene Oyj	614.300	16.774	0,39	3,387 % fällig am 30.08.2023 (b)(c)	400	398	0,01
Valmet Oyj	896.500	22.870	0,54	Wacker Chemie AG	36.600	4.608	0,11	3,402 % fällig am 30.08.2023 (b)(c)	40.000	39.790	0,93
Vestas Wind Systems A/S	1.579.000	38.472	0,90	West Fraser Timber Co. Ltd.	291.400	22.972	0,54	3,404 % fällig am 30.08.2023 (b)(c)	12.110	12.047	0,28
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd. 'H'	8.559.400	5.392	0,13			135.216	3,18	3,428 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	8.060	8.007	0,19
		257.569	6,05	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				3,431 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>								3,431 % fällig am 04.10.2023 (b)(c)			
ams-OSRAM AG (a)	399.720	2.642	0,06	Xinyi Energy Holdings Ltd.	20.560.479	6.173	0,14	3,432 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	33.730	33.507	0,79
Canadian Solar, Inc. (a)	196.700	6.976	0,16	Summe Stammaktien		885.344	20,79	3,434 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	6.450	6.407	0,15
Chipbond Technology Corp.	1.163.908	2.165	0,05	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				3,435 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)			
Cirrus Logic, Inc. (a)	127.400	9.460	0,22	Hanwha Solutions Corp.	4.662	102	0,00	3,440 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	49.300	48.975	1,15
Daqo New Energy Corp. (a)	164.000	5.968	0,14	0,000 %				3,444 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	12.900	12.815	0,30
Delta Electronics, Inc.	859.112	8.727	0,21	<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>				3,445 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)			
Elan Microelectronics Corp.	1.059.109	3.175	0,07	Weyerhaeuser Co.	662.000	20.333	0,48				
Enphase Energy, Inc. (a)	177.800	27.294	0,64	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>GERMANY TREASURY BILLS</b>			
First Solar, Inc. (a)	247.600	43.141V	1,01	<b>ÖSTERREICHISCHE SCHATZTITEL</b>				3,143 % fällig am 19.07.2023 (b)(c)			
Flat Glass Group Co. Ltd. 'H'	3.048.000	9.578	0,22	2,971 % fällig am 27.07.2023 (b)(c)				800			
Flex Ltd. (a)	835.700	21.172	0,50	2,996 % fällig am 27.07.2023 (b)(c)				29.100			
Globalwafers Co. Ltd.	371.309	5.462	0,13					799			
GoerTek, Inc. 'A'	1.448.705	3.254	0,08					29.062			
Hamamatsu Photonics KK	124.800	5.607	0,13					29.861			
								0,70			
								<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
								3,194 % fällig am 19.07.2023 (b)(c)			
								29.100			
								69.699			
								1,64			



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
(0,188) % fällig am 18.07.2023 (b)(c)	¥ 30.000	€ 190	0,00	<b>INVESTMENTFONDS</b>				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
(0,187) % fällig am 10.07.2023 (b)(c)	9.732.000	61.718	1,45	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	2.485.300	€ 241.004	5,66
(0,179) % fällig am 11.09.2023 (b)(c)	2.452.000	15.553	0,36	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund (f)	6.473.317	€ 102.529	2,41	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (f)	1.532.400	15.843	0,37
(0,168) % fällig am 10.07.2023 (b)(c)	3.958.000	25.101	0,59	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (f)	2.942.298	28.209	0,66			256.847	6,03
(0,152) % fällig am 25.09.2023 (b)(c)	11.999.000	76.116	1,79	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (f)	3.189.591	32.276	0,76	Summe Investmentfonds		€ 419.861	9,86
(0,132) % fällig am 25.09.2023 (b)(c)	3.411.000	21.638	0,51			163.014	3,83				
		270.415	6,35								
Summe kurzfristige Instrumente		641.542	15,07								
Summe Übertragbare Wertpapiere		€ 4.246.875	99,74								

### PENSIONSGESCHÄFTEN

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	3,100 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 73.200	Societe Nationale SNCF S.A. 4,150 % fällig am 18.01.2042	€ (73.831)	€ 73.200	€ 73.219	1,72
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	\$ 17.637	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(16.489)	16.166	16.166	0,38
IND	3,150	30.06.2023	03.07.2023	€ 28.000	France Government International Bond 1,500 % - 5,500 % fällig am 25.10.2023 - 25.05.2050	(28.465)	28.000	28.007	0,66
	3,150	30.06.2023	03.07.2023	212.200	Agence Francaise de Developpement EPIC 0,000 % - 3,125 % fällig am 04.01.2024 - 31.10.2034	(5.350)	212.200	212.256	4,98
					Agence France Locale 3,000 % fällig am 20.03.2030	(692)			
					BNG Bank NV 0,050 % - 1,500 % fällig am 20.11.2029 - 15.07.2039	(2.220)			
					Bpifrance 0,250 % fällig am 04.06.2031	(798)			
					Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 2,375 % - 4,000 % fällig am 25.01.2024 - 15.12.2025	(1.508)			
					Entwicklungsbank des Europarates 0,000 % - 1,000 % fällig am 09.04.2027 - 13.04.2029	(2.300)			
					Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % - 2,750 % fällig am 17.07.2023 - 10.07.2048	(20.475)			
					Europäische Investitionsbank 0,000 % - 3,625 % fällig am 15.07.2024 - 16.10.2048	(29.499)			
					Europäischer Stabilitätsmechanismus 0,000 % - 1,625 % fällig am 31.07.2023 - 17.11.2036	(5.212)			
					Europäische Union 0,000 % - 3,375 % fällig am 04.11.2025 - 04.10.2052	(30.747)			
					Schatztitel der Europäischen Union 0,000 % fällig am 08.09.2023 - 10.11.2023	(20.536)			
					Kreditanstalt für Wiederaufbau 0,000 % - 3,125 % fällig am 02.04.2024 - 15.06.2037	(32.466)			
					La Poste S.A. 2,625 % - 3,125 % fällig am 14.09.2028 - 14.03.2033	(1.143)			
					Land Berlin 0,010 % fällig am 26.10.2028	(3.312)			
					Landwirtschaftliche Rentenbank 0,500 % fällig am 06.03.2025	(1.237)			
					Luxembourg Government International Bond 0,000 % - 3,250 % fällig am 19.03.2028 - 02.03.2043	(50.663)			
					Niederlandse Waterschapsbank NV 0,000 % fällig am 16.02.2037	(1.634)			
					NRW Bank 0,490 % fällig am 23.02.2026	(600)			
					SFIL S.A. 1,500 % fällig am 05.03.2032	(174)			
					Niedersachsen 2,875 % fällig am 18.04.2028	(197)			
					Nordrhein-Westfalen 0,000 % - 0,625 % fällig am 17.11.2023 - 26.11.2029	(2.043)			
					UNEDIC 0,000 % - 1,250 % fällig am 17.02.2025 - 25.05.2036	(4.648)			
Summe Pensionsgeschäfte						€ (336.239)	€ 329.566	€ 329.648	7,74

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	9.359	€ (4.643)	(0,11)
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1.682	(2.074)	(0,05)
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2023	3.482	9.485	0,22
Euro STOXX 50 September Futures	Short	09.2023	3.258	(2.145)	(0,05)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	1.453	(777)	(0,02)
FTSE 100 Index September Futures	Long	09.2023	470	(334)	(0,01)
Nikkei 225 Yen-Denominated September Futures	Long	09.2023	628	2.008	0,05
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	4.758	(8.676)	(0,20)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	1.707	1.773	0,04
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1.724	2.072	0,05
				€ (3.311)	(0,08)
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				€ (3.311)	(0,08)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 500	€ (4)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	100	2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	1.200	4	0,00
				€ 2	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 102.800	€ 262	0,01
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	1.161.300	7.673	0,18
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000	20.06.2028	€ 15.100	474	0,01
				€ 8.409	0,20

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750 %	21.06.2053	110.400	€ (879)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	324.500	3.520	0,08
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	30.500	(307)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	96.700	(132)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,250	16.06.2031	82.272	(6.476)	(0,15)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	150.600	(18.046)	(0,42)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	181	(21)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2029	123.500	(13.870)	(0,33)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	17.200	(343)	(0,01)
				€ (36.554)	(0,86)	
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>				€ (28.143)	(0,66)	

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinstrument	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	China Government International Bond	(1,000) %	20.12.2023	\$ 17.130	€ (303)	€ 240	€ (63)	0,00
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.12.2023	16.800	(309)	247	(62)	0,00
					€ (612)	€ 487	€ (125)	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Zahlung	IXITR Index	35.821	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 136.046	21.02.2024	€ 0	€ (2.830)	€ (2.830)	(0,07)

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2023	CHF	5.230	€ 5.404	€ 46	€ 0	€ 46	0,00
	07.2023	DKK	79.538	10.682	0	0	0	0,00
	07.2023	€	4.505	\$ 4.935	19	0	19	0,00
	07.2023	£	1.202	€ 1.403	3	0	3	0,00
	07.2023	MXN	1.514.828	\$ 82.283	0	(5.300)	(5.300)	(0,12)
	07.2023	\$	50.244	CLP 40.670.241	419	0	419	0,01
	07.2023		26.619	€ 24.769	370	0	370	0,01
	08.2023		77	CNY 532	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	HKD	664.812	\$ 85.081	91	0	91	0,00
	09.2023	KRW	29.603.067	23.365	734	0	734	0,02
	09.2023	TWD	3.453.846	113.775	2.415	0	2.415	0,06
	09.2023	\$	9.264	INR 761.394	(9)	(9)	(9)	0,00
BPS	07.2023	AUD	31.480	€ 19.539	339	(7)	332	0,01
	07.2023	€	17.811	AUD 29.332	84	0	84	0,00
	07.2023	\$	1.501.445	\$ 1.644.716	6.549	(463)	6.086	0,14
	07.2023	¥	4.029.015	€ 26.873	1.320	0	1.320	0,03
	07.2023	\$	553.613	514.883	7.447	0	7.447	0,17
	08.2023	AUD	27.143	16.475	0	(76)	(76)	0,00
	08.2023	TWD	1.728.769	\$ 56.623	1.011	0	1.011	0,02
	08.2023	\$	91	CNY 625	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023		1.553.626	€ 1.415.941	0	(6.150)	(6.150)	(0,14)
	08.2023		5.624	TWD 172.130	0	(88)	(88)	0,00
BRC	07.2023	€	1.364	CAD 1.960	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023		38.572	DKK 287.210	2	0	2	0,00
	07.2023		8.435	£ 7.236	5	(8)	(3)	0,00
	07.2023	£	49.719	€ 57.555	0	(381)	(381)	(0,01)
	07.2023	NOK	100.791	8.478	0	(145)	(145)	0,00
	07.2023	SEK	112.037	9.635	127	0	127	0,00
	08.2023	CNH	28	\$ 4	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	287.132	€ 38.572	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	\$	37.911	COP 161.511.195	265	0	265	0,01
	09.2023	HKD	86.463	\$ 11.067	13	0	13	0,00
	09.2023	ILS	190.231	53.181	1.620	0	1.620	0,04
CBK	07.2023	AUD	15.915	€ 9.897	187	0	187	0,00
	07.2023	€	4.395	AUD 7.227	14	0	14	0,00
	07.2023		992	£ 854	3	0	3	0,00
	07.2023		189.631	\$ 204.571	0	(2.124)	(2.124)	(0,05)
	07.2023	MXN	304	18	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	1.799.846	58.961	1.061	0	1.061	0,02
	08.2023	\$	50	CNH 347	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023		226	KRW 290.191	0	(4)	(4)	0,00
	10.2023		12.335	CLP 10.074.895	66	0	66	0,00
CLY	08.2023	£	18	€ 21	0	0	0	0,00
DUB	07.2023	NOK	13.896	1.156	0	(33)	(33)	0,00
GLM	07.2023	\$	43.705	COP 184.476.458	320	0	320	0,01
	07.2023		2.394	MXN 41.984	45	0	45	0,00
	08.2023		155	ZAR 2.877	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023		73.259	BRL 370.780	2.497	0	2.497	0,06
JPM	07.2023	CHF	420	€ 433	3	0	3	0,00
	07.2023	DKK	266.393	35.771	0	(7)	(7)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
	07.2023	€	4.964	DKK	36.967	€	1	0,00		
	07.2023		8.520	¥	1.267.600		0	(480)	(0,01)	
	07.2023		1.032	SEK	11.985		0	(14)	0,00	
	07.2023		240.155	\$	259.037		60	(2.784)	(0,06)	
	07.2023	£	2.555	€	2.960		0	(17)	0,00	
	07.2023	¥	632.439		4.247		236	0	236	0,01
	07.2023	SEK	150.158		13.009		267	0	267	0,01
	08.2023	DKK	36.957		4.964		0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$	96	CNY	660		0	(5)	(5)	0,00
	08.2023		79.190	€	72.424		0	(62)	(62)	0,00
	08.2023		146.440	HUF	50.867.136		667	(272)	395	0,01
	09.2023	ILS	182.549	\$	51.390		1.881	0	1.881	0,04
	09.2023	\$	72.247	INR	5.954.234		112	0	112	0,00
	09.2023		81.734	PEN	300.945		715	0	715	0,02
	10.2023	MXN	926.676	\$	52.778		0	(181)	(181)	0,00
MBC	07.2023	CAD	166.122	€	114.646		59	(483)	(424)	(0,01)
	07.2023	€	2.917	DKK	21.724		1	0	1	0,00
	07.2023		164.832	£	142.326		1.015	0	1.015	0,02
	07.2023		76.829	¥	12.108.044		0	(37)	(37)	0,00
	07.2023		158.565	\$	173.387		360	0	360	0,01
	07.2023	£	168.418	€	194.358		0	(1.893)	(1.893)	(0,05)
	07.2023	¥	14.680.286		98.295		5.187	0	5.187	0,12
	07.2023	SGD	18	\$	14		0	0	0	0,00
	07.2023	\$	51.135	CLP	42.088.907		1.064	0	1.064	0,02
	08.2023	DKK	21.718	€	2.917		0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	£	142.494		164.832		0	(1.004)	(1.004)	(0,02)
	08.2023	¥	12.073.884		76.829		20	0	20	0,00
	08.2023	\$	41	CNH	290		0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	¥	15.410.000	€	99.459		877	0	877	0,02
	09.2023	KRW	54.875.510	\$	43.029		1.102	0	1.102	0,03
MYI	07.2023	AUD	10	€	6		0	0	0	0,00
	07.2023	CHF	27.918		28.759		155	0	155	0,00
	07.2023	€	2.949	CAD	4.261		7	(5)	2	0,00
	07.2023		124	CHF	121		0	0	0	0,00
	07.2023		1.920	£	1.658		12	0	12	0,00
	07.2023		41.929	¥	6.271.800		0	(2.152)	(2.152)	(0,05)
	07.2023		446	\$	486		0	0	0	0,00
	07.2023	£	55	€	64		0	0	0	0,00
	07.2023	¥	415.400		2.775		140	0	140	0,00
	07.2023	\$	49.290		46.119		940	0	940	0,02
	08.2023	TWD	1.891.449	\$	62.367		1.486	0	1.486	0,03
	09.2023	CLP	2.037.963		2.542		23	0	23	0,00
	09.2023	KRW	61.671.203		48.191		1.085	0	1.085	0,02
	09.2023	\$	6.308	INR	520.340		14	0	14	0,00
RBC	07.2023	CAD	4.692	€	3.273		23	0	23	0,00
	07.2023	\$	202	MXN	3.878		22	0	22	0,00
	08.2023		1.156		20.029		2	0	2	0,00
RYL	07.2023	€	2.224	CAD	3.222		8	0	8	0,00
SCX	07.2023		1.040	AUD	1.715		6	0	6	0,00
	07.2023		20.479	NOK	240.775		120	0	120	0,00
	07.2023	NOK	202.909	€	17.174		0	(186)	(186)	0,00
	07.2023	\$	23.965	CLP	19.294.070		7	0	7	0,00
	08.2023	NOK	240.874	€	20.479		0	(120)	(120)	0,00
	08.2023	TWD	24.582	\$	805		14	0	14	0,00
	09.2023		2.886.012		94.661		1.644	0	1.644	0,04
	09.2023	\$	45.215	INR	3.723.883		42	0	42	0,00
SOG	07.2023		1.622.785	€	1.508.530		21.102	0	21.102	0,49
	07.2023		1.291	PLN	5.560		70	0	70	0,00
SSB	07.2023	CLP	40.670.241	\$	50.601		0	(93)	(93)	0,00
	10.2023	\$	49.984	CLP	40.670.241		92	0	92	0,00
UAG	07.2023	CHF	6.557	€	6.780		62	0	62	0,00
	07.2023	€	6.195	AUD	10.046		19	(85)	(66)	0,00
	07.2023		2.076	CAD	2.976		0	(15)	(15)	0,00
	07.2023		41.376	CHF	40.483		108	(7)	101	0,00
	07.2023		1.730	¥	259.400		0	(85)	(85)	0,00
	07.2023	£	136.140	€	156.513		0	(2.125)	(2.125)	(0,05)
	07.2023	¥	13.690.000		96.049		9.180	0	9.180	0,22
	07.2023	\$	458	TRY	10.563		0	(51)	(51)	0,00
	08.2023	CHF	37.615	€	38.487		0	(113)	(113)	0,00
	08.2023	\$	52.222	ZAR	1.002.848		589	(23)	566	0,01
	09.2023	ILS	157.989	\$	44.127		1.309	0	1.309	0,03
	09.2023	¥	13.440.000	€	90.390		4.541	0	4.541	0,11
						€	83.521	€ (27.114)	€ 56.407	1,32

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen BM Retail AUD (Hedged) Income II und M Retail AUD (Hedged) Income II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	3	€	2	€	0,00
	07.2023	€	89	AUD	146	€	0,00
JPM	07.2023	AUD	5	€	3	€	0,00
MYI	07.2023	€	37	AUD	59	€	0,00
RBC	07.2023		110		180	€	0,00
RYL	07.2023		6		10	€	0,00
SCX	07.2023		86		143	€	0,00
UAG	07.2023	AUD	12	€	7	€	0,00
				€	2	€	0,00
					(2)	€	0,00
						€	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	958	CHF	927	€	0,00
BRC	07.2023		427		415	€	0,00
MBC	07.2023	CHF	34	€	35	€	0,00
MYI	07.2023		63		65	€	0,00
	07.2023	€	576	CHF	560	€	0,00
UAG	07.2023	CHF	963	€	984	€	0,00
	07.2023	€	960	CHF	929	€	0,00
	08.2023		943		922	€	0,00
				€	3	€	0,00
					(25)	€	0,00
						€	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	70.020	€	81.280	€	(0,01)
BRC	07.2023	€	200.877	£	173.140	€	0,02
	07.2023	£	22.238	€	25.821	€	0,00
CLY	07.2023	€	5.925	£	5.095	€	0,00
	07.2023	£	9.667	€	11.283	€	0,00
DUB	07.2023	€	31	£	27	€	0,00
	07.2023	£	52	€	61	€	0,00
JPM	07.2023	€	228.554	£	196.670	€	0,02
MBC	07.2023		178.584		154.749	€	0,04
	07.2023	£	171.097	€	198.155	€	(0,03)
	08.2023	€	197.813	£	171.005	€	0,03
RBC	07.2023		5.917		5.108	€	0,00
RYL	07.2023		206		178	€	0,00
SOG	07.2023	£	975	€	1.134	€	0,00
UAG	07.2023	€	87.886	£	76.442	€	0,03
				€	1.190	€	0,10
					(1)	€	0,10
						€	0,10

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional ILS (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	€	1.388	ILS	5.600	€	0,00
	07.2023	ILS	81	€	20	€	0,00
	08.2023	€	13	ILS	52	€	0,00
CBK	07.2023		1.388		5.600	€	0,00
	07.2023	ILS	137	€	35	€	0,00
MBC	07.2023	€	1.388	ILS	5.600	€	0,00
	07.2023	ILS	315	€	79	€	0,00
	08.2023	€	14	ILS	57	€	0,00
MYI	07.2023		158		615	€	0,00
				€	3	€	0,00
					(21)	€	0,00
						€	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) Accumulation und M Retail SGD (Hedged) Income II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	€ 27.710	SGD 40.144	€ 0	€ (522)	€ (522)	(0,02)
	07.2023	SGD 904	€ 625	13	0	13	0,00
	08.2023	53	36	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	€ 27.711	SGD 40.144	0	(523)	(523)	(0,01)
	07.2023	SGD 1.467	€ 994	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	€ 27.712	SGD 40.144	0	(524)	(524)	(0,01)
	07.2023	SGD 204	€ 140	1	0	1	0,00
SOG	07.2023	140	95	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	831	571	8	0	8	0,00
				€ 23	€ (1.569)	€ (1.546)	(0,04)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional USD (Hedged) Accumulation, Institutional USD (Hedged) Income II, Investor USD (Hedged) Accumulation, BM Retail USD (Hedged) Income II, E Class USD (Hedged) Accumulation, E Class USD (Hedged) Income, E Class USD (Hedged) Income II, H Institutional USD (Hedged) Accumulation, M Retail USD (Hedged) Income II und T Class USD (Hedged) Accumulation die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	\$ 11.570	€ 10.662	€ 67	€ (11)	€ 56	0,00
BOA	07.2023	€ 109.268	\$ 117.440	0	(1.624)	(1.624)	(0,04)
	07.2023	\$ 307	€ 285	4	0	4	0,00
BPS	07.2023	€ 106.139	\$ 114.100	0	(1.556)	(1.556)	(0,04)
	07.2023	\$ 108.713	€ 99.217	0	(427)	(427)	(0,01)
	08.2023	€ 99.217	\$ 108.865	431	0	431	0,01
BRC	07.2023	\$ 564	€ 515	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2023	108.556	99.848	347	0	347	0,01
	08.2023	€ 99.848	\$ 108.708	0	(344)	(344)	(0,01)
CLY	07.2023	\$ 3.193	€ 2.978	52	0	52	0,00
DUB	07.2023	4.130	3.806	20	0	20	0,00
JPM	07.2023	€ 31.863	\$ 34.067	0	(638)	(638)	(0,01)
	07.2023	\$ 109.024	€ 99.848	0	(82)	(82)	0,00
	08.2023	€ 99.848	\$ 109.177	85	0	85	0,00
MBC	07.2023	15.277	16.387	0	(257)	(257)	(0,01)
	07.2023	\$ 16.078	€ 15.002	265	0	265	0,01
MYI	07.2023	435	395	0	(3)	(3)	0,00
RBC	07.2023	388	356	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	9.047	8.280	14	(26)	(12)	0,00
SOG	07.2023	€ 106.139	\$ 114.178	0	(1.485)	(1.485)	(0,03)
				€ 1.285	€ (6.454)	€ (5.169)	(0,12)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ 50.767 1,19

Summe Anlagen

€ 5.015.615 117,79

Sonstige Aktiva und Passiva

€ (757.404) (17,79)

Nettovermögen

€ 4.258.211 100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null EUR (31. Dezember 2022: 17.831 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.135 EUR (31. Dezember 2022: 68.086 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß Prime Brokerage-Vereinbarungen und Vereinbarungen, die börsennotierte Aktienoptionsgeschäfte regeln, als Sicherheit für Leerverkäufe und Optionen verpfändet.

Barmittel in Höhe von 163.012 EUR (31. Dezember 2022: 287.910 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 4.020 EUR (31. Dezember 2022: 38.420 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 373.327	€ 3.873.229	€ 319	€ 4.246.875
Investmentfonds	404.018	15.843	0	419.861
Pensionsgeschäfte	0	329.566	0	329.566
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.520	17.793	0	19.313
<b>Summen</b>	<b>€ 778.865</b>	<b>€ 4.236.431</b>	<b>€ 319</b>	<b>€ 5.015.615</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 1.030.499	€ 3.100.425	€ 0	€ 4.130.924
Investmentfonds	159.134	345.280	0	504.414
Pensionsgeschäfte	0	124.604	0	124.604
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	40.774	(43.246)	0	(2.472)
<b>Summen</b>	<b>€ 1.230.407</b>	<b>€ 3.527.063</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 4.757.470</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	€ 56	€ 0	€ 56	€ 50	€ 0	€ 50
BOA	(3.154)	3.090	(64)	3.446	(3.570)	(124)
BPS	5.516	(4.460)	1.056	4.322	(10.200)	(5.878)
BRC	1.693	(440)	1.253	(7.900)	5.060	(2.840)
CBK	(800)	730	(70)	10.257	(9.740)	517
CLY	83	0	83	(8)	0	(8)
DUB	(13)	0	(13)	12.986	(12.970)	16
GLM	2.336	(1.720)	616	(7.033)	6.920	(113)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(2)	0	(2)
JPM	101	200	301	7.259	(7.080)	179
MBC	7.473	(7.780)	(307)	36.023	(33.640)	2.383
MEI	k. A.	k. A.	k. A.	80	(4.040)	(3.960)
MYI	1.692	(1.468)	224	(126)	0	(126)
RBC	82	(150)	(68)	(3.115)	2.470	(645)
RYL	9	0	9	(7.748)	7.780	32
SCX	1.516	(1.580)	(64)	(15.297)	14.720	(577)
SOG	19.686	(21.650)	(1.964)	(1.445)	1.300	(145)
SSB	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	14.492	(15.120)	(628)	(341)	170	(171)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	78,89	65,24
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	20,85	15,48
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,00	0,05
Investmentfonds	9,86	9,86
Pensionsgeschäfte	7,74	2,44
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,08)	0,48
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,66)	(1,15)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,19	0,61
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,35)



Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	8,32	3,28
Wandelanleihen & Wechsel	0,34	0,26
US-Regierungsbehörden	21,79	k. A.
US-Schatzobligationen	17,21	k. A.
Non-Agency-MBS	4,02	1,78
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,73	6,77
Staatsemissionen	3,99	0,72
Stammaktien	20,79	39,19
Vorzugswertpapiere	0,00	k. A.
Bezugsrechte	k. A.	0,00
Real Estate Investment Trusts	0,48	0,26
Kurzfristige Instrumente	15,07	28,51
Investmentfonds	9,86	9,86
Pensionsgeschäfte	7,74	2,44
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,08)	0,51
Optionskauf		
Optionen auf Indizes	k. A.	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Indizes	k. A.	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen -		
Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,20	0,30
Zinsswaps	(0,86)	(1,45)
Freiverkehrsfinaanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,14
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Devisenoptionen	k. A.	(0,04)
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,05)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen -		
Schutzkauf	0,00	0,00
Total Return Swaps auf Indizes	(0,07)	0,01
Devisenterminkontrakte	1,32	1,12
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,06)	(0,57)
Sonstige Aktiva und Passiva	(17,79)	6,99
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS																				
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				3,810 % fällig am 14.09.2050 CNY				89.400 \$ 13.939 0,50																							
<b>ARGENTINIEN</b>				Summe China				149.330 5,36																							
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>KOLUMBIEN</b>				<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>																							
<b>Autonome Stadt Buenos Aires</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>																							
95,317 % fällig am 29.03.2024 (a)	ARS	88.177	\$ 176	0,01	Empresas Publicas de Medellin ESP				12,000 % fällig am 03.10.2025 DOP	310.500	\$ 5.901	0,21																			
95,645 % fällig am 22.02.2028 (a)		52.420		0,00	7,625 % fällig am 10.09.2024 COP				7.839.000	1.751	0,06	13,000 % fällig am 05.12.2025	1.128.200	22.010	0,79																
Summe Argentinien		278		0,01	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Dominican Republic Government International Bond																						
<b>ASERBAIDSCHAN</b>				<b>Colombia Government International Bond</b>				13,625 % fällig am 03.02.2033				1.214.600	27.311	0,98																	
<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				9,850 % fällig am 28.06.2027				25.455.000	5,880	0,21	13,625 % fällig am 10.02.2034				483.800	11.049	0,40														
<b>SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC</b>				Colombian TES				Summe Dominikanische Republik				74.920 2,69																			
7,230 % fällig am 17.03.2026	\$	2.900		0,10	2,250 % fällig am 18.04.2029 (f)				<b>UNGARN</b>																						
<b>BRASILIEN</b>				3,750 % fällig am 25.02.2037				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Ungarische Entwicklungsbank</b>																			
<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				4,750 % fällig am 04.04.2035 (f)				6,500 % fällig am 29.06.2028				\$ 13.200	13.091	0,47																	
<b>Banco BTG Pactual S.A.</b>				6,250 % fällig am 09.07.2036				Hungary Government International Bond				4,500 % fällig am 23.03.2028 HUF				1.272.700	3.263	0,11													
8,300 % fällig am 15.08.2024 BRL	228.000	45.861		1,65	7,000 % fällig am 26.03.2031				4,750 % fällig am 24.11.2032				2.337.900	5.807	0,21																
<b>Odebrecht Oil &amp; Gas Finance Ltd.</b>				7,000 % fällig am 30.06.2032				6,750 % fällig am 22.10.2028				11.684.600				32.808	1,18														
0,000 % fällig am 31.07.2023 (d)(g)	\$	485		0,00	7,250 % fällig am 18.10.2034				Summe Ungarn				54.969 1,97																		
<b>Oi S.A.</b>				7,250 % fällig am 26.10.2050				<b>INDONESIEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Indonesia Government International Bond</b>															
0,000 % fällig am 25.02.2035 BRL	4.559	801		0,03	7,750 % fällig am 18.09.2030				6,375 % fällig am 15.08.2028 IDR				74.197.000	5.051	0,18																
<b>Swiss Insured Brazil Power Finance SARL</b>				9,250 % fällig am 28.05.2042				6,375 % fällig am 15.04.2032				321.879.000				21.619	0,78														
9,850 % fällig am 16.07.2032	194.259	37.146		1,33	13,250 % fällig am 09.02.2033				6,500 % fällig am 15.02.2031				264.478.000				17.840	0,64													
<b>Vale S.A.</b>				Summe Kolumbien				100.487 3,61				7,000 % fällig am 15.09.2030				523.608.000				36.345	1,31										
0,000 % (g)	99.420	6.338		0,23	<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>				7,000 % fällig am 15.02.2033				157.625.000				11.094	0,40													
Summe Brasilien		90.147		3,24	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				7,125 % fällig am 15.06.2038				148.515.000				10.518	0,38													
<b>CAYMAN INSELN</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				7,125 % fällig am 15.06.2042				34.279.000				2.392	0,09														
<b>Interoceania Finance Ltd.</b>				0,000 % fällig am 30.11.2025 (d)				\$ 253	233	0,01	7,125 % fällig am 15.06.2043				104.185.000				7.367	0,26											
<b>Kaisa Group Holdings Ltd.</b>				9,750 % fällig am 28.09.2023 ^				8.000	535	0,02	7,500 % fällig am 15.06.2035				236.780.000				17.119	0,61											
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^	1.900	127		0,00	2,000 % fällig am 13.10.2033				7,500 % fällig am 15.05.2038				109.016.000				7.932	0,28													
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^	500	32		0,00	2,750 % fällig am 23.07.2029				7,500 % fällig am 15.04.2040				164.179.000				11.875	0,43													
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	1.900	127		0,00	3,500 % fällig am 30.05.2035				8,250 % fällig am 15.05.2029				83.961.000				6.172	0,22													
<b>Poinsettia Finance Ltd.</b>				6,625 % fällig am 17.06.2031				7.611	6.290	0,23	8,375 % fällig am 15.03.2034				199.861.000				15.344	0,55											
Summe Cayman Inseln		7.344		0,26	Summe Tschechische Republik				94.421 3,39				<b>Summe Indonesien</b>				170.668 6,13														
<b>CHILE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>DANEMARK</b>				<b>INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>Project Mercury</b>															
<b>Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos</b>				2,300 % fällig am 01.10.2028 CLF				6.890.000	7.414	0,27	1,500 % fällig am 01.10.2053 DKK				0				0	0,00											
4,500 % fällig am 15.10.2023		180.447		0,01	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				1,000 % fällig am 01.10.2050				0				0	0,00													
5,000 % fällig am 01.10.2028		10.105.000		0,45	1,500 % fällig am 01.10.2053				0				0				0	0,00													
6,000 % fällig am 01.04.2033		46.955.000		2,22	Realkredit Danmark A/S				1,500 % fällig am 01.10.2053				0				0				0,00										
6,000 % fällig am 01.01.2043		655.000		0,03	Summe Dänemark				0				0				0				0,00										
7,000 % fällig am 01.05.2034		530.000		0,03	Jyske Realkredit A/S				1,500 % fällig am 01.10.2053 DKK				0				0				0,00										
Summe Chile		83.681		3,01	Summe Tschechische Republik				94.421 3,39				<b>Summe Internationale Kreditbeteiligungen und -abtretung</b>				16.115 0,58														
<b>CHINA</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>IRLAND</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>Black Diamond CLO DAC</b>															
<b>Flourish Century</b>				6,600 % fällig am 04.02.2022 ^ (j)				\$ 2.800	310	0,01	4,060 % fällig am 20.01.2032				\$ 753	810	0,03														
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				China Government International Bond				2,600 % fällig am 01.09.2032 CNY				201.010				27.420				0,98											
2,620 % fällig am 25.09.2029				308.300				42.462				1,52				3,020 % fällig am 27.05.2031				162.700				22.995				0,83			
3,030 % fällig am 11.03.2026				62.810				8.836				0,32				3,120 % fällig am 25.10.2052				48.980				6.839				0,25			
3,270 % fällig am 19.11.2030				23.300				3.367				0,12				3,270 % fällig am 19.11.2030				23.300				3.367				0,12			
3,280 % fällig am 03.12.2027				164.010				23.472				0,84				3,280 % fällig am 03.12.2027				164.010				23.472				0,84			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>						
Carlyle Euro CLO DAC				4,417 % fällig am 30.09.2041	MYR	33.593	7,440	0,27	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
3,877 % fällig am 15.01.2031	€	4.580	4,891	0,18					Poland Government International Bond					
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				Summe Malaysia		281.690	10,11		1,250 % fällig am 25.10.2030	PLN	30.486	5,595	0,20	
4,073 % fällig am 15.11.2031		1.900	2,034						1,750 % fällig am 25.04.2032		26.500	4,767	0,17	
Dryden Euro CLO DAC				<b>MEXIKO</b>					2,500 % fällig am 25.07.2027		19.800	4,327	0,16	
4,183 % fällig am 15.05.2034		7.400	7,900	0,28	<b>AMTIEN</b>				2,750 % fällig am 25.04.2028 (k)		243.700	52,970	1,90	
Summe Irland		16.169	0,58	<b>STAMMAKTIE</b>					2,750 % fällig am 25.10.2029		107.700	22,643	0,81	
<b>ISRAEL</b>				Hipotecaria Su Casita S.A. (c)		212.074	0	0,00	3,750 % fällig am 25.05.2027		72.600	16,704	0,60	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>									6,000 % fällig am 25.10.2033		54.000	13,528	0,49	
Bank Leumi Le-Israel B.M.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					7,500 % fällig am 25.07.2028 (k)		86.700	23,058	0,83	
7,129 % fällig am 18.07.2033	\$	2.100	2,081	America Movil S.A.B. de C.V.		1.800	93	0,00	Summe Polen		143.592	5,16		
(i)			0,07	8,460 % fällig am 18.12.2036	MXN				<b>KATAR</b>					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Corp. GEO S.A.B. de C.V.					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
Israel Government International Bond				8,875 % fällig am 25.09.2014 ^		250	0	0,00	QNB Finance Ltd.					
1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	76.200	20,275	9,250 % fällig am 30.06.2020 ^		700	0	0,00	6,900 % fällig am 23.01.2025	IDR	276.200.000	18,447	0,66	
Summe Israel		22.356	0,80	Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.					<b>RUMÄNIEN</b>					
<b>ELFENBEINKÜSTE</b>				9,620 % fällig am 28.06.2018 ^	MXN	22.130	0	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.					Romania Government International Bond					
Elfenbeinküste				8,790 % fällig am 09.12.2014 ^		29.700	0	0,00	3,650 % fällig am 28.07.2025	RON	42.200	8,816	0,32	
7,985 % fällig am 19.03.2027	€	6.320	6,723	0,24					4,150 % fällig am 26.01.2028		77.600	15,449	0,55	
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					4,250 % fällig am 28.04.2036		103.700	17,796	0,64	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Mexico Government International Bond					4,750 % fällig am 11.10.2034		62.000	11,509	0,41	
Corsair International Ltd.				5,500 % fällig am 04.03.2027		1.644.100	85,106	3,06	4,850 % fällig am 25.07.2029		6.600	1,322	0,05	
7,772 % fällig am 28.01.2027		4.400	4,776	5,750 % fällig am 05.03.2026		253.900	13,496	0,48	5,000 % fällig am 12.02.2029		12.600	2,557	0,09	
8,122 % fällig am 28.01.2029		2.800	3,032	7,000 % fällig am 03.09.2026		172.700	9,408	0,34	Summe Rumänien		57.449	2,06		
Summe Jersey, Kanalinseln		7.808	0,28	7,500 % fällig am 03.06.2027		697.100	38,596	1,39	<b>RUSLAND</b>					
<b>AMTIEN</b>				7,500 % fällig am 26.05.2033		241.300	12,983	0,47	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
<b>LUXEMBURG</b>				7,750 % fällig am 29.05.2031		385.002	21,267	0,76	Russia Government International Bond					
<b>STAMMAKTIE</b>				7,750 % fällig am 13.11.2042		322.900	16,911	0,61	1,125 % fällig am 20.11.2027 ^	€	100	51	0,00	
DrillCo Holding Lux S.A. (c)		3.120	60	0,00	8,000 % fällig am 07.11.2047	278.900	14,893	0,53	5,100 % fällig am 28.03.2035 ^	\$	1.200	534	0,02	
DrillCo Holding Lux S.A. (c)(j)		7.882	151	0,01	8,000 % fällig am 31.07.2053	138.700	7,353	0,26	7,700 % fällig am 23.03.2033 ^	RUB	1.088.800	4,380	0,16	
Summe Stammaktien		211	0,01	8,500 % fällig am 31.05.2029		608.600	35,120	1,26	Summe Russland		4.965	0,18		
				8,500 % fällig am 18.11.2038		522.200	29,720	1,07						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Mexiko		284.853	10,23		<b>SERBIEN</b>					
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)						284.946	10,23		<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
3,000 % fällig am 31.12.2026 (b)	\$	341	202	0,01	<b>NIEDERLANDE</b>				Serbia Government International Bond					
FORESEA Holding S.A.					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,500 % fällig am 20.08.2032	RSD	371.800	3,070	0,11	
7,500 % fällig am 15.06.2030		137	121	0,00	Angola Via Avenir BV				<b>SÜDAFRIKA</b>					
					10,163 % fällig am 07.12.2023	\$	1.580	1,572	0,06	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Summe Luxemburg		534	0,02	12,772 % fällig am 03.07.2023		345	345	0,01	Entwicklungsbank für das südliche Afrika					
				Summe Niederlande		1.917	0,07		8,600 % fällig am 21.10.2024 (j)	ZAR	221.300	11,513	0,41	
<b>MALAYSIA</b>				<b>NIGERIA</b>					Eskom Holdings SOC Ltd.					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					0,000 % fällig am 18.08.2027 (d)		100.100	2,683	0,10	
Malaysia Government International Bond				BOI Finance BV					0,000 % fällig am 31.12.2032 (d)		254.000	2,858	0,10	
2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	74.660	14,724	7,500 % fällig am 16.02.2027	€	3.600	3,392	0,12	Summe Südafrika		17.054	0,61		
3,582 % fällig am 15.07.2032		85.804	18,056	0,65	<b>PERU</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
3,733 % fällig am 15.06.2028		30.750	6,628	0,24	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				South Africa Government International Bond					
3,757 % fällig am 22.05.2040		19.662	4,031	0,14	Peru Government International Bond				2,000 % fällig am 31.01.2025 (f)		69.734	3,583	0,13	
3,800 % fällig am 17.08.2023		176.400	37,824	1,36	5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN	2.300	533	0,02					
3,885 % fällig am 15.08.2029		26.300	5,678	0,20	5,400 % fällig am 12.08.2034		52.900	12,942	0,46					
3,899 % fällig am 16.11.2027		25.050	5,437	0,19	5,940 % fällig am 12.02.2029		93.600	25,375	0,91					
4,065 % fällig am 15.06.2050		40.939	8,566	0,31	6,150 % fällig am 12.08.2032		20.606	5,449	0,20					
4,254 % fällig am 31.05.2035		35.492	7,774	0,28	6,900 % fällig am 12.08.2037		6.000	1,643	0,06					
4,504 % fällig am 30.04.2029		6.420	1,434	0,05	7,300 % fällig am 12.08.2033		194.300	55,348	1,99					
4,696 % fällig am 15.10.2042		100	23	0,00	Summe Peru		101.290	3,64						
4,762 % fällig am 07.04.2037		79.180	18,265	0,66	<b>PHILIPPINEN</b>									
Malaysia Government Investment Issue					<b>STAATSEMISSIONEN</b>									
3,422 % fällig am 30.09.2027		58.100	12,367	0,44	Philippines Government International Bond									
3,447 % fällig am 15.07.2036		24.190	4,884	0,18	6,250 % fällig am 14.01.2036	PHP	52.000	939	0,03					
3,465 % fällig am 15.10.2030		105.520	22,119	0,79	6,750 % fällig am 15.09.2032		105.040	1,955	0,07					
3,990 % fällig am 15.10.2025		85.989	18,643	0,67	Summe Philippinen		2.894	0,10						
4,130 % fällig am 09.07.2029		55.160	12,076	0,43	<b>POLEN</b>									
4,193 % fällig am 07.10.2032		108.555	23,855	0,86										
4,258 % fällig am 26.07.2027		14.130	3,107	0,11										
4,369 % fällig am 31.10.2028		220.103	48,759	1,75										

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
6,250 % fällig am 31.03.2036	ZAR 114.500	\$ 3.871	0,14	4,875 % fällig am 22.06.2029	THB 438.082	\$ 14.047	0,51	NovaStar Mortgage Funding Trust			
6,500 % fällig am 28.02.2041	184.751	5.794	0,21	Summe Thailand		176.539	6,34	5,490 % fällig am 25.01.2037	\$ 1.742	\$ 610	0,02
7,000 % fällig am 28.02.2031	665.346	28.203	1,01					Option One Mortgage Loan Trust	481	341	0,01
8,000 % fällig am 31.01.2030	511.827	23.948	0,86	<b>TÜRKEI</b>				5,370 % fällig am 25.04.2037	87	83	0,00
8,250 % fällig am 31.03.2032	567.780	25.288	0,91	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
8,500 % fällig am 31.01.2037	697.900	28.264	1,02	<b>SOCAR Turkey Enerji A/S</b>				5,885 % fällig am 25.08.2035			
8,750 % fällig am 31.01.2044	432.400	16.795	0,60	6,553 % fällig am 11.08.2026	€ 9.900	10.477	0,38	Residential Asset Securities Corp. Trust	2.095	2.040	0,07
8,875 % fällig am 28.02.2035	213.800	9.276	0,33	<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				6,800 % fällig am 25.07.2035	5.124	3.295	0,12
9,000 % fällig am 31.01.2040	489.800	19.941	0,72	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust	5.124	3.295	0,12
10,500 % fällig am 21.12.2026	1.961.732	107.847	3,88	<b>ADCB Finance Cayman Ltd.</b>				5,370 % fällig am 25.10.2037	1.300	1.234	0,04
(k)				7,500 % fällig am 15.10.2029	IDR 29.000.000	1.995	0,07	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
10,500 % fällig am 21.12.2026	590.000	32.435	1,16	8,160 % fällig am 29.04.2029	323.000.000	22.712	0,82	5,470 % fällig am 25.07.2036			
Summe Südafrika		305.245	11,58			24.707	0,89			16.904	0,61
<b>SÜDKOREA</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>AKTIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>NMC OpCo Ltd.</b>				<b>STAMMAKTIE</b>			
Export-Import Bank of Korea				11,255 % fällig am 25.03.2027	AED 28.858	7.935	0,28	<b>ENERGIE</b>			
7,250 % fällig am 07.12.2024	IDR 51.400.000	3.465	0,12	Summe Vereinigte Arabische Emirate		32.642	1,17	Constellation Oil Services	376.971	41	0,00
8,000 % fällig am 15.05.2024	2.800.000	189	0,01					Holding S.A. 'B' (c)(j)			
Korea National Oil Corp.				<b>GROSSBRITANNIEN</b>							
4,750 % fällig am 03.04.2026	6.300	6.182	0,22	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Summe Südkorea		9.836	0,35	<b>Petra Diamonds U.S. Treasury PLC (6,066 % bar und 3,967 % PIK)</b>							
<b>SUPRANATIONAL</b>				10,033 % fällig am 08.03.2026	£ 843	789	0,03	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				(b)				<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>			
Asian Development Bank				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				4,535 % fällig am 06.03.2025	£ 400	484	0,02
4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN 68.600	3.783	0,13	Canada Square Funding PLC				Rio Oil Finance Trust			
International Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				5,316 % fällig am 17.01.2059	£ 1.741	2.201	0,08	8,200 % fällig am 06.04.2028	\$ 2.904	2.923	0,10
6,250 % fällig am 12.01.2028	ID 320.000.000	21.646	0,78	Polaris PLC				9,250 % fällig am 06.07.2024	836	844	0,03
International Finance Corp.				6,154 % fällig am 27.05.2057	322	409	0,01	9,750 % fällig am 06.01.2027	542	559	0,02
8,000 % fällig am 09.10.2023	6.900.000	462	0,02	Rochester Financing PLC							
Summe Supranational		25.891	0,93	5,602 % fällig am 18.12.2044	1.705	2.142	0,07				
<b>TANSANIA</b>				Stratton Mortgage Funding PLC							
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				5,765 % fällig am 12.03.2052	377	478	0,02	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania				Tower Bridge Funding PLC				<b>Ecopetrol S.A.</b>			
9,048 % fällig am 26.04.2028	€ 8.182	8.804	0,32	5,629 % fällig am 20.12.2063	1.302	1.648	0,06	TBD % fällig am 17.08.2024	10.700	10.535	0,38
<b>THAILAND</b>				Warwick Finance Residential Mortgages PLC							
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				0,000 % fällig am 21.12.2049	0	522	0,02				
Thailand Government International Bond				(d)				<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
2,000 % fällig am 17.06.2042	THB 72.330	1.754	0,06	Summe Großbritannien		8.189	0,29	<b>Banc of America Mortgage Trust</b>			
2,350 % fällig am 17.06.2026	1.871.124	53.034	1,90	<b>USA</b>				3,896 % fällig am 25.02.2036 ^	1	1	0,00
2,650 % fällig am 17.06.2028	2.263.201	64.825	2,33	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>BCAP LLC Trust</b>			
2,875 % fällig am 17.06.2046	73.500	1.970	0,07	Citigroup Mortgage Loan Trust				3,676 % fällig am 26.05.2037	3.337	3.009	0,11
3,350 % fällig am 17.06.2033	68.650	2.067	0,07	5,450 % fällig am 25.10.2036	£ 432	278	0,01	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
3,390 % fällig am 17.06.2037	134.400	4.042	0,15	5,470 % fällig am 25.12.2036	1.267	712	0,03	3,887 % fällig am 25.05.2047 ^	11	10	0,00
3,400 % fällig am 17.06.2036	477.854	14.374	0,52	GSAMP Trust				4,033 % fällig am 25.01.2035	1	1	0,00
3,450 % fällig am 17.06.2043	569.545	17.049	0,61	5,200 % fällig am 25.12.2046	448	226	0,01	4,042 % fällig am 25.03.2035	6	6	0,00
3,775 % fällig am 25.06.2032	108.429	3.377	0,12	5,240 % fällig am 25.01.2037	878	514	0,02	Bear Stearns ALT-A Trust			
				Lehman XS Trust				3,744 % fällig am 25.04.2037	6.405	4.786	0,17
				5,058 % fällig am 25.01.2036 ^	1.558	1.447	0,05	4,117 % fällig am 25.10.2035 ^	258	219	0,01
				MASTR Asset-Backed Securities Trust				Citigroup Mortgage Loan Trust			
				6,300 % fällig am 25.08.2037	646	536	0,02	3,974 % fällig am 25.09.2037 ^	2.722	2.390	0,09
				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				4,321 % fällig am 25.03.2034	1	1	0,00
				5,380 % fällig am 25.11.2036	7.057	3.892	0,14	<b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>			
				5,450 % fällig am 25.06.2036	169	143	0,01	5,510 % fällig am 25.04.2046	100	89	0,00
				6,305 % fällig am 25.01.2035	1.732	1.553	0,06	5,797 % fällig am 20.12.2035	422	394	0,01
								6,000 % fällig am 25.06.2036	4.021	2.252	0,08
								<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>			
								3,884 % fällig am 25.11.2037	318	291	0,01
								5,950 % fällig am 25.03.2035	37	32	0,00
								<b>FWD Securitization Trust</b>			
								2,240 % fällig am 25.01.2050	562	511	0,02
								<b>GSMPS Mortgage Loan Trust</b>			
								5,500 % fällig am 25.01.2036	131	107	0,00
								<b>GSR Mortgage Loan Trust</b>			
								3,935 % fällig am 25.01.2036 ^	4	4	0,00
								<b>Impac CMB Trust</b>			
								5,790 % fällig am 25.03.2035	80	73	0,00
								<b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>			
								3,062 % fällig am 25.11.2037	204	167	0,01
								5,490 % fällig am 25.11.2036	5.293	5.138	0,18
								5,510 % fällig am 25.02.2037	382	369	0,01
								<b>JPMorgan Resecuritization Trust</b>			
								2,500 % fällig am 25.03.2056	160	151	0,01
								<b>Lehman XS Trust</b>			
								5,530 % fällig am 25.09.2046	1.470	1.258	0,05
								<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>			
								6,115 % fällig am 25.06.2036	1	1	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Residential Accredit Loans, Inc. Trust 5,500 % fällig am 25.03.2037 ^	\$ 296	\$ 227	0,01	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>HUNGARY TREASURY BILLS</b>			
Sequoia Mortgage Trust 3,604 % fällig am 20.01.2038 ^	234	181	0,01	<b>COMMERCIAL PAPER</b>				16,220 % fällig am 06.07.2023 (d)(e)	HUF20.973.000	\$ 61.221	2,20
Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,300 % fällig am 25.02.2037	601	542	0,02	Amcor PLC 5,450 % fällig am 07.07.2023	\$ 250	\$ 250	0,01	Summe kurzfristige Instrumente		78.844	2,83
WalMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,772 % fällig am 25.02.2037 ^	23	20	0,00	Dominion Resources, Inc. 5,430 % fällig am 31.07.2023	250	249	0,01	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 2.549.023	91,52
5,520 % fällig am 25.05.2034	11	104	0,00	Duke Energy Corp. 5,400 % fällig am 10.07.2023	500	499	0,02				
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 4,478 % fällig am 25.10.2036	263	244	0,01	Electricite de France S.A. 5,510 % fällig am 03.08.2023	1.975	1.965	0,07				
		22.578	0,81	5,480 % fällig am 17.07.2023	1.925	1.914	0,07	<b>AKTIEN</b>			
				Enbridge, Inc. 5,440 % fällig am 20.07.2023	4.900	4	0,17	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
				5,450 % fällig am 25.07.2023	500	498	0,02	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
				5,480 % fällig am 17.07.2023	1.100	1.097	0,04	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (h)	250.000	\$ 2.235	0,08
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				Enel Finance America LLC 5,450 % fällig am 24.07.2023	2.800	2.790	0,10	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Emerging Local Bond ESG Fund (h)	122.324	1.450	0,05
Fannie Mae 3,996 % fällig am 01.07.2035	8	8	0,00	J.M. Smucker Co. 5,450 % fällig am 12.07.2023	250	250	0,01	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (h)	2.453.310	26.103	0,94
Summe USA		54.876	1,97	Mondelez International, Inc. 5,370 % fällig am 25.07.2023	1.300	1.295	0,04	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	23.593.014	234.938	8,43
				5,400 % fällig am 19.07.2023	500	499	0,02	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h)	384.409	5.010	0,18
<b>URUGUAY</b>				5,430 % fällig am 13.07.2023	300	299	0,01				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				National Grid Holdings Ltd. 5,450 % fällig am 13.07.2023	500	499	0,02				
Uruguay Government International Bond 3,700 % fällig am 26.06.2037 (f)	UYU 140.338	3.893	0,14			16.989	0,61				
3,875 % fällig am 02.07.2040 (f)(k)	260.887	7.359	0,26	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>							
Summe Uruguay		11.252	0,40	(28,578) % fällig am 18.10.2023 (d)(e)	ARS 154.015	305	0,01				
				(12,549) % fällig am 23.11.2023 (d)(e)	163.227	329	0,01	Summe Investmentfonds		\$ 269.736	9,68
<b>SAMBIA</b>						634	0,02				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>											
Zambia Government International Bond 13,000 % fällig am 25.01.2031	ZMW 145.000	4.876	0,18								

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	91	\$ 150	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	36	(50)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	62	120	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	3	4	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	3	(5)	0,00
				\$ 219	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 219	0,01

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Barclays Bank PLC	1,000 %	20.12.2023	€ 1.200	\$ 0	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	\$ 1.100	(12)	0,00
				\$ (12)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	Fixer Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250 %	16.03.2032	INR 1.538.910	\$ 319	0,01
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,750	15.03.2028	1.480.963	267	0,01
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	15.03.2028	SGD 4.900	(48)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	\$ 26.400	1.000	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,870	02.01.2024	BRL 242.300	(4.718)	(0,17)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,660	02.01.2025	183.200	(3.524)	(0,13)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,680 %	02.01.2024	BRL	19.200 \$ (324)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,140	04.01.2027		528.200 (9.141)	(0,33)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,710	02.01.2025		13.900 (209)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,950	04.01.2027		800 (11)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		7,480	02.01.2025		119.400 (1.560)	(0,06)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		8,075	02.01.2024		120.000 1.951	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI		8,675	04.01.2027		19.900 172	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,565	04.01.2027		259.100 570	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,140	04.01.2027		157.000 1.393	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,244	02.01.2026		198.600 (789)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,405	02.01.2029		13.600 61	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,420	02.01.2026		226.000 1.024	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,810	02.01.2025		75.920 148	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,845	02.01.2025		186.600 134	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,005	02.01.2025		177.400 124	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,090	04.01.2027		127.500 1.147	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,091	04.01.2027		103.330 930	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,350	01.07.2024		288.000 (149)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,425	02.01.2025		172.800 369	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,490	01.07.2024		312.400 (247)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,533	02.01.2029		96.500 (1.260)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,595	01.07.2024		276.600 304	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,684	02.01.2029		104.300 1.449	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,740	02.01.2025		42.600 (173)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,746	02.01.2029		114.100 1.626	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,850	02.01.2025		67.400 (286)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		13,080	01.07.2024		542.300 1.070	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,218	02.01.2029		212.500 (3.592)	(0,13)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,250	21.12.2027	CNY	151.070 377	0,01
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,500	16.03.2027		197.410 398	0,02
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,625	16.12.2025		30.320 41	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,750	15.03.2028		108.240 171	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		3,125	15.01.2026	COP	3.301.000 50	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,005	20.08.2028		53.353.700 (771)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,075	26.11.2025		13.240.170 255	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,115	01.02.2031		14.558.000 144	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,120	01.02.2031		10.388.000 103	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,155	15.01.2031		5.060.000 56	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		5,175	28.05.2027		32.437.000 (722)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		5,675	18.06.2031		20.000.000 431	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		6,130	26.10.2026		10.907.100 174	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		6,630	07.10.2031		12.820.000 (173)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		6,640	11.01.2027		31.028.800 395	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		6,660	07.10.2031		6.347.000 (83)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		6,670	11.01.2027		47.000.000 587	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		6,690	07.10.2031		6.347.000 (80)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,040	25.01.2027		30.993.600 283	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,080	02.02.2027		9.610.900 82	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,130	31.01.2027		14.472.000 120	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,140	01.02.2027		29.583.000 239	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,380	21.01.2029		9.688.000 33	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,585	14.02.2027		35.037.000 (146)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,860	26.08.2026		12.602.700 40	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,890	08.04.2027		21.093.600 53	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,913	08.04.2027		32.467.300 75	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,940	08.04.2027		16.342.600 34	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,190	13.06.2029		43.754.800 340	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,200	11.03.2027		45.342.000 70	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,240	15.03.2027		15.813.700 31	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,305	28.04.2028		30.230.500 183	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,320	31.03.2027		10.203.000 32	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,360	02.06.2027		58.618.000 192	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,390	13.06.2028		15.910.800 115	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,495	27.04.2030		42.159.000 493	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,560	30.03.2027		4.356.600 21	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,610	26.11.2025		15.715.400 23	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,686	30.03.2027		25.932.000 152	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,820	05.06.2028		41.957.200 (465)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,940	24.03.2030		57.343.000 (1.062)	(0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,040	05.05.2030		15.100.700 285	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,130	23.03.2030		59.209.100 (1.230)	(0,04)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,177	26.11.2025		18.899.000 (29)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,300	26.03.2031		36.903.760 (951)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,370	17.03.2030		15.942.100 (376)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,393	21.03.2030		37.252.900 (890)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,423	17.03.2030		47.175.600 (1.142)	(0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,490	30.06.2032		9.544.300 305	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,790	20.01.2028		45.916.600 807	0,03
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,800	17.01.2028		54.120.000 949	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,820	27.02.2033		9.049.540 (341)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		10,110	26.11.2025		9.311.000 (60)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		10,130	25.01.2028		42.970.500 898	0,03



Zahlung/ Erhalt/ variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,400 %	21.11.2029	COP	4.122.900	\$ (141)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,500	21.03.2025		194.830.310	615	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,990	21.11.2025		16.209.500	(178)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,030	21.11.2025		15.885.200	(178)	(0,01)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,210	17.06.2025	ILS	7.100	60	0,00
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,590	18.05.2028		30.500	(19)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,665	15.03.2028	KRW	15.946.900	(104)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033		82.062.061	(719)	(0,03)
Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB	3.347.720	22	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,635	04.02.2027	ZAR	53.800	28	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,120	26.05.2030		88.500	(411)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,205	22.04.2027		178.200	412	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,210	22.04.2027		137.000	315	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	19.09.2023		142.300	(608)	(0,02)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,460	06.03.2030		107.650	(40)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,565	22.03.2026		300.200	340	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,030	04.01.2028		152.000	(174)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,120	13.03.2028		4.890	(5)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,276	28.02.2028		263.600	(199)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,830	23.02.2030		78.400	(44)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,290	26.05.2028		335.100	327	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,350	18.05.2028		139.300	210	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	10,150	18.05.2033		121.800	253	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,080	01.06.2030	CLP	3.688.000	(207)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,110	01.06.2030		1.385.000	(76)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,000	07.01.2030		4.970.000	(705)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,060	08.01.2030		4.500.000	(648)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,120	05.02.2030		1.679.000	(222)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,215	14.01.2030		9.767.400	1.443	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,420	01.09.2030		1.005.150	124	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,725	19.07.2028		2.502.900	316	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,731	20.07.2028		13.716.000	1.727	0,06
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,920	06.08.2028		9.384.500	1.032	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,990	06.07.2028		5.482.000	623	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,000	06.07.2028		2.901.000	322	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,410	01.09.2030		2.839.400	219	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,870	01.10.2028		3.460.000	(137)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,015	13.09.2028		1.869.500	(67)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	13.09.2028		6.500.000	(226)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	20.03.2033		14.730.340	370	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,180	01.10.2028		1.905.000	36	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	5,220	01.10.2028		4.896.800	(7)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030		3.103.000	35	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,250	01.10.2028		7.411.400	124	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,300	18.05.2033		5.292.000	(76)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,360	18.05.2033		2.594.000	(53)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,370	01.10.2028		1.735.700	13	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	01.10.2028		949.000	4	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,420	01.10.2028		2.094.000	10	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,460	01.10.2028		952.100	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,550	05.06.2028		13.690.000	(149)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,570	01.10.2028		1.925.000	(8)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,620	01.10.2028		8.700.000	49	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,680	01.10.2028		2.490.200	(27)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,820	01.09.2030		1.514.470	(55)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,890	17.03.2032		1.533.000	(88)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,930	17.03.2032		1.533.100	(88)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,000	01.10.2028		5.006.600	143	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,010	16.02.2029		2.164.000	61	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,020	02.03.2029		1.250.400	41	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,100	01.04.2032		1.225.000	(94)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,115	01.04.2032		1.273.000	(102)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,250	01.10.2028		1.580.100	74	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,370	29.06.2029		4.532.000	356	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,420	24.03.2029		1.107.000	70	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,470	01.10.2028		3.085.000	(180)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,500	01.10.2028		2.650.000	(160)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,550	15.06.2032		2.352.600	314	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,580	01.10.2028		3.089.700	(201)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,590	16.06.2032		6.916.000	951	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,610	17.06.2032		2.813.000	394	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,640	01.10.2028		1.614.000	(113)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,650	01.10.2028		3.129.000	(217)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,090	22.07.2029		7.495.700	(776)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	01.10.2028		2.439.300	244	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,195	01.10.2028		1.355.100	141	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK	3.476.300	(515)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	€	2.700	(15)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025		25.200	191	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	19.06.2024	HUF	5.281.500	(1.430)	(0,05)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,760	21.01.2030		1.296.900	(115)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	2,420	02.08.2026		3.964.700	(2.421)	(0,09)



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Varibler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	6-Month HUF-BBR	2,680 %	29.06.2031	HUF	1.938.800	\$ (1.104)	(0,04)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	4,790	17.01.2027		7.857.000	(3.353)	(0,12)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	8,500	17.01.2028		711.800	26	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,670	23.05.2029		1.828.200	267	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR	8,700	16.01.2028		1.002.200	14	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	8,740	28.04.2028		1.920.800	(124)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,230	26.08.2032		1.440.400	683	0,03
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,925	16.10.2030	PLN	1.500	(57)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,163	03.12.2030		3.800	(145)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,460	28.05.2026		44.900	(1.177)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,490	29.08.2029		57.400	2.224	0,08
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,585	14.10.2029		15.200	371	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,920	13.12.2031		3.800	119	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027		37.000	408	0,02
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,220	20.03.2033		14.100	(33)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,310	21.03.2033		40.800	(166)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,520	20.03.2026		107.500	(33)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,620	21.03.2026		115.400	47	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,870	22.04.2027		1.000	(6)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,960	25.04.2027		67.900	(435)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,456	25.05.2027		40.800	(456)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,480	25.05.2027		45.100	(513)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,560	25.05.2027		15.800	(191)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024		52.600	(502)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,890	22.08.2024		119.500	(1.171)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,310	30.06.2027		15.300	(292)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,540	31.05.2040	MXN	240.300	644	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,035	31.05.2029		83.200	52	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,207	19.06.2028		713.900	(233)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,300	16.06.2028		361.200	(45)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	9,335	02.08.2023		1.952.800	387	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIE	9,500	03.07.2023		3.190.100	(300)	(0,01)
						\$ (16.541)	(0,59)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ (16.553)</b>	<b>(0,59)</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null laufende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC EUR versus CZK	CZK 23,830	01.11.2023	2.091	\$ 228	\$ 928	0,03
	Call - OTC USD versus INR	INR 92,600	16.06.2025	2.200	132	19	0,00
	Put - OTC USD versus INR	92,600	16.06.2025	2.200	132	194	0,01
GLM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF 385,000	01.11.2023	788	105	476	0,02
	Put - OTC EUR versus PLN	4,560	01.11.2023	1.575	188	1.238	0,05
JPM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF 385,000	01.11.2023	1.581	151	954	0,03
	Put - OTC EUR versus PLN	4,560	01.11.2023	535	89	421	0,02
MYI	Put - OTC EUR versus CZK	CZK 23,830	01.11.2023	687	410	305	0,01
	Put - OTC EUR versus HUF	HUF 385,000	01.11.2023	606	225	366	0,01
	Put - OTC USD versus BRL	4,820	22.08.2023	26.361	281	394	0,01
	Put - OTC USD versus MXN	18,500	25.07.2023	25.738	647	1.907	0,07
RBC	Put - OTC USD versus CAD	1,305	13.07.2023	25.584	114	16	0,00
UAG	Call - OTC EUR versus USD	\$ 1,140	13.07.2023	23.246	146	0	0,00
	Call - OTC USD versus ZAR	ZAR 20,500	09.10.2023	40.134	559	407	0,02
					\$ 3.407	\$ 7.625	0,28

##### STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs <sup>(2)</sup>	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten <sup>(2)</sup>	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600 %	27.12.2023	17.100	\$ 0	\$ 4	0,00
	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,050	27.12.2023	17.100	0	18	0,00
CBK	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,100	20.12.2023	51.900	0	9	0,00
	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	29.12.2023	15.800	0	1	0,00
MYI	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	27.12.2023	23.800	0	5	0,00
					\$ 0	\$ 37	0,00

## VERKAUFSOPTIONEN

## DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Call - OTC USD versus INR	IDR 14.950,000	06.06.2024	7.776	\$ (263)	\$ (276)	(0,01)
	Put - OTC USD versus INR	14.950,000	06.06.2024	7.776	(238)	(197)	(0,01)
MYI	Call - OTC USD versus CLP	CLP 850,000	18.07.2023	14.860	(211)	(20)	0,00
	Put - OTC USD versus MXN	MXN 17,750	25.07.2023	51.476	(329)	(1.677)	(0,05)
	Call - OTC USD versus MXN	21,000	07.03.2024	22.599	(504)	(159)	(0,01)
					\$ (1.545)	\$ (2.329)	(0,08)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	4.800	\$ (19)	\$ (23)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	4.800	(19)	(14)	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	3.000	(10)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	3.000	(10)	(15)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.700	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.700	(6)	(10)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	2.600	(9)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	2.600	(8)	(13)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	1.800	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	1.800	(4)	(6)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	4.200	(14)	(8)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	4.200	(14)	(17)	0,00
							\$ (123)	\$ (125)	(0,01)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	(1,000) %	20.06.2024	\$ 8.200	\$ 486	\$ (325)	\$ 161	0,01
BPS	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	3.000	162	(103)	59	0,00
BRC	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	3.200	136	(73)	63	0,00
CBK	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	3.800	158	(83)	75	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.700	165	(60)	105	0,01
GST	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	29.700	1.409	(826)	583	0,02
					\$ 2.516	\$ (1.470)	\$ 1.046	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Poland Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	\$ 500	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.800	(3)	6	3	0,00
CBK	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2024	12.000	(371)	149	(222)	(0,01)
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30.06.2029	11.200	0	348	348	0,01
GST	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.200	4	1	5	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.400	15	10	25	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	6.500	(146)	93	(53)	0,00
					\$ (499)	\$ 607	\$ 108	0,00

(1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximale mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,330 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	28.05.2024	USD 1.900	ARS 85.633	\$ 0	\$ 1.816	\$ 1.816	0,06
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,333 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	30.05.2024	4.820	214.249	(15)	4.627	4.612	0,17
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	2.090	93.789	(3)	2.037	2.034	0,07
						\$ (18)	\$ 8.480	\$ 8.462	0,30

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,680 %	08.09.2030	ILS 44.500	\$ 0	\$ (2.181)	\$ (2.181)	(0,08)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,800	24.04.2028	120.000	0	4.315	4.315	0,15
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,963	16.02.2028	21.300	0	(412)	(412)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	13.700	0	(282)	(282)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	MYR 161.119	196	43	239	0,01
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	33.100	10	(59)	(49)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	30.420	(91)	64	(27)	0,00
BRC	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,795	20.06.2028	ILS 32.000	0	1.123	1.123	0,04
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	34.500	0	(730)	(730)	(0,03)
BSH	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,300	21.06.2029	CLP 3.450.000	0	416	416	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,750	22.03.2026	8.000.000	0	(772)	(772)	(0,03)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,790	14.03.2026	3.885.000	7	(384)	(377)	(0,01)
CBK	Erhalt	Compounded-OIS	5,960	10.05.2029	COP 27.236.900	0	501	501	0,02
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,485	09.08.2024	ILS 68.500	0	886	886	0,03
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,950	23.05.2024	122.500	0	1.258	1.258	0,05
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,041	15.05.2024	101.800	0	(1.013)	(1.013)	(0,04)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,763	24.05.2029	CLP 1.841.700	10	(192)	(182)	(0,01)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,770	19.03.2026	64.800	0	(6)	(6)	0,00
CKL	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	ILS 14.000	(46)	(225)	(271)	(0,01)
DUB	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,690	27.09.2027	20.100	0	611	611	0,02
GLM	Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,708	02.01.2025	BRL 18.800	0	(4)	(4)	0,00
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,520	12.08.2024	ILS 93.500	0	1.192	1.192	0,04
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,540	11.05.2027	11.600	0	(376)	(376)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,720	20.06.2028	8.800	0	317	317	0,01
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,820	15.01.2030	43.800	0	1.976	1.976	0,07
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,950	23.05.2024	75.700	0	777	777	0,03
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,960	24.05.2024	70.700	0	724	724	0,03
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,048	27.02.2024	132.400	0	(925)	(925)	(0,03)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,883	21.03.2028	28.100	0	(558)	(558)	(0,02)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,898	17.12.2025	57.400	0	(673)	(673)	(0,02)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	43.600	0	(838)	(838)	(0,03)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	28.300	0	(583)	(583)	(0,02)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	MYR 118.027	0	139	139	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,990	01.08.2029	CLP 2.813.100	0	(514)	(514)	(0,02)
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,015	20.06.2026	5.555.000	0	554	554	0,02
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,265	14.06.2029	4.122.200	0	(518)	(518)	(0,02)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,830	22.05.2029	7.729.900	0	(735)	(735)	(0,03)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,095	01.06.2027	12.230.000	0	(847)	(847)	(0,03)
	Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	4,319	22.05.2029	19.808.000	0	(98)	(98)	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	MYR 89.615	88	45	133	0,00
HUS	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,018	11.03.2024	ILS 82.600	0	(581)	(581)	(0,02)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,018	15.05.2024	91.500	0	(916)	(916)	(0,03)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	14.900	1	(308)	(307)	(0,01)
JPM	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,475	09.08.2024	71.500	0	929	929	0,03
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,813	20.06.2028	18.100	0	631	631	0,02
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,027	19.03.2024	37.000	0	(259)	(259)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,095	10.05.2024	ILS 19.800	0	(195)	(195)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,078	20.06.2028	12.600	0	(247)	(247)	(0,01)
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,540	04.06.2029	CLP 4.115.000	0	452	452	0,02
MYC	Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,800	04.01.2027	BRL 12.200	17	(110)	(93)	0,00
						\$ 192	\$ 1.412	\$ 1.604	0,06

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2023	CZK	125.274	\$	5.826	\$	77	0,00
	07.2023	KES	473.310		3.342		(7)	0,00
	07.2023	PLN	2.247		528		(25)	0,00
	07.2023	\$	1.659	£	1.312		9	0,00
	07.2023		5.669	ILS	20.612		(111)	0,00
	07.2023		1.298	MXN	23.891		92	0,00
	07.2023		594	PEN	2.180		6	0,00
	07.2023		7.001	PLN	29.115		160	0,01
	08.2023	€	2.796	\$	3.071		15	0,00
	08.2023	MXN	165.419		8.949		(622)	(0,02)
	08.2023	NZD	7.024		4.454		152	0,01
	08.2023	\$	242	AUD	358		(3)	0,00
	08.2023		18.929	CNY	129.905		(957)	(0,03)
	08.2023		711	EGP	23.675		32	0,00
	08.2023		9.345	€	8.600		57	0,00
	08.2023		0	ZAR	2		0	0,00
	09.2023	CLP	3.996.762	\$	4.808		(131)	0,00
	09.2023	NGN	310.612		536		143	0,01
	09.2023	TWD	58.910		1.941		45	0,00
	09.2023	\$	3.878	CLP	3.114.965		(31)	0,00
	09.2023		236	HKD	1.848		0	0,00
	09.2023		96	KRW	121.984		(3)	0,00
	09.2023		13.217	MYR	60.532		(182)	(0,01)
	09.2023		53	NGN	41.128		(1)	0,00
	09.2023		40.443	THB	1.402.760		(580)	(0,02)
	10.2023		897	KES	134.789		33	0,00
	10.2023	ZAR	105.882	\$	5.706		156	0,01
	11.2023	€	12.909	CZK	315.220		245	0,01
	03.2030	\$	12.534	IDR	246.110.438		1.797	0,07
BPS	07.2023	BRL	101.355	\$	20.567		(510)	(0,02)
	07.2023	CZK	26.475		1.229		14	0,00
	07.2023	MYR	43.807		9.544		141	0,01
	07.2023	PEN	7.872		2.159		(12)	0,00
	07.2023	PHP	174.925		3.103		(59)	0,00
	07.2023	PLN	20.360		4.922		(85)	0,00
	07.2023	\$	13.755	BRL	68.601		466	0,02
	07.2023		7.752	COP	35.048.976		607	0,02
	07.2023		21.767	CZK	468.215		(281)	(0,01)
	07.2023		128	€	118		0	0,00
	07.2023		3.345	£	2.610		(26)	0,00
	07.2023		2.914	¥	405.017		(112)	0,00
	07.2023		80.003	MXN	1.400.000		1.485	0,05
	07.2023		1.076	PEN	3.936		10	0,00
	07.2023		9.270	PHP	519.318		118	0,00
	07.2023		3.416	RON	15.889		77	0,00
	08.2023	€	346	\$	380		1	0,00
	08.2023	MYR	146.625		31.563		54	0,00
	08.2023	TWD	29.486		966		19	0,00
	08.2023	\$	13.886	CLP	11.459.287		349	0,01
	08.2023		8.445	CNH	58.352		(397)	(0,01)
	08.2023		44.289	CNY	304.030		(2.227)	(0,08)
	08.2023		10.280	COP	46.160.753		680	0,02
	08.2023		22.696	€	20.732		(30)	0,00
	08.2023		24.766	ZAR	460.891		(468)	(0,02)
	09.2023	PHP	1.115.619	\$	19.879		(254)	(0,01)
	09.2023	\$	3.083	COP	13.088.753		(12)	0,00
	09.2023		2.737	INR	225.096		(1)	0,00
	09.2023		388	PEN	1.420		1	0,00
	09.2023		3.571	THB	122.766		(82)	0,00
	09.2023		2.362	ZAR	43.590		(71)	0,00
	11.2023	€	8.500	CZK	203.104		(43)	0,00
	11.2023	ILS	31.394	\$	9.118		602	0,02
	12.2023	MXN	60.314		3.383		(29)	0,00
	12.2023	NGN	93.960		116		1	0,00
	01.2024	\$	1.147	EGP	37.804		(113)	0,00
BRC	07.2023	PLN	2.455	\$	588		(16)	0,00
	07.2023	RON	74.292		16.131		(205)	(0,01)
	07.2023	\$	5.806	CZK	124.241		(104)	0,00
	07.2023	\$	30.460	MYR	139.753		(462)	(0,02)
	07.2023		2.992	PLN	12.588		104	0,00
	07.2023		3.882	RON	17.366		(63)	0,00
	08.2023	CNH	14.135	\$	1.994		44	0,00
	08.2023	COP	113.470.437		26.635		(204)	(0,01)
	08.2023	\$	393	CNH	2.804		(6)	0,00
	08.2023		387	HUF	133.232		(3)	0,00
	08.2023		30.171	ZAR	557.665		(772)	(0,03)
	08.2023	ZAR	5.472	\$	285		(4)	0,00
	09.2023	ILS	8.181		2.290		79	0,00
	09.2023	MXN	168.876		9.674		(30)	0,00
	09.2023	\$	1.958	ILS	7.088		(42)	0,00
	09.2023		2.389	PEN	8.763		14	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	09.2023	ZAR	1.341.373	\$ 75.949	\$ 5.434	\$ 5.434	0,20	
	10.2023	TRY	2.584	95	0	0	0,00	
BSH	07.2023	\$	2.380	PEN 8.760	36	0	0,00	
	08.2023	PEN	7.590	\$ 1.898	0	(188)	(0,01)	
CBK	07.2023	CLP	19.046.146	23.534	0	(184)	(0,01)	
	07.2023	ILS	20.463	5.930	412	0	0,02	
	07.2023	MXN	36.301	2.098	2	(17)	0,00	
	07.2023	PEN	112.191	30.195	0	(756)	(0,03)	
	07.2023	PHP	218.419	4.004	55	0	0,00	
	07.2023	PLN	70.879	16.963	0	(468)	(0,02)	
	07.2023	\$	7.410	BRL 35.573	0	(36)	0,00	
	07.2023		6.785	COP 30.960.559	584	0	0,02	
	07.2023		21.326	CZK 460.457	17	(213)	(0,01)	
	07.2023		4.787	EGP 90.000	0	(1.875)	(0,07)	
	07.2023		34.279	PEN 124.593	90	0	0,00	
	07.2023		5.581	PLN 23.178	119	0	0,00	
	07.2023		4.797	RON 21.689	0	(28)	0,00	
	07.2023		3.580	UYU 134.341	14	0	0,00	
	07.2023	UYU	279.852	\$ 7.223	0	(247)	(0,01)	
	08.2023	CAD	1.982	1.487	0	(12)	0,00	
	08.2023	CLP	11.459.287	13.831	0	(403)	(0,01)	
	08.2023	COP	23.471.460	5.551	1	(2)	0,00	
	08.2023	EGP	63.401	1.829	0	(161)	(0,01)	
	08.2023	€	354	381	0	(6)	0,00	
	08.2023	TWD	30.699	1.006	20	0	0,00	
	08.2023	\$	3.025	BRL 15.357	143	0	0,01	
	08.2023		71	CNH 494	0	(3)	0,00	
	08.2023		6.561	€ 6.027	42	(14)	0,00	
	08.2023		236	MXN 4.084	1	0	0,00	
	08.2023		780	NOK 8.133	0	(19)	0,00	
	08.2023		2.212	PEN 8.641	163	0	0,01	
	08.2023	ZAR	197	\$ 11	0	0	0,00	
	09.2023	COP	4.980.182	1.179	11	0	0,00	
	09.2023	MXN	146.059	7.841	0	(544)	(0,02)	
	09.2023	PEN	8.040	2.185	0	(20)	0,00	
	09.2023	PHP	617.053	10.952	0	(184)	(0,01)	
	09.2023	\$	53.514	IDR 798.768.556	0	(456)	(0,02)	
	09.2023		24.941	INR 2.067.098	185	0	0,01	
	09.2023		18.721	PEN 68.649	104	0	0,00	
	09.2023		6.527	ZAR 119.974	5	(225)	(0,01)	
	09.2023	ZMW	77.599	\$ 4.421	90	0	0,00	
	10.2023	\$	52.467	CLP 43.001.960	497	0	0,02	
	10.2023		600	NGN 358.822	0	(155)	(0,01)	
	11.2023	ILS	37.683	\$ 11.421	1.199	0	1,199	0,04
	11.2023	\$	181	EGP 5.845	0	(12)	(0,00)	
	01.2024	EGP	29.698	\$ 807	0	(6)	0,00	
	02.2024		34.798	926	0	(8)	0,00	
	02.2024	\$	3.165	EGP 110.308	0	(205)	(0,01)	
DUB	07.2023	PEN	216.511	\$ 59.392	0	(323)	(0,01)	
	07.2023	\$	1	KES 118	0	0	0,00	
	07.2023		29.598	PEN 108.256	267	0	0,01	
	08.2023	ZAR	139.944	\$ 7.273	0	(105)	0,00	
	09.2023	\$	8.954	ZAR 166.316	119	(330)	(0,01)	
	10.2023		1.500	NGN 885.347	0	(396)	(0,01)	
	11.2023	EGP	14.282	\$ 501	89	0	0,00	
	01.2024	NGN	384.375	625	166	0	0,01	
	02.2024	\$	8.159	EGP 286.732	0	(470)	(0,02)	
	04.2024	TRY	2.282	\$ 73	1	0	0,00	
GLM	07.2023	BRL	225.484	47.187	445	0	0,02	
	07.2023	COP	21.842.485	4.960	0	(265)	(0,01)	
	07.2023	DOP	1.298.081	22.428	0	(793)	(0,03)	
	07.2023	EGP	287.714	10.325	1.198	(63)	1,135	0,04
	07.2023	PEN	15.492	4.242	0	(29)	0,00	
	07.2023	\$	21.535	BRL 113.559	2.006	0	2,006	0,07
	07.2023		7.456	COP 31.402.811	37	(6)	31	0,00
	07.2023		2.948	EGP 96.843	159	0	159	0,01
	07.2023		39.170	MXN 689.008	935	0	935	0,03
	07.2023		2.747	MYR 12.640	0	(34)	(34)	0,00
	07.2023		1.133	PLN 4.774	41	0	41	0,00
	07.2023		2.792	RON 12.594	0	(23)	(23)	0,00
	08.2023	CHF	180	\$ 204	1	0	1	0,00
	08.2023	CNH	297.572	42.456	1.417	0	1.417	0,05
	08.2023	DOP	1.545.785	27.240	40	(519)	(479)	(0,02)
	08.2023	\$	65.744	BRL 321.506	1.015	(436)	579	0,02
	08.2023		2.665	CNH 18.408	0	(127)	(127)	0,00
	08.2023		343	NOK 3.637	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		1.847	PEN 6.739	6	0	6	0,00
	08.2023	ZAR	78.924	\$ 4.253	91	0	91	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2023	IDR	62.693.244	4.204	\$ 40	\$ 0	0,00
	09.2023	TRY	225.925	8.834	447	0	0,02
	09.2023	\$	165.474	BRL 833.635	5.416	0	0,19
	09.2023		2.395	PEN 8.810	20	0	0,00
	09.2023		27.685	THB 955.129	0	(543)	(0,02)
	10.2023	DOP	359.626	\$ 6.413	37	0	0,00
	10.2023	MXN	219.363	12.495	0	(48)	0,00
	10.2023	NGN	1.735.661	3.097	939	0	0,03
	11.2023	DOP	195.976	3.524	76	0	0,00
	11.2023	EGP	46.453	1.384	88	(43)	0,00
	11.2023	€	12.017	PLN 54.009	21	0	0,00
	11.2023	\$	747	EGP 22.633	0	(94)	0,00
	12.2023	DOP	113.708	\$ 2.042	48	0	0,00
	01.2024	EGP	101.314	2.695	0	(78)	0,00
	01.2024	\$	3.055	EGP 100.557	0	(303)	(0,01)
	01.2024	ZAR	160.293	\$ 9.119	792	0	0,03
HUS	07.2023	EGP	469.250	25.000	9.815	0	0,34
IND	07.2023	BRL	14.316	\$ 2.896	0	(72)	0,00
	08.2023	CNH	24.621	3.592	196	0	0,01
	08.2023	\$	16.398	€ 15.090	99	0	0,00
	08.2023		880	NOK 9.225	0	(18)	0,00
	09.2023	INR	270.939	\$ 3.296	3	0	0,00
	11.2023	€	1.739	HUF 805.467	384	0	0,01
	06.2024	\$	7.206	TWD 185.403	0	(1.078)	(0,04)
JPM	07.2023	COP	13.055.307	\$ 2.820	0	(293)	(0,01)
	07.2023	¥	137.927	964	10	0	0,00
	07.2023	MXN	48.989	2.785	0	(66)	0,00
	07.2023	PHP	14.294	262	3	0	0,00
	07.2023	SGD	900	681	16	0	0,00
	07.2023	TRY	6.201	238	0	0	0,00
	07.2023	\$	6.716	BRL 33.513	231	0	0,01
	07.2023		19.166	MXN 337.899	502	0	0,02
	07.2023		449	NGN 246.211	0	(130)	0,00
	07.2023		265	PLN 1.123	11	0	0,00
	07.2023		43.121	RON 195.728	0	(84)	0,00
	08.2023	CAD	3.259	\$ 2.437	0	(27)	0,00
	08.2023	CHF	2.913	3.248	4	(26)	0,00
	08.2023	COP	13.510.737	3.186	0	(22)	0,00
	08.2023	HUF	9.918.868	28.660	159	(153)	0,00
	08.2023	MXN	164.219	9.478	0	(20)	0,00
	08.2023	\$	44.975	CNY 307.975	0	(2.367)	(0,08)
	08.2023		1.187	EGP 39.726	60	0	0,00
	08.2023		210	HUF 71.949	0	(2)	0,00
	08.2023		964	¥ 137.341	0	(10)	0,00
	08.2023		126	NOK 1.341	0	(1)	0,00
	08.2023		448	UYU 17.593	18	0	0,00
	08.2023		4.345	ZAR 79.525	0	(152)	(0,01)
	08.2023	UYU	19.861	\$ 500	0	(27)	0,00
	08.2023	ZAR	185.903	9.566	0	(234)	(0,01)
	09.2023	COP	2.248.074	532	5	0	0,00
	09.2023	IDR	26.138.902	1.741	4	0	0,00
	09.2023	ILS	6.826	1.922	77	0	0,00
	09.2023	TRY	56.193	2.114	38	0	0,00
	09.2023	\$	6.361	INR 523.313	0	0	0,00
	09.2023		454	NGN 269.621	0	(113)	0,00
	09.2023		3.847	THB 132.152	0	(91)	0,00
	09.2023		11.931	ZAR 233.721	355	0	0,01
	10.2023		793	NGN 491.213	0	(184)	(0,01)
	11.2023	HUF	806.200	€ 1.739	0	(387)	(0,01)
	12.2023	NGN	421.659	\$ 679	165	0	0,01
	12.2023	\$	815	NGN 514.954	0	(186)	(0,01)
	01.2024	EGP	39.488	\$ 1.071	0	(10)	0,00
	01.2024	\$	499	EGP 16.406	0	(50)	0,00
	01.2024		82	NGN 67.814	0	(1)	0,00
	02.2024	EGP	50.142	\$ 1.323	0	(21)	0,00
	04.2024	KES	802.538	5.222	0	(77)	0,00
	04.2024	TRY	267.487	8.535	57	0	0,00
	04.2024	\$	2.330	TRY 69.917	0	(114)	0,00
	06.2024		1.104	IDR 16.560.000	0	(9)	0,00
	03.2030	IDR	252.540.875	\$ 12.118	0	(2.587)	(0,09)
	03.2030	\$	11.598	IDR 246.110.438	2.733	0	0,10
MBC	07.2023	£	7.874	\$ 9.747	0	(264)	(0,01)
	07.2023	SGD	29	22	1	0	0,00
	07.2023	\$	1.486	KES 215.400	38	0	0,00
	07.2023		108.678	PLN 470.010	6.909	0	0,25
	08.2023	€	52.236	\$ 57.641	534	0	0,02
	08.2023	\$	2.748	CNY 19.365	0	(69)	0,00
	08.2023		415	COP 1.874.001	30	0	0,00
	08.2023	ZAR	92.602	\$ 4.990	109	0	0,00
	09.2023	\$	177	KRW 226.123	0	(5)	0,00
	09.2023		140	THB 4.821	0	(3)	0,00
	09.2023	ZAR	158.510	\$ 8.762	430	0	0,02
	11.2023	€	3.818	PLN 17.159	7	0	0,00
	01.2024	\$	992	EGP 32.681	0	(98)	0,00
MYI	07.2023	CZK	23.199	\$ 1.085	20	0	0,00
	07.2023	MXN	90.006	4.996	0	(239)	(0,01)
	07.2023	PHP	111.680	1.986	0	(33)	0,00
	07.2023	PLN	2.385	553	0	(34)	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
	07.2023	TRY	222.191	\$ 8.925	\$ 409	\$ 0	0,02
	07.2023	\$	20.488	COP 86.379.722	67	0	0,00
	07.2023		3.798	CZK 81.879	0	(41)	0,00
	07.2023		25.730	EGP 568.058	0	(7.441)	(0,27)
	07.2023		341	MXN 5.968	7	0	0,00
	07.2023		11.260	MYR 51.947	4	(114)	0,00
	07.2023		1.916	PLN 8.066	68	0	0,00
	08.2023	€	12.185	\$ 13.211	0	(110)	0,00
	08.2023	TWD	75.619		57	0	0,00
	08.2023	\$	8.797	€ 8.123	84	0	0,00
	08.2023		28	ZAR 520	0	(1)	0,00
	08.2023	ZAR	302.031	\$ 15.699	0	(223)	(0,01)
	09.2023	AED	29.573		0	0	0,00
	09.2023	IDR	40.511.883	8.052	29	0	0,00
	09.2023	TRY	184.140	2.720	12	0	0,00
	09.2023	\$	5.784	IDR 86.351.356	0	(48)	0,00
	09.2023		253	ILS 906	0	(8)	0,00
	09.2023		199	KRW 254.127	0	(5)	0,00
	09.2023		23.034	THB 791.300	0	(548)	(0,02)
	09.2023		26.211	ZAR 497.154	417	(493)	0,00
	10.2023	CLP	21.830.145	\$ 26.202	0	(685)	(0,02)
	10.2023	ZAR	2.449		4	0	0,00
	11.2023	CZK	203.201	€ 8.500	38	0	0,00
	11.2023	EGP	69.353	\$ 1.977	0	(20)	0,00
	01.2024	NGN	317.955		137	0	0,01
	01.2024	\$	3.143	EGP 105.605	0	(269)	(0,01)
	02.2024	EGP	21.106	\$ 563	0	(3)	0,00
RBC	07.2023	\$	21.849	MXN 420.398	2.621	0	0,09
	07.2023		2.757	MYR 12.688	0	(34)	0,00
	08.2023	MXN	1.556.660	\$ 89.825	0	(209)	(0,01)
	08.2023	\$	2.905	CAD 3.938	73	0	0,00
RYL	09.2023		11.222	ZAR 204.941	0	(449)	(0,02)
SCX	07.2023	€	27	\$ 29	0	0	0,00
	07.2023	MYR	32.159		94	0	0,00
	07.2023	NGN	300.933		181	0	0,01
	07.2023	\$	72	NGN 55.296	0	0	0,00
	08.2023	MYR	32.370	\$ 6.970	14	0	0,00
	08.2023	NZD	2.493		29	0	0,00
	08.2023	TWD	34.602		22	0	0,00
	08.2023	\$	3.875	BRL 18.906	25	0	0,00
	08.2023		19.267	CNH 132.430	0	(1.003)	(0,04)
	09.2023	TWD	49.300	\$ 1.617	31	0	0,00
	09.2023	\$	12.605	INR 1.044.968	97	0	0,00
	09.2023		1.760	PEN 6.479	18	0	0,00
	09.2023		25.207	THB 877.904	0	(259)	(0,01)
	09.2023		2.166	TRY 49.406	0	(341)	(0,01)
	09.2023		2.457	ZAR 45.281	0	(77)	0,00
	10.2023	CLP	21.171.815	\$ 25.389	0	(688)	(0,02)
	11.2023	EGP	57.399		0	(83)	0,00
	11.2023	\$	3.855	EGP 150.553	480	0	0,02
	12.2023		2.677	KES 393.738	9	0	0,00
	01.2024		1.039	EGP 34.170	0	(104)	0,00
	01.2024		854	NGN 701.988	0	(15)	0,00
	02.2024		2.221	EGP 77.297	0	(147)	(0,01)
	06.2024	KES	411.269	\$ 2.677	0	(7)	0,00
	03.2030	IDR	239.680.000	10.700	0	(3.257)	(0,12)
SOG	07.2023	\$	2.568	KES 372.407	66	0	0,00
	09.2023		240	ZAR 4.538	0	(1)	0,00
	01.2024		1.697	EGP 55.237	0	(187)	(0,01)
SSB	07.2023		17.870	BRL 89.763	738	0	0,03
	07.2023		23.744	CLP 19.073.452	8	0	0,00
	07.2023		30.760	PEN 112.199	176	0	0,01
	08.2023	CLP	19.128.537	\$ 23.744	2	0	0,00
	08.2023	PEN	112.199		0	(158)	(0,01)
	09.2023	\$	4.945	CLP 3.996.762	0	(6)	0,00
TOR	07.2023	COP	18.477.387	\$ 4.422	26	0	0,00
	07.2023	\$	4.422	COP 18.327.934	0	(33)	0,00
	07.2023		110	CZK 2.354	0	(1)	0,00
	07.2023		5.022	£ 3.952	3	0	0,00
	07.2023		38.286	PLN 162.267	1.619	0	0,06
	08.2023	£	3.952	\$ 5.023	0	(2)	0,00
	08.2023	\$	281	ZAR 5.472	7	0	0,00
	08.2023	ZAR	138.447	\$ 7.324	26	0	0,00
	09.2023	\$	2.385	ZAR 46.448	59	(2)	0,00
UAG	07.2023	COP	9.694.156	\$ 2.325	6	0	0,00
	07.2023	PLN	241.738		0	(304)	(0,01)
	07.2023	RON	163		0	0	0,00
	07.2023	\$	269	CZK 5.856	2	(2)	0,00
	07.2023		5.412	MXN 96.367	199	0	0,01
	07.2023		2.083	PLN 8.500	7	0	0,00
	07.2023		2.663	TRY 61.353	0	(326)	(0,01)
	08.2023	HUF	1.310.754	\$ 3.761	0	(26)	0,00
	08.2023	\$	17.186	CNY 118.222	0	(830)	(0,03)



Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
	08.2023	\$	2.325	COP	9.768.548	\$	0	\$	(5)	\$	(5)	0,00	
	08.2023		10	ZAR	196		0		0		0	0,00	
	08.2023	ZAR	160.144	\$	8.558		115		0		115	0,00	
	09.2023	ILS	5.908		1.650		54		0		54	0,00	
	09.2023	SGD	33.328		24.938		240		0		240	0,01	
	09.2023	\$	2.722	THB	95.047		0		(21)		(21)	0,00	
	09.2023		7.246	ZAR	128.361		0		(498)		(498)	(0,02)	
	10.2023		5.838		107.241		0		(217)		(217)	(0,01)	
	11.2023	CZK	316.478	€	12.958		0		(248)		(248)	(0,01)	
	11.2023	ILS	6.376	\$	1.844		114		0		114	0,00	
	04.2024	\$	6.557	TRY	198.196		0		(275)		(275)	(0,01)	
							\$	64.649	\$	(50.035)	\$	14.614	0,52
Summe Freiverkehrsfinanzderivate											\$	31.042	1,11

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS		
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>					
Banco Davivienda S.A. 13,501 % fällig am 13.12.2024 15,389 % fällig am 21.02.2024	COP	12.258.000 3.100.500	\$ 2.935 753	0,10 0,03	
BanColombia S.A. 5,917 % fällig am 27.01.2024 13,320 % fällig am 08.06.2025 13,637 % fällig am 14.12.2024 16,137 % fällig am 01.09.2024		14.430.300 6.362.000 17.049.000 6.849.000	3.326 1.529 4.106 1.659	0,12 0,05 0,15 0,06	
BBVA Colombia S.A. 5,870 % fällig am 15.07.2024 14,540 % fällig am 13.01.2024 16,412 % fällig am 25.04.2024		14.375.000 6.028.200 225.000	3.234 1.432 53	0,12 0,05 0,00	
Summe Einlagenzertifikate			\$	19.027	0,68
Summe Anlagen			\$	2.852.494	102,41
Sonstige Aktiva und Passiva			\$	(67.051)	(2,41)
Nettovermögen			\$	2.785.443	100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,76 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 41	\$ 41	0,00
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	14.861	11.513	0,41
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	158	151	0,01
Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2022	25.08.2021	2.759	310	0,01
		\$ 17.819	\$ 12.015	0,43

(k) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 153.171 USD (31. Dezember 2022: 86.429 USD) und Barmittel in Höhe von 3.296 USD (31. Dezember 2022: 1.840 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 285 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 25.147 USD (31. Dezember 2022: 21.557 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 17.830 USD (31. Dezember 2022: 28.320 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.405.489	\$ 143.534	\$ 2.549.023
Investmentfonds	269.736	0	0	269.736
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	101	14.259	348	14.708
Einlagen bei Kreditinstituten	0	5.576	13.451	19.027
<b>Summen</b>	<b>\$ 269.837</b>	<b>\$ 2.425.324</b>	<b>\$ 157.333</b>	<b>\$ 2.852.494</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.695.287	\$ 77.697	\$ 1.772.984
Investmentfonds	131.643	0	0	131.643
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	739	1.315	(11)	2.043
Einlagen bei Kreditinstituten	0	3.012	4.042	7.054
<b>Summen</b>	<b>\$ 132.382</b>	<b>\$ 1.699.614</b>	<b>\$ 81.728</b>	<b>\$ 1.913.724</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	7,000 %	12.12.2022	TBD <sup>(1)</sup>	PLN (197.832)	\$ (50.507)	(1,81)
					(22.921)	(0,82)
JML	7,000	16.03.2023	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (6.862)	(6.864)	(0,25)
MBC	8,750	29.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	ZAR (241.488)	(12.833)	(0,46)
	8,850	15.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>		(33.007)	(1,19)
SCX	8,700	23.03.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(441.680)	(23.881)	(0,86)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (150.013)</b>	<b>(5,39)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 3.256	\$ (3.010)	\$ 246	\$ 13.050	\$ (12.520)	\$ 530
BPS	(57)	690	633	(16.890)	15.580	(1.310)
BRC	4.184	(3.420)	764	(1.554)	1.440	(114)
BSH	(885)	0	(885)	(1.101)	0	(1.101)
BSS	0	890	890	0	920	920
CBK	(1.093)	1.340	247	6.571	(6.325)	246
CKL	(271)	0	(271)	(265)	0	(265)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	2.606	0	2.606
DUB	(23)	(220)	(243)	50	0	50
GLM	21.067	(18.700)	2.367	10.551	(10.070)	481
GST	746	(780)	(34)	(180)	190	10
HUS	8.011	(7.910)	101	6.780	(6.910)	(130)
IND	(486)	440	(46)	(834)	(1.510)	(2.344)
JPM	(836)	650	(186)	1.710	(1.280)	430
MBC	7.619	(7.270)	349	5.248	(4.930)	318
MYC	(118)	0	(118)	(365)	410	45
MYI	(7.841)	8.050	209	(4.865)	3.730	(1.135)
RBC	2.467	(2.320)	147	(4.253)	4.420	167
RYL	(449)	290	(159)	274	(260)	14
SCX	(4.981)	4.200	(781)	1.418	(1.120)	298
SOG	(122)	210	88	(587)	590	3
SSB	760	(830)	(70)	(924)	1.040	116
TOR	1.702	(1.280)	422	309	(270)	39
UAG	(1.608)	1.070	(538)	4.355	(4.700)	(345)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	72,29	63,67
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	19,22	27,35
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	1,33
Investmentfonds	9,68	6,86
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,59)	(1,03)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,11	1,10
Einlagenzertifikate	0,68	0,37
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(5,39)	(4,45)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,01	0,16
Aserbaidshen	0,10	0,23
Bahamas	k. A.	0,13
Brasilien	3,24	4,48
Cayman-Inseln	0,26	0,44
Chile	3,01	2,06
China	5,37	5,74
Kolumbien	3,67	3,65
Tschechische Republik	3,39	2,89
Dänemark	0,00	0,00
Dominikanische Republik	2,69	1,30
Ungarn	1,97	0,40
Indonesien	6,13	5,26
International	0,58	k. A.
Irland	0,58	0,83
Israel	0,80	1,75
Elfenbeinküste	0,24	0,38
Jersey, Kanalinseln	0,28	0,51
Kasachstan	k. A.	0,05
Luxemburg	0,02	0,01
Malaysia	10,11	9,11
Mexiko	10,23	8,11
Niederlande	0,07	0,20
Nigeria	0,12	0,22
Peru	3,64	2,32
Philippinen	0,10	0,04
Polen	5,16	4,79
Katar	0,66	0,92
Rumänien	2,06	3,99
Russland	0,18	0,26
Serbien	0,11	0,15
Südafrika	11,58	13,70
Südkorea	0,35	0,18
Supranational	0,93	0,37
Tansania	0,32	0,49
Thailand	6,34	4,23
Türkei	0,38	0,53
Vereinigte Arabische Emirate	1,17	1,60
Großbritannien	0,29	0,58
USA	1,97	2,50
Uruguay	0,40	k. A.
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	0,31
Sambia	0,18	k. A.
Kurzfristige Instrumente	2,83	7,48
Investmentfonds	9,68	6,86
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen -		
Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,59)	(1,03)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,28	0,13
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,08)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen -		
Schutzkauf	0,04	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen -		
Schutzverkauf	0,00	(0,14)
Cross-Currency Swaps	0,30	0,42
Zinsswaps	0,06	0,19
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,52	0,52
Einlagenzertifikate	0,68	0,37
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,41)	0,31
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond ESG Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				8,375 % fällig am 15.03.2034	IDR 564.000	\$ 43	0,56	8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR 1.000	\$ 47	0,61			
<b>CHILE</b>				8,750 % fällig am 15.05.2031	1.178.000	90	1,17	8,250 % fällig am 31.03.2032	1.700	76	0,99			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>						402	5,23	8,500 % fällig am 31.01.2037	500	20	0,26			
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos				<b>MALAYSIA</b>				8,750 % fällig am 31.01.2044	1.400	54	0,70			
2,800 % fällig am 01.10.2033	CLP	45.000	\$ 45	0,59	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			8,750 % fällig am 28.02.2048	3.900	150	1,95			
5,000 % fällig am 01.10.2028		60.000	74	0,96	Malaysia Government International Bond			9,000 % fällig am 31.01.2040	1.100	45	0,59			
6,000 % fällig am 01.04.2033		100.000	132	1,72	2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR 410	81	1,05	10,500 % fällig am 21.12.2026	1.700	93	1,21		
			251	3,27	3,582 % fällig am 15.07.2032		150	32	0,42		512	6,66		
<b>KOLUMBIEN</b>				3,757 % fällig am 22.05.2040			12	3	0,04	<b>SUPRANATIONAL</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				3,800 % fällig am 17.08.2023			500	107	1,39	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Colombian TES				4,065 % fällig am 15.06.2050			122	26	0,34	Asian Development Bank				
7,000 % fällig am 26.03.2031	COP	1.443.100	292	3,80	4,762 % fällig am 07.04.2037		170	39	0,51	4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN 2.200	121	1,57	
13,250 % fällig am 09.02.2033		18.100	5	0,06	Malaysia Government Investment Issue					6,000 % fällig am 05.02.2028	BRL 750	145	1,89	
			297	3,86	3,465 % fällig am 15.10.2030		230	48	0,62	12,750 % fällig am 03.03.2025	COP 339.000	83	1,08	
<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>				3,990 % fällig am 15.10.2025			88	19	0,25	Asiatische Infrastrukturinvestmentsbank				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				4,130 % fällig am 09.07.2029			910	199	2,59	4,250 % fällig am 27.01.2027	PHP 600	10	0,13	
Czech Republic Government International Bond				4,193 % fällig am 07.10.2032			278	61	0,79	Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
0,050 % fällig am 29.11.2029	CZK	3.400	119	1,55	4,369 % fällig am 31.10.2028		412	91	1,18	3,010 % fällig am 13.03.2028	PLN 600	128	1,66	
0,250 % fällig am 10.02.2027		1.300	51	0,66	4,417 % fällig am 30.09.2041		164	36	0,47	5,080 % fällig am 15.12.2025	MXN 1.900	98	1,27	
1,200 % fällig am 13.03.2031		900	33	0,43				742	9,65	Europäische Investitionsbank				
1,500 % fällig am 24.04.2040		400	12	0,16	<b>MEXIKO</b>					2,875 % fällig am 15.11.2029	PLN 500	104	1,35	
1,750 % fällig am 23.06.2032		1.000	37	0,48	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
1,950 % fällig am 30.07.2037		200	7	0,09	Mexico Government International Bond					4,500 % fällig am 22.01.2026	ZAR 2.200	105	1,37	
2,000 % fällig am 13.10.2033		1.800	67	0,87	7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN 100	5	0,06	4,750 % fällig am 21.01.2027	IDR 2.880.000	186	2,42		
2,400 % fällig am 17.09.2025		4.800	208	2,70	7,500 % fällig am 03.06.2027		3.400	188	2,44	7,070 % fällig am 26.06.2029	MXN 1.400	75	0,98	
4,200 % fällig am 04.12.2036		600	27	0,35	7,500 % fällig am 26.05.2033		2.400	129	1,68	8,500 % fällig am 06.04.2026		2.000	112	1,46
5,000 % fällig am 30.09.2030		2.200	105	1,36	7,750 % fällig am 29.05.2031		1.300	72	0,94	9,750 % fällig am 21.01.2027	BRL 750	158	2,05	
			666	8,65	7,750 % fällig am 13.11.2042		800	42	0,55	International Finance Corp.				
					8,000 % fällig am 07.11.2047		929	50	0,65	8,000 % fällig am 09.10.2023	IDR 2.200.000	147	1,91	
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>				8,500 % fällig am 18.11.2038		2.400	137	1,78			1.472	19,14		
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								623	8,10	<b>THAILAND</b>				
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik				<b>PERU</b>						<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP	900	17	0,22	Peru Government International Bond					Thailand Government International Bond				
13,000 % fällig am 05.12.2025		3.600	70	0,91	5,400 % fällig am 12.08.2034	PEN 200	49	0,64	1,585 % fällig am 17.12.2035	THB 806	20	0,26		
Dominican Republic Government International Bond				6,900 % fällig am 12.08.2037		100	27	0,35	2,000 % fällig am 17.12.2031		830	23	0,30	
13,625 % fällig am 10.02.2034		2.000	46	0,60	7,300 % fällig am 12.08.2033		950	271	3,52	2,000 % fällig am 17.06.2042		180	4	0,05
			133	1,73				347	4,51	2,350 % fällig am 17.06.2026		7.419	210	2,73
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>POLEN</b>						2,650 % fällig am 17.06.2028		4.349	125	1,63
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						3,350 % fällig am 17.06.2033		940	28	0,36
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				Poland Government International Bond						3,400 % fällig am 17.06.2036		2.001	60	0,78
0,625 % fällig am 25.07.2025	PLN	500	110	1,43	1,250 % fällig am 25.10.2030	PLN 59	11	0,14	3,450 % fällig am 17.06.2043		1.117	33	0,43	
5,800 % fällig am 19.01.2028	ZAR	2.500	115	1,49	1,750 % fällig am 25.04.2032		250	45	0,59	3,775 % fällig am 25.06.2032		277	9	0,12
			225	2,92	2,500 % fällig am 25.07.2026		500	112	1,46			512	6,66	
<b>UNGARN</b>				2,750 % fällig am 25.10.2029						<b>URUGUAY</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				6,000 % fällig am 25.10.2033						<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Hungary Government International Bond				7,500 % fällig am 25.07.2028						Uruguay Government International Bond				
4,000 % fällig am 28.04.2051	HUF	15.900	30	0,39						3,700 % fällig am				
4,500 % fällig am 27.05.2032										26.06.2037 (c)	UYU 346	10	0,13	
(d)										8,500 % fällig am 15.03.2028	3.200	82	1,06	
4,750 % fällig am 24.11.2032		46.600	114	1,48	<b>RUMANIEN</b>							92	1,19	
6,750 % fällig am 22.10.2028		2.000	5	0,07	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				
		22.800	64	0,83	Romania Government International Bond					<b>U.S. TREASURY BILLS</b>				
			213	2,77	4,150 % fällig am 26.01.2028	RON 300	60	0,78	5,156 % fällig am					
<b>INDONESIEN</b>				4,150 % fällig am 24.10.2030		200	38	0,49	03.08.2023 (a)(b)	\$ 200	199	2,59		
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				4,250 % fällig am 28.04.2036		465	80	1,04	5,166 % fällig am					
Indonesia Government International Bond				4,750 % fällig am 11.10.2034		40	7	0,09	08.08.2023 (a)(b)	100	100	1,30		
6,375 % fällig am 15.04.2032	IDR 1.467.000	99	1,29	6,625 % fällig am 27.09.2029	€ 15	17	0,22	5,239 % fällig am						
6,375 % fällig am 15.04.2042		565.000	37	0,48				07.09.2023 (a)(b)	200	198	2,57			
7,000 % fällig am 15.02.2033		44.000	3	0,04	<b>SÜDAFRIKA</b>				Summe kurzfristige Instrumente		497	6,46		
7,125 % fällig am 15.06.2042		17.000	1	0,01	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 7.580	98,55			
7,500 % fällig am 15.06.2035		171.000	12	0,16	South Africa Government International Bond									
7,500 % fällig am 15.05.2038		193.000	14	0,18	2,000 % fällig am									
8,250 % fällig am 15.05.2036	1.335.000	103	1,34	31.01.2025 (c)	ZAR 523	27	0,35							

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,565 %	04.01.2027	BRL 900	\$ 2	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,140	04.01.2027	900	11	0,12

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,200 %	04.01.2027	BRL 400	\$ (2)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,244	02.01.2026	500	(2)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,380	04.01.2027	100	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,400	04.01.2027	250	1	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,410	04.01.2027	250	1	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,420	02.01.2026	600	3	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,445	02.01.2025	300	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,515	02.01.2025	400	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,540	02.01.2024	2.700	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,725	02.01.2025	1.500	0	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,734	02.01.2025	200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,740	02.01.2025	100	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,750	02.01.2025	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,800	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,810	02.01.2025	400	1	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,835	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,845	02.01.2025	600	0	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	02.01.2025	500	0	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,905	04.01.2027	200	(2)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,005	02.01.2025	500	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,090	02.01.2025	400	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,090	04.01.2027	300	3	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,091	04.01.2027	200	2	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,210	02.01.2025	300	0	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024	900	0	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	01.07.2024	900	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,533	02.01.2029	300	(5)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,595	01.07.2024	900	1	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,684	02.01.2029	300	4	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,740	02.01.2025	300	(1)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,746	02.01.2029	300	4	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,765	02.01.2025	100	0	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	02.01.2024	3.400	5	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024	1.800	4	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	02.01.2025	200	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025	100	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,218	02.01.2029	700	(13)	(0,16)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025	400	(2)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,995	02.01.2024	900	1	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,190	13.06.2029	COP 180.300	1	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,305	28.04.2028	124.600	1	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,390	13.06.2028	65.600	0	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,495	27.04.2030	40.000	0	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,950	24.03.2030	130.000	(2)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,040	05.05.2030	1.200	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,300	26.03.2031	136.900	(5)	(0,05)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,370	17.03.2030	47.800	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,393	21.03.2030	111.700	(3)	(0,04)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,410	26.03.2031	123.400	(3)	(0,04)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,423	17.03.2030	141.500	(4)	(0,04)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,930	07.03.2033	34.420	(1)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,400	21.11.2029	18.300	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,500	21.03.2025	614.100	2	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,550	17.03.2025	43.090	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,353	15.11.2027	151.660	6	0,06
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,000	26.11.2025	124.890	(2)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,070	26.11.2025	128.000	(2)	(0,03)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033	KRW 218.574	(2)	(0,03)
Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB 4.530	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,120	13.03.2028	ZAR 300	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,830	23.02.2030	600	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	10,150	18.05.2033	300	1	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	20.03.2033	CLP 5.340	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,770	21.11.2027	28.300	(1)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,070	28.02.2028	55.800	(2)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	01.10.2028	3.800	1	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,195	01.10.2028	2.100	0	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK 9.600	(2)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	€ 100	(1)	(0,02)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,570	22.08.2027	HUF 4.800	2	0,02
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,220	20.03.2033	PLN 100	0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,295	25.01.2028	1.850	(1)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,520	20.03.2026	300	0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,870	22.04.2027	200	2	0,03
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024	100	(1)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,890	22.08.2024	300	(3)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,207	19.06.2028	MXN 600	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,300	16.06.2028	1.200	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,438	20.03.2028	700	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,448	27.04.2028	400	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,450	27.04.2028	900	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,560	18.05.2028	300	0	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,585 %	18.05.2028	MXN 300	\$ 0	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,600	18.05.2028	100	0	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,610	18.05.2028	100	0	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,645	18.05.2028	100	0	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,656	18.05.2028	200	0	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,720	19.05.2028	100	0	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,722	19.05.2028	100	0	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,755	19.05.2028	100	0	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	8,762	13.04.2028	2.300	(2)	(0,03)
						\$ (12)	(0,16)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (12)	(0,16)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC EUR versus CZK	CZK 23,830	01.11.2023	8	\$ 1	\$ 3	0,05
GLM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF 385,000	01.11.2023	3	0	2	0,02
	Put - OTC EUR versus PLN	PLN 4,560	01.11.2023	6	1	5	0,06
MYI	Put - OTC USD versus BRL	BRL 4,820	22.08.2023	70	1	1	0,01
	Put - OTC USD versus MXN	MXN 18,500	25.07.2023	71	2	6	0,07
RBC	Put - OTC USD versus CAD	CAD 1,305	13.07.2023	71	0	0	0,00
UAG	Call - OTC EUR versus USD	\$ 1,140	13.07.2023	64	0	0	0,00
	Call - OTC USD versus ZAR	ZAR 20,500	09.10.2023	112	2	1	0,02
					\$ 7	\$ 18	0,23

##### STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs <sup>(2)</sup>	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten <sup>(2)</sup>	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600 %	27.12.2023	100	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,100	20.12.2023	100	0	0	0,00
MYI	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	27.12.2023	50	0	0	0,00
					\$ 0	\$ 0	0,00

##### VERKAUFSOPTIONEN

##### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
JPM	Call - OTC USD versus INR	IDR 14.950,000	06.06.2024	21	\$ (1)	\$ (1)	(0,01)
	Put - OTC USD versus INR	14.950,000	06.06.2024	21	(1)	(1)	(0,01)
MYI	Call - OTC USD versus CLP	CLP 850,000	18.07.2023	41	(1)	0	0,00
	Put - OTC USD versus MXN	MXN 17,750	25.07.2023	142	(1)	(4)	(0,05)
	Call - OTC USD versus MXN	21,000	07.03.2024	67	0	0	(0,01)
					\$ (4)	\$ (6)	(0,08)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

<sup>(2)</sup> Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

##### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
GST	Turkey Government International Bond	(1,000) %	20.06.2024	\$ 100	\$ 3	\$ (2)	\$ 1	0,01

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 10	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	770	(2)	1	(1)	(0,01)
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	308	0	1	1	0,01
						\$ (2)	\$ 2	\$ 0	0,00

## DEWISENTERMINIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CZK 5.325	\$ 245	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,01
	07.2023	PHP 1.932	35	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN 15	4	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 136	ILS 490	0	(5)	(5)	(0,06)
	08.2023	MXN 470	\$ 25	0	(2)	(2)	(0,02)
	08.2023	NZD 20	13	0	0	0	0,01
	08.2023	\$ 2	EGP 82	0	0	0	0,00
	08.2023	24	€ 22	0	0	0	0,00
	08.2023	141	ILS 489	0	(10)	(10)	(0,12)
	08.2023	ZAR 454	\$ 24	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 9	CLP 7.227	0	0	0	0,00
	09.2023	35	MYR 160	0	0	0	(0,01)
	09.2023	26	THB 906	0	(1)	(1)	(0,01)
	09.2023	47	TWD 1.438	0	(1)	(1)	(0,01)
	10.2023	ZAR 297	\$ 16	0	0	0	0,01
	11.2023	€ 49	CZK 1.206	1	0	1	0,01
BPS	07.2023	BRL 280	\$ 57	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023	MYR 52	11	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 32	BRL 158	1	0	1	0,01
	07.2023	9	CZK 189	0	0	0	0,00
	07.2023	92	MYR 423	0	(1)	(1)	(0,02)
	07.2023	49	PHP 2.755	1	0	1	0,01
	07.2023	11	RON 51	0	0	0	0,00
	07.2023	29	SGD 39	0	0	0	(0,01)
	08.2023	CLP 67.282	\$ 82	0	(2)	(2)	(0,03)
	08.2023	MXN 4.241	244	0	(2)	(2)	(0,02)
	08.2023	MYR 507	109	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 22	COP 98.915	1	0	1	0,02
	08.2023	11	€ 10	0	0	0	0,00
	08.2023	24	TWD 720	0	0	0	(0,01)
	08.2023	ZAR 238	\$ 13	0	0	0	0,00
	09.2023	PHP 4.716	84	0	(1)	(1)	(0,02)
	09.2023	\$ 7	CLP 5.724	0	0	0	0,00
	09.2023	11	IDR 163.593	0	0	0	0,00
	09.2023	8	INR 658	0	0	0	0,00
	09.2023	41	THB 1.421	0	(1)	(1)	(0,01)
	12.2023	MXN 143	\$ 8	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	PHP 75	1	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN 16	4	0	0	0	0,00
	07.2023	SGD 53	40	1	0	1	0,01
	07.2023	\$ 45	MYR 207	0	0	0	(0,01)
	07.2023	7	PHP 391	0	0	0	0,00
	07.2023	18	PLN 73	0	0	0	0,00
	07.2023	14	RON 64	0	0	0	0,00
	08.2023	COP 750.524	\$ 176	0	(1)	(1)	(0,02)
	08.2023	\$ 5	£ 4	0	0	0	0,00
	08.2023	12	HUF 4.164	0	0	0	0,00
	08.2023	65	¥ 8.553	0	(6)	(6)	(0,07)
	09.2023	1	ILS 4	0	0	0	0,00
	09.2023	11	MXN 183	0	0	0	0,00
	09.2023	40	PEN 147	0	0	0	0,00
	10.2023	MXN 1.202	\$ 64	0	(6)	(6)	(0,06)
	10.2023	TRY 189	7	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	BRL 58	12	0	0	0	0,00
	07.2023	CLP 47.605	59	0	0	0	(0,01)
	07.2023	COP 30.503	7	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023	ILS 688	209	24	0	24	0,30
	07.2023	MXN 5.000	260	0	(32)	(32)	(0,41)
	07.2023	PHP 1.140	21	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN 194	46	0	(2)	(2)	(0,02)
	07.2023	\$ 32	BRL 153	0	0	0	0,00
	07.2023	31	COP 138.941	4	0	4	0,03
	07.2023	8	CZK 174	0	0	0	0,00
	07.2023	57	MXN 1.005	2	0	2	0,03
	07.2023	29	PEN 105	0	0	0	0,00
	07.2023	29	PLN 119	0	0	0	0,01
	07.2023	80	UYU 2.993	1	0	1	0,01
	07.2023	UYU 5.812	\$ 150	0	(6)	(6)	(0,06)
	08.2023	BRL 319	62	0	(5)	(5)	(0,05)



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	CAD	6	\$ 5	0	\$ 0	0,00
	08.2023	COP	63.876	15	0	0	0,00
	08.2023	EGP	82	2	0	0	0,00
	08.2023	ILS	491	152	21	0	0,26
	08.2023	¥	9.700	71	5	0	0,05
	08.2023	PEN	6	1	0	0	0,00
	08.2023	\$	12	BRL 58	0	0	0,00
	08.2023		81	CLP 67.282	2	0	0,03
	08.2023		62	€ 57	0	0	0,01
	08.2023		7	¥ 1.000	0	0	(0,01)
	08.2023		3	NOK 31	0	0	0,00
	08.2023		25	TWD 750	0	0	(0,01)
	08.2023		23	ZAR 418	0	(1)	(0,01)
	09.2023	COP	14.111	\$ 3	0	0	0,00
	09.2023	PEN	363	99	0	0	0,00
	09.2023	\$	13	IDR 201.090	0	0	0,00
	09.2023		36	INR 2.955	0	0	0,00
	09.2023		10	THB 343	0	0	0,00
	11.2023	ILS	98	\$ 29	4	0	0,04
	11.2023	\$	35	EGP 1.145	0	(2)	(0,03)
	02.2024	EGP	295	\$ 8	0	0	0,00
	02.2024	\$	42	EGP 1.468	0	(3)	(0,03)
GLM	07.2023	BRL	2.459	\$ 509	0	0	(0,01)
	07.2023	COP	20.469	5	0	0	0,00
	07.2023	DOP	4.044	70	0	(2)	(0,03)
	07.2023	ILS	196	58	6	0	0,07
	07.2023	PEN	67	18	0	0	0,00
	07.2023	PLN	36	8	0	0	(0,01)
	07.2023	\$	430	BRL 2.305	49	0	0,63
	07.2023		2	COP 8.480	0	0	0,00
	07.2023		31	CZK 667	0	0	(0,01)
	07.2023		7	DOP 394	0	0	0,00
	07.2023		203	MXN 3.554	5	0	0,06
	07.2023		13	MYR 60	0	0	0,00
	07.2023		16	RON 70	0	0	0,00
	07.2023		79	SGD 104	0	(1)	(0,02)
	08.2023	BRL	28	\$ 6	0	0	0,00
	08.2023	DOP	1.127	20	0	0	0,00
	08.2023	\$	115	HUF 39.111	0	(2)	(0,02)
	08.2023		4	NOK 39	0	0	0,00
	08.2023		9	PEN 33	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	191	\$ 10	0	0	0,00
	09.2023	TRY	608	24	1	0	0,02
	09.2023	TWD	1.060	35	1	0	0,01
	09.2023	\$	509	BRL 2.486	0	0	0,01
	09.2023		5	COP 21.367	0	0	0,00
	09.2023		9	PEN 34	0	0	0,00
	09.2023		75	THB 2.581	0	(1)	(0,02)
	10.2023	DOP	1.459	\$ 26	0	0	0,00
	11.2023	CZK	1.206	€ 49	0	(1)	(0,01)
	11.2023	DOP	170	\$ 3	0	0	0,00
	11.2023	EGP	1.534	51	8	0	0,09
	11.2023	€	46	PLN 206	0	0	0,00
	11.2023	\$	2	EGP 75	0	0	0,00
	12.2023	DOP	223	\$ 4	0	0	0,00
	01.2024	EGP	761	20	0	0	0,00
	01.2024	\$	10	EGP 329	0	(1)	(0,01)
	01.2024	ZAR	599	\$ 34	3	0	0,04
JPM	07.2023	RON	203	44	0	(1)	(0,01)
	07.2023	TRY	455	17	0	0	0,00
	07.2023	\$	15	BRL 75	1	0	0,01
	07.2023		33	MXN 567	0	0	0,00
	08.2023	CAD	11	\$ 8	0	0	0,00
	08.2023	CHF	8	9	0	0	0,00
	08.2023	COP	36.076	9	0	0	0,00
	08.2023	€	25	28	0	0	0,00
	08.2023	£	6	8	0	0	0,00
	08.2023	\$	9	BRL 44	0	0	0,00
	08.2023		10	£ 8	0	0	0,00
	08.2023		170	HUF 59.239	1	0	0,02
	08.2023		11	¥ 1.406	0	(1)	(0,01)
	08.2023		1	NOK 14	0	0	0,00
	08.2023		4	UYU 163	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	520	\$ 27	0	(1)	(0,01)
	09.2023	IDR	392.787	26	0	0	0,00
	09.2023	PEN	266	72	0	(1)	(0,01)
	09.2023	\$	1	ILS 3	0	0	0,00
	09.2023		9	INR 740	0	0	0,00
	09.2023		3	PEN 12	0	0	0,00
	09.2023		20	THB 691	0	0	(0,01)
	01.2024	EGP	147	\$ 4	0	0	0,00
	04.2024	TRY	533	17	0	0	0,00
	06.2024	\$	3	IDR 45.000	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2023	PLN 633	\$ 147	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	(0,11)
	07.2023	\$ 10	MXN 174	0	0	0	0,00
	07.2023	155	RON 703	0	0	0	0,00
	08.2023	9	ZAR 172	0	0	0	0,00
	09.2023	10	COP 42.586	0	0	0	0,00
	09.2023	1	THB 25	0	0	0	0,00
	01.2024	4	EGP 125	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CZK 409	\$ 19	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN 228	13	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023	PLN 35	8	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 68	COP 286.653	0	0	0	0,00
	07.2023	112	ILS 393	0	(7)	(7)	(0,08)
	07.2023	29	MYR 134	0	0	0	0,00
	07.2023	16	PLN 67	0	0	0	0,01
	08.2023	€ 37	\$ 40	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD 3	0	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 24	€ 22	0	0	0	0,00
	08.2023	106	MXN 1.834	0	0	0	0,00
	08.2023	26	TWD 775	0	(1)	(1)	(0,01)
	08.2023	ZAR 75	\$ 4	0	0	0	0,00
	09.2023	IDR 100.437	7	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 30	IDR 449.763	0	0	0	0,00
	09.2023	102	THB 3.509	0	(3)	(3)	(0,03)
	01.2024	EGP 21	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2024	\$ 11	EGP 356	0	(1)	(1)	(0,01)
	02.2024	EGP 157	\$ 4	0	0	0	0,00
RYL	11.2023	\$ 28	ILS 98	0	(1)	(1)	(0,01)
SCX	07.2023	TRY 171	\$ 7	1	0	1	0,01
	07.2023	\$ 92	MYR 425	0	(1)	(1)	(0,02)
	08.2023	NZD 7	\$ 4	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 13	CLP 10.486	0	0	0	0,00
	09.2023	68	INR 5.614	1	0	1	0,01
	09.2023	10	PEN 38	0	0	0	0,00
	09.2023	39	TWD 1.202	0	(1)	(1)	(0,01)
	11.2023	EGP 110	\$ 3	0	0	0	0,00
	11.2023	\$ 10	EGP 387	1	0	1	0,02
	01.2024	0	7	0	0	0	0,00
	02.2024	EGP 188	\$ 5	0	0	0	0,00
SSB	07.2023	\$ 59	CLP 47.673	0	0	0	0,00
	08.2023	CLP 47.810	\$ 59	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 20	BRL 102	1	0	1	0,01
UAG	07.2023	COP 8.537	\$ 2	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 22	BRL 107	0	0	0	0,00
	07.2023	163	CZK 3.578	1	0	1	0,02
	07.2023	8	PLN 32	0	0	0	0,00
	07.2023	9	RON 40	0	0	0	0,00
	08.2023	9	CAD 12	0	0	0	0,00
	08.2023	2	COP 8.603	0	0	0	0,00
	08.2023	9	ZAR 160	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR 711	\$ 38	0	0	0	0,00
	09.2023	SGD 94	70	1	0	1	0,01
	09.2023	\$ 1	ILS 3	0	0	0	0,00
	09.2023	6	THB 216	0	0	0	0,00
	10.2023	16	ZAR 294	0	(1)	(1)	(0,01)
	04.2024	18	TRY 544	0	(1)	(1)	(0,01)
				\$ 150	\$ (132)	\$ 18	0,24
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 31	0,40

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Banco Davivienda S.A.			
13,501 % fällig am 13.12.2024	COP 33.000	\$ 8	0,10
15,389 % fällig am 21.02.2024	9.500	2	0,03
BanColombia S.A.			
5,917 % fällig am 27.01.2024	46.200	11	0,14
13,320 % fällig am 08.06.2025	17.000	4	0,05
13,637 % fällig am 14.12.2024	47.000	11	0,14
16,137 % fällig am 01.09.2024	18.000	4	0,05
BBVA Colombia S.A.			
5,870 % fällig am 15.07.2024	39.000	9	0,12
14,540 % fällig am 13.01.2024	18.800	5	0,07
Summe Einlagenzertifikate		\$ 54	0,70
Summe Anlagen		\$ 7.653	99,49
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 39	0,51
Nettovermögen		\$ 7.692	100,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Nullkuponwertpapier.  
 (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
 (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
 (d) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 39.143 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 60 USD (31. Dezember 2022: 39 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 7.580	\$ 0	\$ 7.580
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	19	0	19
Einlagen bei Kreditinstituten	0	18	36	54
<b>Summen</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 7.617</b>	<b>\$ 36</b>	<b>\$ 7.653</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.270	\$ 0	\$ 6.270
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	54	0	54
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	4	4
<b>Summen</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 6.324</b>	<b>\$ 4</b>	<b>\$ 6.328</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	14,700 %	22.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	HUF (36.928)	\$ (110)	(1,43)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (110)</b>	<b>(1,43)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (15)	\$ 0	\$ (15)	\$ 3	\$ 0	\$ 3
BPS	(5)	0	(5)	k. A.	k. A.	k. A.
BRC	(12)	0	(12)	33	0	33
CBK	11	0	11	26	0	26
GLM	73	(60)	13	30	0	30
GST	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(4)	0	(4)	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	(10)	0	(10)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(10)	0	(10)	(2)	0	(2)
RYL	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	1	0	1	(35)	0	(35)
SSB	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	85,31	69,10
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	13,24	24,21
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	1,57
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,16)	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,40	0,83
Einlagenzertifikate	0,70	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,43)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Chile	3,27	2,02
Kolumbien	3,86	3,54
Tschechische Republik	8,65	6,84
Dominikanische Republik	1,73	0,23
Deutschland	2,92	1,45
Ungarn	2,77	2,17
Indonesien	5,23	5,33
Israel	k. A.	2,52
Malaysia	9,65	8,58
Mexiko	8,10	5,26
Peru	4,51	2,20
Polen	5,13	2,47
Rumänien	2,62	4,38
Südafrika	6,66	10,65
Supranational	19,14	14,91
Thailand	6,66	4,28
Uruguay	1,19	1,12
Kurzfristige Instrumente	6,46	16,93
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,16)	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,23	0,09
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,08)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,01	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	k. A.	(0,09)
Zinsswaps	0,00	k. A.
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,24	0,83
Einlagenzertifikate	0,70	0,06
Sonstige Aktiva und Passiva	0,51	4,25
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond Fund

BESCHREIBUNG ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ALBANIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Albania Government International Bond 3,500 % fällig am 23.11.2031	€ 3.500	\$ 3.189	0,09
<b>ANGOLA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Angolan Government International Bond 8,250 % fällig am 09.05.2028 8,750 % fällig am 14.04.2032 9,500 % fällig am 12.11.2025	\$ 15.400 300 400	13.703 253 392	0,40 0,01 0,01
Summe Angola		14.348	0,42
<b>ARGENTINIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Argentina Government International Bond 0,500 % fällig am 09.07.2030 1,000 % fällig am 09.07.2029 1,500 % fällig am 09.07.2035 3,500 % fällig am 09.07.2041 3,875 % fällig am 09.01.2038	32.362 13.237 49.867 48.955 36.056	10.807 4.328 15.040 15.764 12.742	0,32 0,13 0,44 0,46 0,38
Provincia de Buenos Aires 5,250 % fällig am 01.09.2037	5.000	1.919	0,06
Provincia de Cordoba 6,875 % fällig am 10.12.2025 ^	1.909	1.441	0,04
Provincia de la Rioja 6,500 % fällig am 24.02.2028 ^	6.321	3.381	0,10
Provincia de Neuquen 6,625 % fällig am 27.04.2030 ^	2.210	1.570	0,05
Summe Argentinien		66.992	1,98
<b>ASERBAIDISCHAN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC 7,230 % fällig am 17.03.2026	12.500	12.219	0,36
Southern Gas Corridor CJSC 6,875 % fällig am 24.03.2026	25.700	26.152	0,77
		38.371	1,13
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Azerbaijan Government International Bond 4,750 % fällig am 18.03.2024	908	899	0,03
Summe Aserbaidschan		39.270	1,16
<b>BAHAMAS</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Bahamas Government International Bond 6,000 % fällig am 21.11.2028	14.900	12.032	0,36
<b>BAHRAIN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Bahrain Government International Bond 4,250 % fällig am 25.01.2028 5,625 % fällig am 30.09.2031	11.500 700	10.636 649	0,31 0,02
Summe Bahrain		11.285	0,33
<b>BENIN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Benin Government International Bond 4,875 % fällig am 19.01.2032	€ 4.150	3.447	0,10
<b>BRASILIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco do Brasil S.A. 3,250 % fällig am 30.09.2026	\$ 2.700	2.492	0,07
Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais 5,333 % fällig am 15.02.2028	21.945	21.556	0,64
CSN Inova Ventures 6,750 % fällig am 28.01.2028	15.800	14.673	0,43
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd. 0,000 % fällig am 31.07.2023 (d)(e)	14.563	38	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Vale S.A. 0,000 % (e)	BRL 188.860	\$ 12.039	0,36
		50.798	1,50
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Brazil Government International Bond 4,750 % fällig am 14.01.2050	\$ 4.700	3.472	0,10
Summe Brasilien		54.270	1,60
<b>KAMERUN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Republic of Cameroon Government International Bond 5,950 % fällig am 07.07.2032	€ 7.600	5.998	0,18
<b>KANADA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Frontier Energy Corp. 7,875 % fällig am 21.06.2028	\$ 1.300	949	0,03
<b>CAYMAN INSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AAC Technologies Holdings, Inc. 2,625 % fällig am 02.06.2026	4.600	4.032	0,12
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd. 0,000 % fällig am 05.06.2034 (d)	12.735	8.912	0,26
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,700 % fällig am 12.07.2026 3,125 % fällig am 22.10.2025 5,400 % fällig am 27.05.2025 6,150 % fällig am 17.09.2025	500 400 1.300 900	153 126 481 297	0,00 0,00 0,01 0,01
Gaci First Investment Co. 4,875 % fällig am 14.02.2035 5,000 % fällig am 13.10.2027 5,125 % fällig am 14.02.2053	1.300 22.200 15.600	1.248 22.131 14.060	0,04 0,65 0,42
Gran Tierra Energy International Holdings Ltd. 6,250 % fällig am 15.02.2025	500	429	0,01
ICD Funding Ltd. 3,223 % fällig am 28.04.2026	1.830	1.710	0,05
Interoceanica Finance Ltd. 0,000 % fällig am 30.11.2025 (d) 0,000 % fällig am 15.05.2030 (d) 7,860 % fällig am 15.05.2030	573 6.563 3.543	528 4.884 3.365	0,02 0,14 0,10
Kaisa Group Holdings Ltd. 8,500 % fällig am 30.06.2022 ^ 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^ 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ 11,250 % fällig am 09.04.2022 ^ 11,500 % fällig am 30.01.2023 ^ 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^ 11,950 % fällig am 12.11.2023 ^	600 4.100 3.200 1.100 200 3.300 2.600	40 273 214 74 13 221 211	0,00 0,01 0,01 0,00 0,00 0,01 0,01
KSA Sukuk Ltd. 5,268 % fällig am 25.10.2028	12.300	12.575	0,37
Lima Metro Line Finance Ltd. 4,350 % fällig am 05.04.2036 5,875 % fällig am 05.07.2034	360 1.037	319 1.009	0,01 0,03
New Metro Global Ltd. 4,500 % fällig am 02.05.2026 6,800 % fällig am 05.08.2023	3.400 200	1.437 195	0,04 0,01
Nogaholding Sukuk Ltd. 6,625 % fällig am 25.05.2033	3.700	3.699	0,11
Poinsettia Finance Ltd. 6,625 % fällig am 17.06.2031	12.125	10.020	0,30
Seazen Group Ltd. 4,450 % fällig am 13.07.2025	3.500	1.820	0,05
Sunac China Holdings Ltd. 6,500 % fällig am 10.01.2025 ^ 7,000 % fällig am 09.07.2025 ^ 7,250 % fällig am 14.06.2022 ^	8.500 4.700 900	1.285 711 134	0,04 0,02 0,00
Tencent Holdings Ltd. 3,840 % fällig am 22.04.2051	200	147	0,00
Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % fällig am 13.01.2026	3.900	3.557	0,11
Summe Cayman Inseln		100.310	2,96

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>CHILE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco del Estado de Chile 2,704 % fällig am 09.01.2025	\$ 4.300	\$ 4.116	0,12
Banco Santander Chile 2,700 % fällig am 10.01.2025	5.200	4.977	0,15
Corp. Nacional del Cobre de Chile 3,625 % fällig am 01.08.2027 4,500 % fällig am 01.08.2047 4,875 % fällig am 04.11.2044 (i) 5,125 % fällig am 02.02.2033 6,150 % fällig am 24.10.2036	6.700 3.200 5.600 2.800 1.000	6.331 2.734 5.062 2.764 1.088	0,19 0,08 0,15 0,08 0,03
Embotelladora Andina S.A. 3,950 % fällig am 21.01.2050	3.900	3.040	0,09
Empresa de los Ferrocarriles del Estado 3,068 % fällig am 18.08.2050 3,830 % fällig am 14.09.2061	1.500 7.000	918 4.777	0,03 0,14
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A. 3,650 % fällig am 07.05.2030	1.600	1.468	0,04
Empresa Nacional del Petroleo 3,450 % fällig am 16.09.2031 4,500 % fällig am 14.09.2047 6,300 % fällig am 10.05.2033	8.700 3.000 6.300	7.291 2.260 6.297	0,21 0,07 0,19
GNL Quintero S.A. 4,634 % fällig am 31.07.2029	7.113	6.922	0,20
		60.045	1,77
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Chile Government International Bond 3,250 % fällig am 21.09.2071 3,625 % fällig am 30.10.2042 (i) 4,340 % fällig am 07.03.2042 (i) 4,950 % fällig am 05.01.2036 (a) 5,330 % fällig am 05.01.2054 (a)	11.900 2.000 13.000 3.000 1.600	7.750 1.623 11.573 2.965 1.592	0,23 0,05 0,34 0,09 0,04
		25.503	0,75
Summe Chile		85.548	2,52
<b>CHINA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	4.700	99	0,00
ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd. 3,125 % fällig am 16.07.2025	9.500	8.407	0,25
Summe China		8.506	0,25
<b>KOLUMBIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Davivienda S.A. 6,650 % fällig am 22.04.2031 (e)(g)	900	663	0,02
Ecopetrol S.A. 4,625 % fällig am 02.11.2031 5,375 % fällig am 26.06.2026 5,875 % fällig am 28.05.2045 6,875 % fällig am 29.04.2030 7,375 % fällig am 18.09.2043	9.800 2.200 3.100 200 2.400	7.574 2.107 2.127 183 2.004	0,22 0,06 0,06 0,01 0,06
		14.658	0,43
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Colombia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.04.2031 3,875 % fällig am 15.02.2061 (i) 4,125 % fällig am 15.05.2051 4,500 % fällig am 28.01.2026 4,500 % fällig am 15.03.2029 5,000 % fällig am 15.06.2045 5,200 % fällig am 15.05.2049 5,625 % fällig am 26.02.2044 7,375 % fällig am 18.09.2037 7,500 % fällig am 02.02.2034	15.507 13.000 13.700 5.600 400 3.400 12.700 4.800 1.400 10.200	11.731 7.310 8.233 5.345 351 2.375 6.757 3.586 1.334 10.000	0,35 0,21 0,24 0,16 0,01 0,07 0,26 0,11 0,04 0,29
		59.022	1,74
Summe Kolumbien		73.680	2,17
<b>COSTA RICA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Costa Rica Government International Bond 5,625 % fällig am 30.04.2043	3.000	2.585	0,08

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>				<b>GABUN</b>				<b>INDIEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik				Gabon Government International Bond				NTPC Ltd.				
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP	48.600	\$ 924	6,625 % fällig am 06.02.2031	\$	400	\$ 319	3,750 % fällig am 03.04.2024	2.000	1.967	0,06	
13,000 % fällig am 05.12.2025		787.600	15.365	7,000 % fällig am 24.11.2031	400	319	0,01	Reliance Industries Ltd.				
13,000 % fällig am 30.01.2026		292.600	5.724	Summe Gabun		638	0,02	2,875 % fällig am 12.01.2032	2.400	2.003	0,06	
<b>Dominican Republic Government International Bond</b>				<b>GEORGIEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
4,875 % fällig am 23.09.2032	\$	6.200	5.293	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Export-Import Bank of India				
5,300 % fällig am 21.01.2041		7.700	6.052	Georgian Railway JSC				3,375 % fällig am 05.08.2026	600	565	0,01	
5,500 % fällig am 27.01.2025		9.600	9.461	4,000 % fällig am 17.06.2028	300	260	0,01	3,875 % fällig am 12.03.2024	4.100	4.035	0,12	
5,500 % fällig am 22.02.2029		17.500	16.418	<b>GHANA</b>				Summe Ungarn		71.280	2,10	
5,875 % fällig am 30.01.2060		7.650	5.947	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>INDIEN</b>				
5,950 % fällig am 25.01.2027		15.000	14.739	Ghana Government International Bond				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
6,000 % fällig am 19.07.2028		12.400	12.116	6,375 % fällig am 11.02.2027	11.100	4.817	0,14	NTPC Ltd.				
6,000 % fällig am 22.02.2033		10.800	9.987	7,625 % fällig am 16.05.2029	800	345	0,01	3,750 % fällig am 03.04.2024	2.000	1.967	0,06	
6,400 % fällig am 05.06.2049		250	214	7,750 % fällig am 07.04.2029	7.600	3.272	0,09	Reliance Industries Ltd.				
6,875 % fällig am 29.01.2026		6.400	6.462	7,875 % fällig am 11.02.2035	4.029	1.763	0,05	2,875 % fällig am 12.01.2032	2.400	2.003	0,06	
7,450 % fällig am 30.04.2044		100	98	8,125 % fällig am 26.03.2032	6.100	2.636	0,08	Summe Indien		8.570	0,25	
13,625 % fällig am 03.02.2033	DOP	631.800	14.206	8,625 % fällig am 07.04.2034	8.500	3.662	0,11	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
13,625 % fällig am 10.02.2034		489.000	11.168	8,750 % fällig am 11.03.2061	1.750	729	0,02	Export-Import Bank of India				
Summe Dominikanische Republik		134.174	3,96	8,875 % fällig am 07.05.2042	1.600	662	0,02	3,375 % fällig am 05.08.2026	600	565	0,01	
<b>ECUADOR</b>				<b>GUATEMALA</b>				<b>INDONESIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Ecuador Social Bond S.A.R.L.				Guatemala Government International Bond				Indonesia Asahan Aluminium PT				
0,000 % fällig am 30.01.2035 (d)	\$	856	651	4,375 % fällig am 05.06.2027	8.600	8.152	0,24	5,450 % fällig am 15.05.2030	8.000	7.764	0,23	
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Ecuador Government International Bond				4,500 % fällig am 03.05.2026	6.900	6.605	0,19	5,800 % fällig am 15.05.2050	3.000	2.650	0,08	
0,000 % fällig am 31.07.2030 (d)		5.332	1.551	4,650 % fällig am 07.10.2041	800	642	0,02	LLPL Capital Pte. Ltd.				
1,500 % fällig am 31.07.2040		22.463	7.043	4,875 % fällig am 13.02.2028	7.120	6.790	0,20	6,875 % fällig am 04.02.2039	910	818	0,02	
2,500 % fällig am 31.07.2035		22.231	7.779	5,375 % fällig am 24.04.2032	300	286	0,01	Pelabuhan Indonesia Persero PT				
5,500 % fällig am 31.07.2030		16.626	8.083	6,600 % fällig am 13.06.2036	7.400	7.455	0,22	4,250 % fällig am 05.05.2025	6.500	6.344	0,19	
Summe Ecuador		24.456	0,72	Summe Guatemala		29.930	0,88	4,875 % fällig am 01.10.2024	3.100	3.072	0,09	
<b>ÄGYPTEN</b>				<b>HONGKONG</b>				<b>INDONESIEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Egypt Government International Bond				AIA Group Ltd.				1,400 % fällig am 09.02.2026	600	543	0,01	
5,250 % fällig am 06.10.2025		6.000	4.583	3,200 % fällig am 16.09.2040	900	691	0,02	4,175 % fällig am 21.01.2050	5.000	3.951	0,12	
5,625 % fällig am 16.04.2030	€	5.370	3.262	Fortune Star BVI Ltd.				5,625 % fällig am 20.05.2043	1.800	1.737	0,05	
5,875 % fällig am 16.02.2031	\$	5.900	3.264	3,950 % fällig am 02.10.2026	€	3.000	2.258	6,000 % fällig am 03.05.2042	21.100	21.238	0,63	
6,375 % fällig am 11.04.2031	€	9.100	5.542	5,000 % fällig am 18.05.2026	\$	200	150	6,450 % fällig am 30.05.2044	12.400	12.894	0,38	
6,875 % fällig am 30.04.2040 (i)	\$	3.100	1.691	5,050 % fällig am 27.01.2027	1.300	900	0,03	6,500 % fällig am 07.11.2048	9.500	9.892	0,29	
7,053 % fällig am 15.01.2032		7.300	4.158	6,850 % fällig am 02.07.2024	2.200	1.986	0,06	Perusahaan Perseroan Persero PT				
7,300 % fällig am 30.09.2033		15.700	8.687	Huarong Finance Co. Ltd.				4,000 % fällig am 30.06.2050	16.800	12.024	0,35	
7,500 % fällig am 16.02.2061		2.600	1.311	3,875 % fällig am 13.11.2029	300	232	0,01	4,125 % fällig am 15.05.2027	6.300	6.006	0,18	
7,625 % fällig am 29.05.2032		11.100	6.477	4,500 % fällig am 29.05.2029	3.650	2.929	0,08	4,375 % fällig am 05.02.2050	2.900	2.185	0,06	
7,903 % fällig am 21.02.2048		19.700	10.171	5,000 % fällig am 19.11.2025	3.700	3.417	0,10	5,250 % fällig am 24.10.2042	2.300	2.055	0,06	
8,150 % fällig am 20.11.2059		2.100	1.093	5,500 % fällig am 16.01.2025	200	190	0,01	5,250 % fällig am 15.05.2047	8.400	7.382	0,22	
8,500 % fällig am 31.01.2047		9.000	4.805	Summe Hongkong		38.332	1,13	6,150 % fällig am 21.05.2048	2.700	2.613	0,08	
8,875 % fällig am 29.05.2050		12.300	6.662	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				6,250 % fällig am 25.01.2049	7.800	7.689	0,23	
Summe Ägypten		61.706	1,82	Airport Authority Hong Kong				Summe Indonesien		142.992	4,22	
<b>EL SALVADOR</b>				<b>UNGARN</b>				<b>INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
El Salvador Government International Bond				MVM Energetika Zrt				Project Mercury				
6,375 % fällig am 18.01.2027		1.100	773	7,500 % fällig am 09.06.2028	\$	5.600	5.591	TBD % fällig am 17.07.2030	€	6.700	7.310	0,21
7,125 % fällig am 20.01.2050		12.707	7.102	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Staatliche Energiegesellschaft der Republik Aserbaidschan				
7,625 % fällig am 21.09.2034		3.800	2.225	Ungarische Entwicklungsbank				TBD % fällig am 26.11.2024	\$	1.000	975	0,03
7,625 % fällig am 01.02.2041		530	304	6,500 % fällig am 29.06.2028	15.300	15.174	0,45	Summe International		8.285	0,24	
7,650 % fällig am 15.06.2035		200	119	Hungary Government International Bond				<b>INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
8,250 % fällig am 10.04.2032		2.610	1.691	0,500 % fällig am 18.11.2030	€	800	637	Project Mercury				
8,625 % fällig am 28.02.2029		185	124	1,625 % fällig am 28.04.2032	1.418	1.178	0,03	TBD % fällig am 17.07.2030	€	6.700	7.310	0,21
9,500 % fällig am 15.07.2052		1.400	888	2,125 % fällig am 22.09.2031	\$	2.700	2.093	Staatliche Energiegesellschaft der Republik Aserbaidschan				
Summe El Salvador		13.226	0,39	Summe Ungarn		638	0,02	TBD % fällig am 26.11.2024	\$	1.000	975	0,03
<b>ÄTHIOPIEN</b>				<b>UNGARN</b>				<b>INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
Ethiopia Government International Bond				MVM Energetika Zrt				Project Mercury				
6,625 % fällig am 11.12.2024		3.300	2.289	7,500 % fällig am 09.06.2028	\$	5.600	5.591	TBD % fällig am 17.07.2030	€	6.700	7.310	0,21
<b>ÄTHIOPIEN</b>				<b>UNGARN</b>				<b>INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
Ethiopia Government International Bond				MVM Energetika Zrt				Project Mercury				
6,625 % fällig am 11.12.2024		3.300	2.289	7,500 % fällig am 09.06.2028	\$	5.600	5.591	TBD % fällig am 17.07.2030	€	6.700	7.310	0,21

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>IRLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC 5,950 % fällig am 15.04.2030 ^(g)	\$ 6.600	\$ 396	0,01
Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC 6,927 % fällig am 19.02.2027	22.646	21.287	0,63
Russian Railways Via RZD Capital PLC 7,487 % fällig am 25.03.2031 ^	£ 500	494	0,01
Saderea DAC 12,500 % fällig am 30.11.2026 ^	\$ 6.199	2.635	0,08
Summe Irland		24.812	0,73
<b>ISRAEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bank Hapoalim B.M. 3,255 % fällig am 21.01.2032 (g)	9.900	8.511	0,25
Israel Electric Corp. Ltd. 4,250 % fällig am 14.08.2028	5.400	5.041	0,15
5,000 % fällig am 12.11.2024	200	198	0,01
Leviathan Bond Ltd. 6,125 % fällig am 30.06.2025	2.100	2.058	0,06
6,500 % fällig am 30.06.2027	6.800	6.528	0,19
		22.336	0,66
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023 ILS	23.700	6.363	0,19
1,500 % fällig am 30.11.2023	149.700	39.832	1,17
		46.195	1,36
Summe Israel		68.531	2,02
<b>ELFENBEINKÜSTE</b>			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
Eifenbeinküste 7,985 % fällig am 19.03.2027	€ 3.440	3.659	0,11
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ivory Coast Government International Bond 4,875 % fällig am 30.01.2032	6.700	5.710	0,17
5,250 % fällig am 22.03.2030	500	462	0,01
5,875 % fällig am 17.10.2031	2.400	2.198	0,06
6,625 % fällig am 22.03.2048	300	233	0,01
		8.603	0,25
Summe Eifenbeinküste		12.262	0,36
<b>JAMAICA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
TransJamaican Highway Ltd. 5,750 % fällig am 10.10.2036	\$ 3.273	2.706	0,08
<b>JAPAN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,063 % fällig am 12.09.2025	16.500	16.308	0,48
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Corsair International Ltd. 7,772 % fällig am 28.01.2027	€ 15.900	17.260	0,51
8,122 % fällig am 28.01.2029	6.900	7.472	0,22
Summe Jersey, Kanalinseln		24.732	0,73
<b>JORDANIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Jordan Government International Bond 4,950 % fällig am 07.07.2025	\$ 2.200	2.134	0,06
5,750 % fällig am 31.01.2027	13.200	12.705	0,38
5,850 % fällig am 07.07.2030	2.100	1.930	0,06
6,125 % fällig am 29.01.2026	6.250	6.144	0,18
7,375 % fällig am 10.10.2047	700	605	0,02
7,500 % fällig am 13.01.2029	6.100	6.149	0,18
Summe Jordanien		29.667	0,88

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>KASACHSTAN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
KazMunayGas National Co. JSC 3,500 % fällig am 14.04.2033	\$ 1.300	\$ 1.010	0,03
4,750 % fällig am 19.04.2027	16.600	15.781	0,47
5,375 % fällig am 24.04.2030	1.200	1.116	0,03
5,750 % fällig am 19.04.2047	15.490	12.639	0,37
6,375 % fällig am 24.10.2048	4.300	3.686	0,11
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd. 3,250 % fällig am 15.08.2030	5.400	4.136	0,12
Summe Kasachstan		38.368	1,13
<b>KENIA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Kenya Government International Bond 6,875 % fällig am 24.06.2024	3.750	3.576	0,11
8,000 % fällig am 22.05.2032	1.300	1.102	0,03
Summe Kenia		4.678	0,14
<b>LIBANON</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Lebanon Government International Bond 8,250 % fällig am 17.05.2034 ^	9.700	653	0,02
<b>AKTIEN</b>			
<b>LUXEMBURG</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
DrillCo Holding Lux S.A. (c)	143.033	2.746	0,08
DrillCo Holding Lux S.A. (c)(h)	364.034	6.989	0,21
Summe Stammaktien		\$ 9.735	0,29
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Constellation Oil Services Holding S.A. 13,500 % fällig am 30.06.2025	\$ 1.704	1.682	0,05
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)			
3,000 % fällig am 31.12.2026	3.855	2.281	0,07
(b)			
FORESEA Holding S.A. 7,500 % fällig am 15.06.2030	6.316	5.578	0,16
Greensaif Pipelines Bidco SARL 6,129 % fällig am 23.02.2038	4.700	4.808	0,14
6,510 % fällig am 23.02.2042	4.600	4.787	0,14
Guara Norte SARL 5,198 % fällig am 15.06.2034	12.380	10.854	0,32
Petrorio Luxembourg Trading SARL 6,125 % fällig am 09.06.2026	7.100	6.827	0,20
TMS Issuer SARL 5,780 % fällig am 23.08.2032	6.600	6.809	0,20
Unigel Luxembourg S.A. 8,750 % fällig am 01.10.2026	3.900	1.282	0,04
		44.908	1,32
Summe Luxemburg		54.643	1,61
<b>MAZEDONIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
North Macedonia Government International Bond 6,960 % fällig am 13.03.2027	€ 7.600	8.475	0,25
<b>MALAYSIA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Axiata SPV2 Bhd. 2,163 % fällig am 19.08.2030	\$ 1.900	1.616	0,05
Khazanah Capital Ltd. 4,876 % fällig am 01.06.2033	6.100	6.043	0,18
Khazanah Global Sukuk Bhd. 4,687 % fällig am 01.06.2028	8.200	8.094	0,24
Petronas Capital Ltd. 4,500 % fällig am 18.03.2045	500	460	0,01
4,550 % fällig am 21.04.2050	9.700	8.919	0,26
		25.132	0,74

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023 MYR	107.200	\$ 22.986	0,68
Summe Malaysia		48.118	1,42
<b>MAURITIUS</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026	\$ 200	188	0,01
<b>AKTIEN</b>			
<b>MEXIKO</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
Hipotecaria Su Casita S.A. (c)	39.443	0	0,00
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (c)	2.622	1	0,00
Summe Stammaktien		1	0,00
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Mercantil del Norte S.A. 6,625 % fällig am 24.01.2032 (e)(g)	\$ 4.100	3.173	0,09
6,750 % fällig am 27.09.2024 (e)(g)	3.000	2.885	0,09
7,500 % fällig am 27.06.2029 (e)(g)	5.400	4.694	0,14
Comision Federal de Electricidad 6,264 % fällig am 15.02.2052	5.700	4.807	0,14
Corp. GEO S.A.B. de C.V. 8,875 % fällig am 25.09.2014 ^	13.920	0	0,00
9,250 % fällig am 30.06.2020 ^	1.000	0	0,00
Industrias Penoles S.A.B. de C.V. 4,750 % fällig am 06.08.2050	3.900	3.109	0,09
Petroleos Mexicanos 3,625 % fällig am 24.11.2025	€ 1.400	1.398	0,04
4,875 % fällig am 21.02.2028	1.300	1.178	0,04
5,812 % fällig am 24.08.2023	6.500	7.069	0,21
6,350 % fällig am 12.02.2048	\$ 30.367	18.396	0,54
6,500 % fällig am 02.06.2041	2.000	1.272	0,04
6,625 % fällig am 15.06.2035	9.350	6.528	0,19
6,625 % fällig am 15.06.2038	200	134	0,00
6,700 % fällig am 16.02.2032	12.558	9.560	0,28
6,750 % fällig am 21.09.2047	17.180	10.804	0,32
6,840 % fällig am 23.01.2030	278	221	0,01
6,950 % fällig am 28.01.2060	29.647	18.515	0,55
7,690 % fällig am 23.01.2050	66.636	45.222	1,33
10,000 % fällig am 07.02.2033	1.000	917	0,03
10,000 % fällig am 07.02.2033 (i)	8.950	8.206	0,24
Sitios Latinoamerica S.A.B. de C.V. 5,375 % fällig am 04.04.2032 (i)	7.250	6.573	0,19
		154.661	4,56
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Mexico Government International Bond 3,750 % fällig am 19.04.2071	9.200	6.160	0,18
3,771 % fällig am 24.05.2061	15.400	10.509	0,31
5,000 % fällig am 27.04.2051 (i)	14.100	12.261	0,36
5,400 % fällig am 09.02.2028	9.500	9.683	0,29
5,750 % fällig am 12.10.2110	43.450	38.884	1,15
6,338 % fällig am 04.05.2053	8.685	8.869	0,26
6,350 % fällig am 09.02.2035	16.400	17.282	0,51
		103.648	3,06
Summe Mexiko		258.310	7,62
<b>MAROKKO</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
OCP S.A. 3,750 % fällig am 23.06.2031	10.850	9.001	0,27
5,125 % fällig am 23.06.2051	4.300	3.144	0,09
Summe Marokko		12.145	0,36





## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>SENEGAL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Senegal Government International Bond			
4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 3.400	\$ 3.204	0,09
5,375 % fällig am 08.06.2037	6.300	4.614	0,13
6,250 % fällig am 23.05.2033	\$ 7.950	6.676	0,20
6,750 % fällig am 13.03.2048	800	575	0,02
Summe Senegal		15.069	0,44
<b>SERBIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Serbia Government International Bond			
1,000 % fällig am 23.09.2028	€ 1.500	1.270	0,04
1,500 % fällig am 26.06.2029	7.400	6.250	0,19
1,650 % fällig am 03.03.2033	14.500	10.557	0,31
2,050 % fällig am 23.09.2036	4.100	2.751	0,08
3,125 % fällig am 15.05.2027	2.700	2.650	0,08
6,500 % fällig am 26.09.2033	\$ 11.450	11.257	0,33
Summe Serbien		34.735	1,03
<b>SINGAPUR</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Flex Ltd.			
4,875 % fällig am 15.06.2029	1.300	1.244	0,04
Medco Bell Pte. Ltd.			
6,375 % fällig am 30.01.2027	8.400	7.871	0,23
Singapore Airlines Ltd.			
3,375 % fällig am 19.01.2029	9.800	9.009	0,27
Summe Singapur		18.124	0,54
<b>SÜDAFRIKA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AngloGold Ashanti Holdings PLC			
3,750 % fällig am 01.10.2030	3.600	3.093	0,09
6,500 % fällig am 15.04.2040	200	202	0,01
Entwicklungsbank für das südliche Afrika			
8,600 % fällig am 21.10.2024	ZAR 467.300	24.311	0,72
(h)			
Eskom Holdings SOC Ltd.			
4,314 % fällig am 23.07.2027	\$ 13.650	12.098	0,36
6,350 % fällig am 10.08.2028	14.400	13.447	0,39
6,750 % fällig am 06.08.2023	400	399	0,01
8,450 % fällig am 10.08.2028	13.200	12.573	0,37
Sasol Financing USA LLC			
5,875 % fällig am 27.03.2024	5.815	5.745	0,17
8,750 % fällig am 03.05.2029	8.300	8.094	0,24
		79.962	2,36
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
South Africa Government International Bond			
4,300 % fällig am 12.10.2028	2.400	2.126	0,06
4,850 % fällig am 30.09.2029	11.100	9.786	0,29
5,000 % fällig am 12.10.2046	10.200	6.813	0,20
5,375 % fällig am 24.07.2044	400	285	0,01
5,750 % fällig am 30.09.2049	6.400	4.546	0,13
7,300 % fällig am 20.04.2052	5.300	4.469	0,13
10,500 % fällig am 21.12.2026 (i)	ZAR 798.000	43.870	1,30
10,500 % fällig am 21.12.2026	123.000	6.762	0,20
		78.657	2,32
Summe Südafrika		158.619	4,68
<b>SÜDKOREA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Kodit Global Co. Ltd.			
4,954 % fällig am 25.05.2026	\$ 1.700	1.674	0,05
SK on Co. Ltd.			
5,375 % fällig am 11.05.2026	4.900	4.861	0,14
		6.535	0,19
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Korea National Oil Corp.			
4,875 % fällig am 03.04.2028	16.100	15.951	0,47
Summe Südkorea		22.486	0,66

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>SPANIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Santander S.A.			
5,147 % fällig am 18.08.2025	\$ 13.600	\$ 13.364	0,39
<b>SRI LANKA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Sri Lanka Government International Bond			
5,750 % fällig am 18.04.2023 ^	8.170	3.727	0,11
5,875 % fällig am 25.07.2022 ^	2.050	954	0,03
6,125 % fällig am 03.06.2025 ^	5.100	2.433	0,07
6,200 % fällig am 11.05.2027 ^	8.700	4.005	0,12
6,350 % fällig am 28.06.2024 ^	500	230	0,01
6,825 % fällig am 18.07.2026 ^	1.200	569	0,01
6,850 % fällig am 14.03.2024 ^	200	92	0,00
6,850 % fällig am 03.11.2025 ^	6.500	3.097	0,09
7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	18.400	8.471	0,25
7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	4.200	1.934	0,06
Summe Sri Lanka		25.512	0,75
<b>SUPRANATIONAL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Eastern & Southern African Trade & Development Bank			
4,125 % fällig am 30.06.2028	8.300	6.553	0,19
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ghana Government International Bond			
10,750 % fällig am 14.10.2030 ^	1.050	710	0,02
Summe Supranational		7.263	0,21
<b>SCHWEIZ</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Credit Suisse AG			
4,750 % fällig am 09.08.2024	6.000	5.866	0,18
UBS Group AG			
2,593 % fällig am 11.09.2025	1.100	1.049	0,03
6,373 % fällig am 15.07.2026	4.500	4.473	0,13
Summe Schweiz		11.388	0,34
<b>TANSANIA</b>			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania			
9,048 % fällig am 26.04.2028	€ 11.182	12.032	0,36
<b>THAILAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bangkok Bank PCL			
3,733 % fällig am 25.09.2034	\$ 800	679	0,02
(g)			
PTTEP Treasury Center Co. Ltd.			
2,587 % fällig am 10.06.2027	1.300	1.183	0,04
Summe Thailand		1.862	0,06
<b>TUNESIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Banque Centrale de Tunisie Government International Bond			
3,280 % fällig am 09.08.2027	200.000	0	0,02
5,625 % fällig am 17.02.2024	€ 4.100	3.721	0,11
5,750 % fällig am 30.01.2025 (i)	\$ 2.800	1.873	0,06
6,750 % fällig am 31.10.2023	€ 1.700	1.727	0,05
Summe Tunesien		7.979	0,24
<b>TÜRKEI</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Turkish Airlines Pass-Through Trust			
4,200 % fällig am 15.09.2028	\$ 4.518	4.163	0,12
Türkiye İş Bankası A/S			
6,125 % fällig am 25.04.2024	2.200	2.161	0,06
Yapı ve Kredi Bankası A/S			
5,858 % fällig am 21.06.2024	600	585	0,02
		6.909	0,20

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
SOCAR Turkey Enerji A/S			
6,553 % fällig am 11.08.2026	€ 19.884	\$ 21.043	0,62
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Export-Credit Bank of Turkey			
5,750 % fällig am 06.07.2026	\$ 3.500	3.170	0,09
Turkey Government International Bond			
4,875 % fällig am 09.10.2026	6.000	5.368	0,16
4,875 % fällig am 16.04.2043	7.500	4.833	0,14
5,125 % fällig am 17.02.2028	22.300	19.448	0,57
5,750 % fällig am 11.05.2047	59.500	40.807	1,21
5,950 % fällig am 15.01.2031	22.000	18.614	0,55
6,000 % fällig am 14.01.2041	18.635	13.772	0,41
6,125 % fällig am 24.10.2028	5.200	4.659	0,14
6,875 % fällig am 17.03.2036	17.970	15.255	0,45
9,125 % fällig am 13.07.2030	12.000	11.925	0,35
9,875 % fällig am 15.01.2028	10.900	11.130	0,33
Summe Türkei		176.933	5,22
<b>UKRAINE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
NPC Ukrenerg			
6,875 % fällig am 09.11.2028 ^	7.800	1.677	0,05
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ukraine Government International Bond			
4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	€ 5.200	1.240	0,04
6,876 % fällig am 21.05.2031 ^	\$ 2.400	554	0,02
7,253 % fällig am 15.03.2035 ^	11.139	2.596	0,08
7,375 % fällig am 25.09.2034 ^	5.020	1.178	0,03
7,750 % fällig am 01.09.2028 ^	5.000	1.218	0,03
7,750 % fällig am 01.09.2027 ^	6.000	1.448	0,04
		8.234	0,24
Summe Ukraine		9.911	0,29
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC			
3,650 % fällig am 02.11.2029	4.200	3.979	0,12
4,600 % fällig am 02.11.2047	5.600	5.209	0,15
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC			
4,375 % fällig am 24.01.2029	6.500	6.430	0,19
4,696 % fällig am 24.04.2033	5.500	5.476	0,16
DP World Ltd.			
4,700 % fällig am 30.09.2049	1.800	1.524	0,04
5,625 % fällig am 25.09.2048	3.475	3.253	0,09
6,850 % fällig am 02.07.2037	4.880	5.297	0,16
First Abu Dhabi Bank PJSC			
4,774 % fällig am 06.06.2028	9.100	9.026	0,27
Kuwait Projects Co. SPC Ltd.			
4,500 % fällig am 23.02.2027	4.000	3.411	0,10
MDGH GMTN RSC Ltd.			
3,950 % fällig am 21.05.2050	1.600	1.334	0,04
5,084 % fällig am 22.05.2053	2.700	2.690	0,08
		47.629	1,40
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
NMC OpCo Ltd.			
11,255 % fällig am 25.03.2027	AED 36.775	10.112	0,30
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond			
3,125 % fällig am 30.09.2049	\$ 900	661	0,02
3,875 % fällig am 16.04.2050	14.500	12.226	0,36
Emirate of Dubai Government International Bond			
3,900 % fällig am 09.09.2050	1.700	1.234	0,04
Finanzministerium der Regierung von Schardscha			
4,000 % fällig am 28.07.2050	9.000	5.784	0,17
		19.905	0,59
Summe Vereinigte Arabische Emirate		77.646	2,29

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>AKTIEN</b>				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAMMAKTIVEN</b>				<b>US-SCHATZOBЛИGATIONEN</b>			
<b>ENERGIE</b>				<b>ENERGIE</b>				<b>US-TREASURY BONDS</b>			
Antofagasta PLC				Constellation Oil Services				1,750 % fällig am 15.08.2041			
2,375 % fällig am 14.10.2030	\$	2.200	1.795	0,05	4.243.669	460	0,01	2,375 % fällig am 15.02.2042			
Barclays PLC				0,01				3,250 % fällig am 15.05.2042	113.500	101.339	2,99
5,304 % fällig am 09.08.2026		8.400	8.197	0,24				3,375 % fällig am 15.08.2042	17.800	16.165	0,48
HSBC Holdings PLC				0,01				<b>U.S. Treasury Notes</b>			
3,973 % fällig am 22.05.2030		400	360	0,01				2,375 % fällig am 15.05.2029	7.900	7.205	0,21
Lloyds Banking Group PLC				0,11				2,625 % fällig am 31.07.2029	30.000	27.719	0,82
4,716 % fällig am 11.08.2026		3.700	3.597	0,11				3,125 % fällig am 31.08.2029	52.000	49.400	1,46
NatWest Group PLC				0,10				4,000 % fällig am 28.02.2030 (i)	33.100	33.082	0,97
2,875 % fällig am 19.09.2026	£	400	461	0,01							
4,269 % fällig am 22.03.2025	\$	200	197	0,01				<b>AKTIEN</b>			
4,800 % fällig am 05.04.2026		1.100	1.068	0,03				<b>OPTIONSSCHEINE</b>			
5,076 % fällig am 27.01.2030		200	191	0,01				Constellation Oil Services			
Santander UK Group Holdings PLC				0,03				Holding S.A. 'D' -			
6,833 % fällig am 21.11.2026		900	903	0,03				Exp. 10.06.2071 (h)	5	0	0,00
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC				0,18				Summe USA			
8,250 % fällig am 09.07.2026 ^		16.100	6.198	0,18							
UKreximbank Via Biz Finance PLC				0,04							
9,750 % fällig am 22.01.2025		1.458	1.275	0,04							
			24.242	0,72							
<b>NON-AGENCY-MBS</b>											
Canada Square Funding PLC				0,10				<b>US-BEKISTAN</b>			
5,316 % fällig am 17.01.2059	£	2.749	3.475	0,10				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Formentera Issuer PLC				0,01				Uzbekistan Government International Bond			
5,357 % fällig am 28.07.2047		154	194	0,01				3,700 % fällig am 25.11.2030	\$	200	162
Polaris PLC				0,01				3,900 % fällig am 19.10.2031	8.400	6.773	0,20
6,154 % fällig am 27.05.2057		322	409	0,01				Summe Usbekistan			6.935
Rochester Financing PLC				0,11							
5,602 % fällig am 18.12.2044		2.951	3.707	0,11							
Stratton Mortgage Funding PLC				0,02							
5,765 % fällig am 12.03.2052		691	876	0,02							
Towd Point Mortgage Funding PLC				0,03							
5,841 % fällig am 20.07.2045		705	897	0,03							
6,097 % fällig am 20.05.2045		1.138	1.442	0,04							
6,546 % fällig am 20.02.2054		2.386	3.034	0,09							
Tower Bridge Funding PLC				0,07							
5,629 % fällig am 20.12.2063		1.910	2.417	0,07							
Warwick Finance Residential Mortgages PLC				0,02							
0,000 % fällig am 21.12.2049 (d)		0	596	0,02							
5,865 % fällig am 21.12.2049		3.311	4.190	0,12							
6,564 % fällig am 21.12.2049		735	926	0,03							
7,064 % fällig am 21.12.2049		367	460	0,01							
7,564 % fällig am 21.12.2049		210	262	0,01							
8,064 % fällig am 21.12.2049		210	258	0,01							
			23.143	0,68							
Summe Großbritannien			47.385	1,40							
<b>USA</b>											
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>US-SCHATZOBЛИGATIONEN</b>			
Aaems Mortgage Investment Trust				0,08				Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc.			
5,630 % fällig am 25.04.2036	\$	2.964	2.636	0,08				4,407 % fällig am 15.11.2061	3.700	3.517	0,10
Argent Securities Trust				0,02				Banc of America Mortgage Trust			
5,450 % fällig am 25.07.2036		942	803	0,02				3,896 % fällig am 25.02.2036 ^	4	4	0,00
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				0,01				BCAP LLC Trust			
5,630 % fällig am 25.05.2035		446	402	0,01				3,676 % fällig am 26.05.2037	3.503	3.158	0,09
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				0,04				Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
5,630 % fällig am 25.02.2037		1.539	1.481	0,04				3,887 % fällig am 25.05.2047 ^	84	75	0,00
6,275 % fällig am 25.11.2035		3.657	3.556	0,10				4,033 % fällig am 25.01.2035	4	4	0,00
GSAA Home Equity Trust				0,01				Bear Stearns ALT-A Trust			
5,590 % fällig am 25.05.2047		723	456	0,01				4,195 % fällig am 25.05.2035	61	57	0,00
5,630 % fällig am 25.11.2036		259	92	0,00				Benchmark Mortgage Trust			
6,502 % fällig am 25.11.2036		868	346	0,01				3,666 % fällig am 15.01.2051	1.700	1.556	0,05
Home Equity Asset Trust				0,01				4,261 % fällig am 10.10.2051	4.800	4.435	0,13
6,500 % fällig am 25.02.2033		218	203	0,01				Citigroup Mortgage Loan Trust			
Humboldt Americas LLC				0,14				3,974 % fällig am 25.09.2037 ^	169	149	0,00
0,000 % fällig am 31.07.2022	COP	20.000.000	4.722	0,14				CitiMortgage Alternative Loan Trust			
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				0,00				5,800 % fällig am 25.10.2036	1.016	848	0,03
5,420 % fällig am 25.08.2036	\$	100	89	0,00				Countrywide Alternative Loan Trust			
Lehman XS Trust				0,06				5,500 % fällig am 25.05.2036 ^	1.025	420	0,01
5,058 % fällig am 25.01.2036 ^		2.078	1.930	0,06				5,797 % fällig am 20.12.2035	591	552	0,02
								Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
								3,573 % fällig am 20.05.2036 ^	85	78	0,00
								3,884 % fällig am 25.11.2037	434	397	0,01
								Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust			
								5,590 % fällig am 25.11.2034	197	186	0,01

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>VENEZUELA</b>				<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Petroleos de Venezuela S.A.				CLP Power Hong Kong Financing Ltd.				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (f)			
5,375 % fällig am 12.04.2027 ^	\$ 73.690	\$ 2.601	0,08	2,125 % fällig am 30.06.2030	\$ 5.300	\$ 4.403	0,13	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)			
5,500 % fällig am 12.04.2037 ^	19.365	751	0,02	<b>SAMBIA</b>				PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)			
6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	3.500	136	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Investmentfonds			
		3.488	0,10	Zambia Government International Bond				\$ 30.285			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				0,89			
Venezuela Government International Bond				<b>COMMERCIAL PAPER</b>							
7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	19.650	1.719	0,05	Amcor PLC							
7,650 % fällig am 21.04.2025 ^	6.624	579	0,02	5,450 % fällig am 07.07.2023							
7,750 % fällig am 13.10.2019 ^	20.130	1.208	0,03	3.300							
8,250 % fällig am 13.10.2024 ^	12.483	1.155	0,03	Summe kurzfristige Instrumente							
9,000 % fällig am 07.05.2023 ^	9.878	889	0,03	Summe Übertragbare Wertpapiere							
9,250 % fällig am 15.09.2027 ^	13.410	1.207	0,04	\$ 3.348.247							
9,250 % fällig am 07.05.2028 ^	11.868	1.068	0,03	98,78							
11,950 % fällig am 05.08.2031 ^	2.930	271	0,01								
		8.096	0,24								
Summe Venezuela		11.584	0,34								
<b>VIETNAM</b>											
<b>STAATSEMISSIONEN</b>											
Vietnam Government International Bond											
4,800 % fällig am 19.11.2024	500	492	0,01								

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	464	\$ (767)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	489	642	0,02
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	68	(129)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.190	(2.206)	(0,06)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	3.031	5.924	0,17
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	4.634	(9.046)	(0,27)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	116	133	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	87	143	0,00
				\$ (5.306)	(0,16)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (5.306)	(0,16)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 500	\$ 3	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	1.500	4	0,00
				\$ 7	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-38 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2027	\$ 22.800	\$ (333)	(0,01)

#### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,585 %	28.06.2026	£ 19.170	\$ (38)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.09.2023	\$ 5.700	80	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	21.09.2024	90.600	3.219	0,11
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	11.100	(1.112)	(0,03)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500 %	21.06.2027	\$ 13.700	\$ (2.108)	(0,06)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	400	(50)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	93.700	(388)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.12.2031	5.700	(975)	(0,03)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	21.12.2046	1.200	517	0,02
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,500	15.06.2046	600	268	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,415	04.01.2027	BRL 104.000	475	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,453	04.01.2027	57.600	273	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,620	04.01.2027	15.800	90	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,828	02.01.2025	87.000	58	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,220	02.01.2025	210.200	154	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,015	04.01.2027	102.700	(1.342)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	02.01.2025	36.500	(196)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025	38.600	(210)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025	86.600	(524)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025	124.500	757	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.09.2023	\$ 5.700	(81)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023	400	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.09.2023	13.700	(142)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.09.2023	1.200	10	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	15.09.2023	600	5	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	30.11.2024	ZAR 560.000	1.093	0,03
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK 866.200	(218)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	€ 7.400	(64)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,455	10.01.2028	PLN 24.000	(49)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,490	10.01.2028	22.800	(55)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,585	18.05.2028	MXN 48.600	(24)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,740	07.03.2028	242.000	164	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,760	19.05.2028	2.100	(2)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,900	21.05.2027	166.600	(93)	0,00
					\$ (512)	(0,01)
					\$ (838)	(0,02)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIONEN									
ZINSSWAPOPTIONEN									
Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	5.900	\$ (23)	\$ (28)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	5.900	(23)	(17)	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	3.400	(11)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	3.400	(11)	(16)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.700	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.700	(6)	(10)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	3.300	(11)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	3.300	(11)	(16)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.700	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.700	(6)	(10)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	5.100	(17)	(9)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	5.100	(17)	(21)	0,00
							\$ (148)	\$ (151)	0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Oman Government International Bond	(1,000) %	20.12.2027	\$ 2.300	\$ 76	\$ (44)	\$ 32	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	8.500	1.413	(513)	900	0,03
BPS	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	1.100	36	(21)	15	0,00
BRC	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	2.400	64	(31)	33	0,00
CBK	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	3.900	651	(238)	413	0,01
GST	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2028	17.000	(449)	(67)	(516)	(0,01)
HUS	Dubai Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	3.600	(12)	(26)	(38)	0,00
JPM	Dubai Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.500	(2)	(14)	(16)	0,00
	South Africa Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	27.250	1.274	(601)	673	0,02
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2025	6.300	608	(141)	467	0,01
MYC	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	800	135	(50)	85	0,00
					\$ 3.794	\$ (1.746)	\$ 2.048	0,06

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Chile Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 8.100	\$ 26	\$ 45	\$ 71	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	700	4	8	12	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2027	5.000	(18)	93	75	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.200	4	102	106	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.900	26	25	51	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2031	2.000	(84)	45	(39)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	9.600	(526)	363	(163)	0,00
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.500	(171)	116	(55)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.100	3	2	5	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.400	6	60	66	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	6.800	39	82	121	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.000	(182)	358	176	0,01
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	5.800	(3)	21	18	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	1	3	4	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.900	(6)	37	31	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.000	(4)	25	21	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.900	6	49	55	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	32.100	116	446	562	0,02
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	3	1	4	0,00
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.800	(8)	13	5	0,00
	Serbia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.800	(159)	78	(81)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.900	(5)	9	4	0,00
BRC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	6.800	(985)	484	(501)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	4.500	12	28	40	0,00
	Hungary Government International Bond	1,000	20.12.2023	5.300	(38)	53	15	0,00
	Philippines Government International Bond	1,000	20.06.2028	13.500	62	53	115	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	3.200	24	12	36	0,00
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.000	(8)	11	3	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.687	(277)	442	165	0,01
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.000	(237)	221	(16)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.300	8	33	41	0,00
	China Government International Bond	1,000	20.06.2028	4.500	58	22	80	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	5.800	(2)	20	18	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	500	(5)	7	2	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2028	68.000	251	193	444	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	6.000	11	56	67	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.400	6	18	24	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.900	0	54	54	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.200	19	20	39	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	50.000	429	(51)	378	0,01
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.200	(41)	54	13	0,00
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30.06.2029	16.000	0	497	497	0,02
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.000	(131)	132	1	0,00
GLM	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	800	(3)	5	2	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	600	(32)	35	3	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	3.600	33	31	64	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2028	9.900	19	105	124	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.700	(40)	49	9	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.000	1	3	4	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	1.200	(20)	19	(1)	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	29.100	118	392	510	0,02
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.100	7	2	9	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	4.200	38	9	47	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.000	29	(6)	23	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.413	36	0	36	0,00
HUS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(1)	2	1	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	9.700	103	(30)	73	0,00
JPM	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	4.700	(703)	356	(347)	(0,01)
	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	9.800	(220)	141	(79)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	7.700	41	97	138	0,01
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.000	(178)	354	176	0,01

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	Nigeria Government International Bond	5,000 %	20.06.2024	\$ 10.000	\$ 38	\$ (66)	\$ (28)	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.500	13	13	26	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	1.300	(3)	18	15	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	11.100	140	(56)	84	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	10.600	(171)	186	15	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	9.100	(564)	468	(96)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	5.100	(1)	17	16	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.500	(1)	13	12	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.100	(15)	58	43	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	200	(1)	3	2	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	2.700	(54)	51	(3)	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	37.300	105	548	653	0,02
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2026	3.000	(10)	61	51	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	18.000	98	38	136	0,01
MYI	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.700	23	24	47	0,00
					\$ (2.952)	\$ 7.282	\$ 4.330	0,13

(1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2023	€	\$	1	0	1	0,00		
	07.2023	¥		0	0	0	0,00		
	07.2023	\$	£	2.608	17	17	0,00		
	09.2023	NGN	\$	365	97	97	0,00		
	09.2023	\$	NGN	27.936	0	(1)	0,00		
	07.2023	€	\$	276	0	0	0,00		
	07.2023	ILS		19.366	2.724	0	2.724	0,08	
	07.2023	\$	BRL	256	0	0	0	0,00	
	07.2023	248.363	€	226.681	0	(1.054)	(1.054)	(0,03)	
	07.2023	52.281	ILS	174.905	0	(5.150)	(5.150)	(0,15)	
BPS	07.2023	15.826	¥	2.199.787	0	(606)	(606)	(0,02)	
	07.2023	26	MYR	120	0	0	0	0,00	
	08.2023	BRL	\$	53	0	0	0	0,00	
	08.2023	CNH		4.049	190	0	190	0,01	
	08.2023	COP	20.000.000	4.360	0	(354)	(354)	(0,01)	
	08.2023	€		244.935	1.059	0	1.059	0,03	
	08.2023	MYR	108.777	23.416	40	0	40	0,00	
	08.2023	\$	CNY	75	0	(1)	(1)	0,00	
	08.2023	56.943	ILS	190.199	0	(5.653)	(5.653)	(0,17)	
	08.2023	ZAR	255.815	\$	13.746	260	260	0,01	
	09.2023	\$	4.336	INR	356.455	0	(3)	(3)	0,00
	12.2023	NGN	55.080	\$	68	1	1	0,00	
	12.2023	\$	167	MXN	2.981	1	1	0,00	
	07.2023	21	MYR	98	0	0	0	0,00	
	08.2023	COP	43.628.519	\$	10.241	0	(78)	(78)	0,00
	08.2023	ZAR	514.494		27.404	428	(145)	283	0,01
09.2023	ILS	409		114	4	0	4	0,00	
09.2023	ZAR	347.160		19.656	1.406	0	1.406	0,04	
10.2023	MXN	280.418		14.966	0	(1.069)	(1.069)	(0,03)	
CBK	07.2023	CZK		540	0	(4)	(4)	0,00	
	07.2023	€		17.656	19.026	(237)	(237)	(0,01)	
	07.2023	ILS	113.145		35.324	4.835	0	4.835	0,14
	07.2023	\$	2.816	€	2.624	47	0	47	0,00
	07.2023	160	MXN	2.891	8	0	8	0,00	
	08.2023	CNH	29	\$	4	0	0	0,00	
	08.2023	COP	28.384.920		6.713	1	(2)	(1)	0,00
	08.2023	ILS	190.199		58.940	7.650	0	7.650	0,22
	09.2023	COP	6.036.493		1.429	13	0	13	0,00
	10.2023	\$	431	NGN	257.586	0	(112)	(112)	0,00
11.2023	ILS	147.240	\$	44.097	4.158	0	4.158	0,12	
11.2023	\$	2.209	EGP	71.296	0	(152)	(152)	(0,01)	
DUB	10.2023	ZAR	123.036	\$	6.756	311	0	311	0,01
	11.2023	EGP	98.621		3.471	627	0	627	0,02
	01.2024	NGN	135.300		220	58	0	58	0,00
GLM	07.2023	BRL	97.666		19.868	0	(378)	(378)	(0,01)
	07.2023	DOP	802.203		13.855	0	(501)	(501)	(0,02)
	07.2023	ILS	23.207		6.893	635	0	635	0,02



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
	07.2023	\$	18.219	BRL	97.409	\$ 1.974	0,06		
	08.2023	DOP	458.517	\$	8.139	(100)	0,00		
	09.2023	\$	16.763	BRL	81.837	13	0,00		
	10.2023	DOP	279.054	\$	4.978	32	0,00		
	10.2023	NGN	502.834		842	219	0,01		
	11.2023	DOP	304.391		5.474	118	0,00		
	11.2023	EGP	32.430		1.150	215	0,01		
	11.2023	\$	2.849	EGP	86.895	(342)	(0,01)		
	12.2023	DOP	175.615	\$	3.154	74	0,00		
JPM	07.2023	¥	748.822		5.236	55	0,00		
	07.2023	MXN	655		38	0	0,00		
	07.2023	\$	283	NGN	154.832	(82)	0,00		
	08.2023	BRL	87.356	\$	17.044	(977)	(0,03)		
	08.2023	CNH	22.460		3.250	153	0,00		
	08.2023	COP	16.649.644		3.927	(27)	0,00		
	08.2023	MXN	313.246		18.080	(37)	0,00		
	08.2023	\$	12	CNY	79	(1)	0,00		
	08.2023		301	HUF	105.169	3	0,00		
	08.2023		5.236	¥	745.640	(55)	0,00		
	09.2023	COP	14.897.873	\$	3.488	(7)	0,00		
	09.2023	ILS	393		111	4	0,00		
	09.2023	PEN	27.390		7.439	(72)	0,00		
	09.2023	\$	309	NGN	183.604	(77)	0,00		
	10.2023		395		244.639	(91)	0,00		
	12.2023	NGN	248.400	\$	400	97	0,00		
	12.2023	\$	480	NGN	303.360	(110)	0,00		
MBC	01.2024		81		66.987	(1)	0,00		
	07.2023	€	4.485	\$	4.805	(88)	0,00		
	07.2023	£	20.035		24.801	(671)	(0,02)		
	09.2023	\$	12.152	INR	999.110	(7)	0,00		
MYI	07.2023	AUD	2	\$	1	0	0,00		
	07.2023	£	3		4	0	0,00		
	07.2023	\$	162	€	148	0	0,00		
	07.2023		322	£	255	2	0,00		
	08.2023		2.692	ZAR	49.273	(94)	0,00		
	09.2023	AED	37.686	\$	10.260	0	0,00		
	11.2023	EGP	28.556		1.012	188	0,01		
	01.2024	NGN	322.875		525	139	0,00		
RBC	08.2023	\$	16.048	MXN	278.106	37	0,00		
SCX	07.2023	NGN	189.245	\$	359	114	0,00		
	07.2023	\$	291	€	266	0	0,00		
	07.2023		26	MYR	122	0	0,00		
	07.2023		45	NGN	34.560	0	0,00		
	08.2023	CNH	10.645	\$	1.547	79	0,00		
	01.2024	\$	557	NGN	457.854	(10)	0,00		
SOG	07.2023	€	204.733	\$	220.240	(3.125)	(0,09)		
	07.2023	PLN	661		153	(9)	0,00		
TOR	07.2023	\$	22.145	£	17.427	11	0,00		
	08.2023	£	17.427	\$	22.149	(11)	0,00		
	08.2023	\$	190	HUF	66.613	2	0,00		
UAG	07.2023	€	1.711	\$	1.831	(36)	0,00		
	07.2023	\$	11	SGD	15	0	0,00		
	07.2023		985	TRY	22.691	(121)	0,00		
	09.2023	ILS	340	\$	95	3	0,00		
	09.2023	\$	18	SGD	25	0	0,00		
	09.2023	ZAR	46.533	\$	2.654	208	0,01		
	10.2023		39.650		2.142	65	0,00		
						\$ 28.408	\$ (21.651)	\$ 6.757	0,20

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	118	\$	78	\$ 0	0,00
	07.2023	\$	265	AUD	399	(1)	0,00
	08.2023		78		118	0	0,00
BOA	07.2023		306		465	(2)	0,00
BPS	07.2023	AUD	617	\$	408	(2)	0,00
	07.2023	\$	61	AUD	90	(1)	0,00
	08.2023		400		603	2	0,00
CBK	07.2023		67		103	1	0,00
JPM	07.2023		101		154	2	0,00
RBC	07.2023		68		100	(2)	0,00
SCX	07.2023	AUD	208	\$	138	0	0,00
	07.2023	\$	81	AUD	123	2	0,00
	08.2023		138		208	0	0,00
SOG	07.2023		160		245	3	0,00
TOR	07.2023	AUD	363	\$	240	(2)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	\$ 170	AUD 260	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	08.2023	\$ 240	AUD 363	2	0	2	0,00
UAG	07.2023	AUD 699	\$ 464	1	(2)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 82	AUD 126	1	0	1	0,00
	08.2023	464	699	2	(1)	1	0,00
				\$ 26	\$ (13)	\$ 13	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF 23.912	\$ 26.737	\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,00
	07.2023	\$ 34.819	CHF 31.500	391	0	391	0,01
	08.2023	26.737	23.844	0	(9)	(9)	0,00
CLY	07.2023	CHF 12.638	\$ 14.070	0	(57)	(57)	0,00
	08.2023	\$ 14.070	CHF 12.602	57	0	57	0,00
MBC	07.2023	CHF 608	\$ 546	2	0	2	0,00
MYI	07.2023	CHF 658	\$ 726	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	\$ 1	CHF 1	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	\$ 25.034	CHF 22.494	109	0	109	0,01
UAG	07.2023	CHF 24.696	\$ 27.549	0	(54)	(54)	0,00
	07.2023	\$ 22.576	CHF 20.286	98	0	98	0,00
	08.2023	27.549	24.625	54	0	54	0,00
				\$ 720	\$ (129)	\$ 591	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 440.629	€ 409.994	\$ 6.675	\$ (1)	\$ 6.674	0,20
BPS	07.2023	€ 414.754	\$ 454.446	1.949	0	1.949	0,06
	07.2023	\$ 439.456	€ 408.793	6.537	0	6.537	0,19
	08.2023	455.044	414.717	0	(1.968)	(1.968)	(0,06)
CBK	07.2023	€ 408.820	\$ 444.295	0	(1.728)	(1.728)	(0,05)
	07.2023	\$ 19.107	€ 17.470	4	(51)	(47)	0,00
	08.2023	430.473	395.389	1.487	0	1.487	0,04
JPM	07.2023	€ 414.649	\$ 452.755	373	0	373	0,01
	07.2023	\$ 22.319	€ 20.875	456	0	456	0,01
	08.2023	453.389	414.649	0	(387)	(387)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 28.027	\$ 30.074	0	(503)	(503)	(0,01)
	07.2023	\$ 407	€ 371	0	(2)	(2)	0,00
SOG	07.2023	439.704	408.746	6.238	0	6.238	0,18
				\$ 23.719	\$ (4.640)	\$ 19.079	0,56

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 168	\$ 212	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2023	\$ 114	£ 90	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	£ 358	\$ 444	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	\$ 19.068	£ 15.417	531	0	531	0,02
BRC	07.2023	£ 205	\$ 259	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07.2023	£ 283	\$ 360	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 31	£ 25	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	£ 15.265	\$ 19.301	0	(106)	(106)	0,00
	08.2023	\$ 19.305	£ 15.265	106	0	106	0,00
MBC	07.2023	£ 510	\$ 652	4	0	4	0,00
	07.2023	\$ 19.395	£ 15.666	522	0	522	0,01
MYI	07.2023	£ 16	\$ 19	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 19.115	£ 15.380	438	0	438	0,01
TOR	07.2023	£ 15.303	\$ 19.446	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	\$ 19.450	£ 15.303	10	0	10	0,00
				\$ 1.611	\$ (130)	\$ 1.481	0,04

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$ 8.661	SGD 11.719	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
GLM	07.2023	SGD 613	\$ 457	4	0	4	0,00
	07.2023	\$ 217	SGD 294	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	SGD 11.744	\$ 8.678	1	0	1	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	\$ 1.202	SGD 1.627	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2023	8.678	11.732	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	7.886	10.655	0	(13)	(13)	0,00
	08.2023	11	15	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD 11.385	\$ 8.426	13	0	13	0,00
	08.2023	\$ 8.426	SGD 11.374	0	(13)	(13)	0,00
UAG	07.2023	SGD 21	\$ 16	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 8.512	SGD 11.515	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 18	\$ (32)	\$ (14)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 34.134 1,01

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Banco Davivienda S.A. 13,501 % fällig am 13.12.2024	COP	15.106.000	3,617
15,389 % fällig am 21.02.2024		4.622.500	1,123
BanColombia S.A. 5,917 % fällig am 27.01.2024		21.517.000	4,960
13,320 % fällig am 08.06.2025		7.817.000	1,879
13,637 % fällig am 14.12.2024		20.654.000	4,975
16,137 % fällig am 01.09.2024		8.476.000	2,053
BBVA Colombia S.A. 5,870 % fällig am 15.07.2024		17.362.000	3,906
14,540 % fällig am 13.01.2024		9.047.900	2,149
16,412 % fällig am 25.04.2024		334.000	78
Summe Einlagenzertifikate		\$ 24.740	0,73
Summe Anlagen		\$ 3.431.262	101,23
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (41.615)	(1,23)
Nettovermögen		\$ 3.389.647	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,89 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 460	\$ 460	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071	10.06.2022	0	0	0,00
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	31.381	24.311	0,72
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	7.281	6.989	0,21
		\$ 39.122	\$ 31.760	0,94

(i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 56.824 USD (31. Dezember 2022: 84.485 USD) und Barmittel in Höhe von 520 USD (31. Dezember 2022: 842 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 22 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 3.002 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte geliefert.

Barmittel in Höhe von 19.480 USD (31. Dezember 2022: 36.243 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.880 USD (31. Dezember 2022: 11.680 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 3.264.035	\$ 84.211	\$ 3.348.247
Investmentfonds	30.285	0	0	30.285
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(254)	27.747	497	27.990
Einlagen bei Kreditinstituten	0	8.310	16.430	24.740
<b>Summen</b>	<b>\$ 30.032</b>	<b>\$ 3.300.092</b>	<b>\$ 101.138</b>	<b>\$ 3.431.262</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 3.210.349	\$ 57.311	\$ 3.267.661
Investmentfonds	52.797	0	0	52.797
Pensionsgeschäfte	0	9.160	0	9.160
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	5.730	14.061	(25)	19.766
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	2.227	2.227
<b>Summen</b>	<b>\$ 58.528</b>	<b>\$ 3.233.570</b>	<b>\$ 59.513</b>	<b>\$ 3.351.611</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	5,450 %	17.04.2023	18.07.2023	\$ (17.391)	\$ (17.588)	(0,52)
	5,450	17.05.2023	18.07.2023	(12.705)	(12.791)	(0,38)
BRC	2,000	05.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(3.019)	(3.037)	(0,09)
	3,750	05.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(9.056)	(9.110)	(0,27)
	4,800	05.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(1.579)	(1.588)	(0,05)
	8,750	05.10.2022	TBD <sup>(1)</sup>	ZAR (125.726)	(7.048)	(0,21)
MBC	2,800	03.07.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (361)	(394)	(0,01)
	3,750	30.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (1.582)	(1.583)	(0,04)
	4,700	30.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(1.323)	(1.324)	(0,04)
NOM	4,900	22.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(449)	(449)	(0,01)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (54.912)</b>	<b>(1,62)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 1	\$ 0	\$ 1	\$ 2	\$ 0	\$ 2
BOA	7.790	(6.230)	1.560	(9.485)	8.490	(995)
BPS	(167)	920	753	1.829	(690)	1.139
BRC	411	250	661	(897)	860	(37)
CBK	17.475	(16.700)	775	20.215	(19.290)	925
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(454)	0	(454)
DUB	1.494	(1.660)	(166)	126	(230)	(104)
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	(33)	0	(33)
GLM	1.959	(1.770)	189	46	(120)	(74)
GST	313	(300)	13	(1.298)	1.330	32
HUS	36	(150)	(114)	58	(150)	(92)
IND	k. A.	k. A.	k. A.	0	270	270
JPM	343	(270)	73	1.107	(1.310)	(203)
MBC	(756)	710	(46)	3.472	(2.910)	562
MYC	869	(880)	(11)	(27)	(60)	(87)
MYI	711	(790)	(79)	70	(160)	(90)
RBC	35	0	35	1	0	1
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	1.375	(1.300)	75
SCX	294	(280)	14	8.586	(8.150)	436
SOG	3.107	(2.300)	807	(37)	0	(37)
TOR	5	0	5	8	(20)	(12)
UAG	214	0	214	(678)	730	52

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,53	83,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	10,96	15,12
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,29	0,17
Investmentfonds	0,89	1,60
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,28
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,16)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,02)	(0,14)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,01	0,73
Einlagezertifikate	0,73	0,07
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,62)	(2,28)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Albanien	0,09	0,09
Angola	0,42	0,19
Argentinien	1,98	1,46
Aserbaidschan	1,16	1,31
Bahamas	0,36	0,36
Bahrain	0,33	0,36
Weissrussland	k. A.	0,02
Benin	0,10	0,18
Brasilien	1,60	2,04
Kamerun	0,18	0,18
Kanada	0,03	k. A.
Cayman-Inseln	2,96	3,52
Chile	2,52	2,67
China	0,25	0,32
Kolumbien	2,17	2,78
Costa Rica	0,08	0,27
Dominikanische Republik	3,96	2,69
Ecuador	0,74	1,11
Ägypten	1,82	2,10
El Salvador	0,39	0,28
Äthiopien	0,07	0,06
Gabun	0,02	k. A.
Georgien	0,01	0,01
Deutschland	k. A.	0,33
Ghana	0,58	0,74
Guatemala	0,88	0,68
Hongkong	1,13	0,83
Ungarn	2,10	0,96
Indien	0,25	0,30
Indonesien	4,22	4,75
International	0,24	k. A.
Irland	0,73	0,73
Israel	2,02	1,74
Elfenbeinküste	0,36	0,67
Jamaika	0,08	0,08
Japan	0,48	0,50
Jersey, Kanalinseln	0,73	0,71
Jordanien	0,88	0,72
Kasachstan	1,13	1,37
Kenia	0,14	0,03
Libanon	0,02	0,02
Luxemburg	1,61	0,45
Mazedonien	0,25	k. A.
Malaysia	1,42	0,33
Mauritius	0,01	0,08
Mexiko	7,62	6,66
Mongolei	k. A.	0,05
Marokko	0,36	0,51
Multinational	0,27	0,28
Namibia	0,17	0,17
Niederlande	0,60	0,61
Nigeria	1,92	1,62
Oman	1,62	1,73
Pakistan	0,35	0,34
Panama	1,97	1,59
Paraguay	0,45	0,35
Peru	1,52	1,17
Philippinen	0,60	0,42
Polen	1,00	0,38
Katar	2,04	1,66
Rumänien	2,15	1,80
Russland	0,28	0,22
Saudi-Arabien	4,45	2,32
Senegal	0,44	0,23
Serbien	1,03	0,69

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Singapur	0,54	0,50
Südafrika	4,68	4,48
Südkorea	0,66	k. A.
Spanien	0,39	0,41
Sri Lanka	0,75	0,50
Supranational	0,21	0,21
Schweiz	0,34	0,82
Tansania	0,36	0,50
Thailand	0,06	0,10
Tunesien	0,24	0,28
Türkei	5,22	5,16
Ukraine	0,29	0,27
Vereinigte Arabische Emirate	2,29	1,89
Großbritannien	1,40	2,07
USA	11,13	9,86
Usbekistan	0,20	0,21
Venezuela	0,34	0,40
Vietnam	0,01	0,02
Jungferinseln (Britisch)	0,13	0,64
Sambia	0,10	0,11
Kurzfristige Instrumente	0,10	9,58
Investmentfonds	0,89	1,60
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,28
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,16)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzkauf	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	k. A.	(0,02)
Zinsswaps	(0,01)	(0,12)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	0,06	0,08
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,13	(0,11)
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,20	(0,14)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,62	0,90
Einlagenzertifikate	0,73	0,07
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,23)	(1,38)
Nettovermögen	100,00	100,00





BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ECUADOR</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Ecuador Social Bond SARL 0,000 % fällig am 30.01.2035 (b)	\$ 11.937	\$ 9.073	0,38
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ecuador Government International Bond 0,000 % fällig am 31.07.2030 (b)	5.886	1.712	0,07
1,500 % fällig am 31.07.2040	4.527	1.419	0,06
2,500 % fällig am 31.07.2035	56.088	19.627	0,83
5,500 % fällig am 31.07.2030	11.934	5.802	0,25
		28.560	1,21
Summe Ecuador		37.633	1,59

<b>ÄGYPTEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Egypt Government International Bond 5,250 % fällig am 06.10.2025	7.500	5.728	0,24
5,625 % fällig am 16.04.2030	€ 1.100	668	0,03
5,875 % fällig am 16.02.2031	\$ 3.800	2.102	0,09
6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 11.200	6.821	0,29
7,053 % fällig am 15.01.2032	\$ 6.200	3.532	0,15
7,300 % fällig am 30.09.2033	6.000	3.320	0,14
7,500 % fällig am 16.02.2061	8.400	4.236	0,18
7,625 % fällig am 29.05.2032	8.800	5.135	0,22
7,903 % fällig am 21.02.2048	4.300	2.220	0,09
8,150 % fällig am 20.11.2059	3.500	1.822	0,08
8,500 % fällig am 31.01.2047	3.400	1.815	0,07
8,750 % fällig am 30.09.2051	7.400	4.012	0,17
Summe Ägypten		41.411	1,75

<b>EL SALVADOR</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
El Salvador Government International Bond 6,375 % fällig am 18.01.2027	3.600	2.529	0,11
7,125 % fällig am 20.01.2050	14.900	8.329	0,35
7,625 % fällig am 21.09.2034	1.100	644	0,03
7,625 % fällig am 01.02.2041	250	143	0,01
7,650 % fällig am 15.06.2035	1.000	594	0,02
9,500 % fällig am 15.07.2052	7.750	4.914	0,21
Summe El Salvador		17.153	0,73

<b>GABUN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Gabon Government International Bond 6,625 % fällig am 06.02.2031	600	479	0,02
7,000 % fällig am 24.11.2031	1.300	1.035	0,04
Summe Gabun		1.514	0,06

<b>GEORGIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Georgian Railway JSC 4,000 % fällig am 17.06.2028	10.700	9.279	0,39

<b>GHANA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ghana Government International Bond 0,000 % fällig am 07.04.2025 ^	1.400	539	0,02
7,625 % fällig am 16.05.2029 ^	3.300	1.422	0,06
7,750 % fällig am 07.04.2029 ^	2.700	1.162	0,05
7,875 % fällig am 11.02.2035 ^	5.700	2.494	0,11
8,125 % fällig am 26.03.2032 ^	11.300	4.882	0,21
8,625 % fällig am 07.04.2034 ^	7.900	3.403	0,14
8,627 % fällig am 16.06.2049 ^	1.600	663	0,03
8,750 % fällig am 11.03.2061 ^	31.850	13.287	0,56
8,875 % fällig am 07.05.2042 ^	1.100	455	0,02
8,950 % fällig am 26.03.2051 ^	6.700	2.810	0,12
Summe Ghana		31.117	1,32

<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	€ 3.500	2.879	0,12

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>HONGKONG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Alfa Group Ltd. 3,200 % fällig am 16.09.2040	\$ 200	\$ 154	0,01
Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 1.500	1.129	0,04
5,000 % fällig am 18.05.2026	\$ 200	150	0,01
5,050 % fällig am 27.01.2027	200	138	0,01
5,950 % fällig am 19.10.2025	4.000	3.206	0,13
Huarong Finance Co. Ltd. 3,875 % fällig am 13.11.2029	900	695	0,03
4,500 % fällig am 29.05.2029	4.200	3.371	0,14
4,750 % fällig am 27.04.2027	800	693	0,03
4,950 % fällig am 07.11.2047	1.700	1.134	0,05
Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030	1.500	1.265	0,05
6,536 % fällig am 27.07.2032	6.800	6.865	0,29
MTR Corp. Ltd. 1,625 % fällig am 19.08.2030	6.300	5.178	0,22
		23.978	1,01
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Airport Authority Hong Kong 2,100 % fällig am 08.03.2026 (c)	1.800	1.647	0,07
2,400 % fällig am 08.03.2028 (c)	3.600	3.173	0,13
2,500 % fällig am 12.01.2032	200	170	0,01
4,875 % fällig am 12.01.2030	6.500	6.610	0,28
Hong Kong Government International Bond 2,375 % fällig am 02.02.2051	1.200	816	0,03
3,750 % fällig am 07.06.2032	€ 5.500	6.044	0,26
5,250 % fällig am 11.01.2053	\$ 3.500	3.916	0,17
		22.376	0,95
Summe Hongkong		46.354	1,96

<b>UNGARN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
MVM Energetika Zrt 7,500 % fällig am 09.06.2028	4.400	4.392	0,18
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ungarische Entwicklungsbank 6,500 % fällig am 29.06.2028	10.900	10.810	0,46
Hungary Government International Bond 1,625 % fällig am 28.04.2032	€ 1.200	997	0,04
1,750 % fällig am 05.06.2035	8.400	6.439	0,27
2,125 % fällig am 22.09.2031	\$ 18.650	14.460	0,61
3,125 % fällig am 21.09.2051	7.600	4.742	0,20
5,250 % fällig am 16.06.2029	11.600	11.311	0,48
5,375 % fällig am 25.03.2024	200	200	0,01
5,500 % fällig am 16.06.2034	1.700	1.655	0,07
6,750 % fällig am 25.09.2052	16.600	17.168	0,73
7,625 % fällig am 29.03.2041	500	565	0,02
Magyar Export-Import Bank 6,125 % fällig am 04.12.2027	7.500	7.428	0,32
		75.775	3,21
Summe Ungarn		80.167	3,39

<b>INDIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Adani Renewable Energy RJ Ltd. 4,625 % fällig am 15.10.2039	3.916	2.871	0,12
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % fällig am 21.01.2032	10.300	8.989	0,38
3,835 % fällig am 13.12.2027	3.500	3.269	0,14
JSW Hydro Energy Ltd. 4,125 % fällig am 18.05.2031	3.990	3.370	0,14
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	1.202	1.127	0,05
ReNew Wind Energy AP2 4,500 % fällig am 14.07.2028	10.000	8.532	0,36
Wipro IT Services LLC 1,500 % fällig am 23.06.2026	5.000	4.461	0,19
Summe Indien		32.619	1,38

<b>INDONESIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bank Mandiri Persero Tbk PT 2,000 % fällig am 19.04.2026	\$ 6.700	\$ 6.060	0,26
3,750 % fällig am 11.04.2024	2.000	1.967	0,08
Pelabuhan Indonesia Persero PT 4,250 % fällig am 05.05.2025	6.700	6.539	0,28
5,375 % fällig am 05.05.2045	3.000	2.832	0,12
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % fällig am 06.06.2032	18.100	17.975	0,76
		35.373	1,50
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Indonesia Government International Bond 1,100 % fällig am 12.03.2033	€ 1.700	1.381	0,06
1,300 % fällig am 23.03.2034	11.400	9.184	0,39
4,750 % fällig am 18.07.2047	\$ 4.400	4.159	0,17
5,125 % fällig am 15.01.2045	4.164	4.152	0,17
5,250 % fällig am 08.01.2047	200	200	0,01
5,650 % fällig am 11.01.2053	700	734	0,03
7,750 % fällig am 17.01.2038	3.280	4.107	0,17
8,500 % fällig am 12.10.2035	1.055	1.376	0,06
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 3,550 % fällig am 09.06.2051	5.500	4.191	0,18
3,800 % fällig am 23.06.2050	3.500	2.771	0,12
		32.255	1,36
Summe Indonesien		67.628	2,86

<b>IRLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC 5,950 % fällig am 15.04.2030 ^ (d)	\$ 3.900	234	0,01
Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3,949 % fällig am 24.04.2023 ^	1.700	1.556	0,06
Sovcombank Via SovCom Capital DAC 3,400 % fällig am 26.01.2025 ^	5.400	146	0,01
Summe Irland		1.936	0,08
<b>ELFENBEINKÜSTE</b>			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
Elfenbeinküste 7,985 % fällig am 19.03.2027	€ 1.200	1.277	0,05
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	19.900	18.401	0,78
5,875 % fällig am 17.10.2031	600	549	0,02
6,625 % fällig am 22.03.2048	2.900	2.253	0,10
		21.203	0,90
Summe Elfenbeinküste		22.480	0,95
<b>JAMAICA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Jamaica Government International Bond 7,875 % fällig am 28.07.2045	\$ 3.300	3.816	0,16
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Corsair International Ltd. 7,772 % fällig am 28.01.2027	€ 7.900	8.576	0,36
8,122 % fällig am 28.01.2029	3.400	3.681	0,16
Summe Jersey, Kanalinseln		12.257	0,52
<b>JORDANIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Jordan Government International Bond 5,750 % fällig am 31.01.2027	\$ 300	289	0,01
6,125 % fällig am 29.01.2026	3.000	2.949	0,12

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
7,375 % fällig am 10.10.2047	\$ 7.300	\$ 6.312	0,27	Trust Fibra Uno	\$ 2.000	\$ 1.584	0,07	6,750 % fällig am 17.01.2048	\$ 6.700	\$ 6.454	0,27
7,500 % fällig am 13.01.2029	6.000	6.049	0,26	6,390 % fällig am 15.01.2050				7,000 % fällig am 25.01.2051	4.800	4.764	0,20
Summe Jordanien		15.599	0,66			20.983	0,89	Summe Oman		68.295	2,89
<b>KASACHSTAN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>PANAMA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Kazakhstan Government International Bond				Mexico Government International Bond				Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.			
4,875 % fällig am 14.10.2044	5.600	5.060	0,21	1,350 % fällig am 18.09.2027	€ 600	594	0,03	5,125 % fällig am 11.08.2061	2.900	2.239	0,10
6,500 % fällig am 21.07.2045	21.800	23.068	0,98	2,250 % fällig am 12.08.2036	9.700	7.852	0,33	Banco General S.A.			
Summe Kasachstan		28.128	1,19	2,659 % fällig am 24.05.2031	\$ 0	0	0,00	5,250 % fällig am 07.05.2031	6.500	5.620	0,24
<b>KENIA STAATSEMISSIONEN</b>				<b>MONGOLEI STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Banco Nacional de Panamá</b>			
Kenya Government International Bond				Mongolia Government International Bond				2,500 % fällig am 11.08.2030	600	473	0,02
6,300 % fällig am 23.01.2034	6.200	4.699	0,20	3,500 % fällig am 07.07.2027	7.200	6.022	0,26	Empresa de Transmision Elctrica S.A.			
6,875 % fällig am 24.06.2024	9.400	8.964	0,38	5,125 % fällig am 07.04.2026	1.100	1.026	0,04	5,125 % fällig am 02.05.2049	1.000	813	0,03
Summe Kenia		13.663	0,58	8,650 % fällig am 19.01.2028	268	270	0,01			9.145	0,39
<b>LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>MAROKKO STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Amaggi Luxembourg International SARL				Morocco Government International Bond				Panama Government International Bond			
5,250 % fällig am 28.01.2028	6.000	5.465	0,23	4,000 % fällig am 15.12.2050	17.000	11.471	0,48	2,252 % fällig am 29.09.2032	3.300	2.530	0,11
Unigel Luxembourg S.A.				5,500 % fällig am 11.12.2042	4.600	3.970	0,17	3,160 % fällig am 23.01.2030	800	702	0,03
8,750 % fällig am 01.10.2026	3.400	1.118	0,05	Summe Marokko		15.441	0,65	3,870 % fällig am 23.07.2060	8.500	5.655	0,24
Summe Luxemburg		6.583	0,28	<b>MULTINATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,300 % fällig am 29.04.2053	1.500	1.120	0,05
<b>MAZEDONIEN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>NXP BV</b>				4,500 % fällig am 15.05.2047	4.200	3.351	0,14
North Macedonia Government International Bond				3,400 % fällig am 01.05.2030	500	443	0,02	4,500 % fällig am 16.04.2050	9.800	7.619	0,32
2,750 % fällig am 18.01.2025	€ 3.600	3.749	0,16	<b>NAMIBIA STAATSEMISSIONEN</b>				4,500 % fällig am 01.04.2056	15.000	11.302	0,48
5,625 % fällig am 26.07.2023	5.800	6.333	0,27	Namibia Government International Bond				4,500 % fällig am 19.01.2063	18.500	13.581	0,57
6,960 % fällig am 13.03.2027	6.700	7.471	0,31	5,250 % fällig am 29.10.2025	2.300	2.190	0,09	6,400 % fällig am 14.02.2035	10.600	11.081	0,47
Summe Mazedonien		17.553	0,74	<b>NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,700 % fällig am 26.01.2036	6.500	6.976	0,29
<b>MALAYSIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>IHS Netherlands Holdco BV</b>				6,853 % fällig am 28.03.2054	2.700	2.816	0,12
Axiata SPV5 Labuan Ltd.				8,000 % fällig am 18.09.2027	10.700	9.780	0,41	8,125 % fällig am 28.04.2034	1.000	1.184	0,05
3,064 % fällig am 19.08.2050	\$ 4.600	3.214	0,14	<b>ING Groep NV</b>						67.917	2,87
Khazanah Capital Ltd.				1,125 % fällig am 07.12.2028	£ 4.000	3.992	0,17	Summe Panama		77.062	3,26
4,876 % fällig am 01.06.2033	4.300	4.260	0,18	1,400 % fällig am 01.07.2026	\$ 7.900	7.197	0,31	<b>PARAGUAY STAATSEMISSIONEN</b>			
Khazanah Global Sukuk Bhd.				<b>InterCement Financial Operations BV</b>				Paraguay Government International Bond			
4,687 % fällig am 01.06.2028	5.800	5.725	0,24	5,750 % fällig am 17.07.2024	200	125	0,01	2,739 % fällig am 29.01.2033	1.900	1.524	0,06
Summe Malaysia		29.152	1,23	<b>Metinvest BV</b>				3,849 % fällig am 28.06.2033	1.900	1.654	0,07
<b>MAURITIUS UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>NE Property BV</b>				4,700 % fällig am 27.03.2027	2.300	2.240	0,10
Greenko Solar Mauritius Ltd.				2,000 % fällig am 20.01.2030	€ 5.600	4.521	0,19	5,400 % fällig am 30.03.2050	15.200	13.023	0,55
5,950 % fällig am 29.07.2026	\$ 200	188	0,01	3,375 % fällig am 14.07.2027	2.300	2.255	0,10	5,600 % fällig am 13.03.2048	1.800	1.583	0,07
India Green Energy Holdings				<b>Prosus NV</b>				5,850 % fällig am 21.08.2033	2.700	2.704	0,11
5,375 % fällig am 29.04.2024	9.400	9.192	0,39	1,539 % fällig am 03.08.2028	800	720	0,03	(a)	2.700	2.704	0,11
Summe Mauritius		9.380	0,40	2,031 % fällig am 03.08.2032	400	311	0,01	6,100 % fällig am 11.08.2044	1.800	1.709	0,07
<b>MEXIKO UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Summe Niederlande</b>				Summe Paraguay		24.437	1,03
Banco Mercantil del Norte S.A.				3,257 % fällig am 19.01.2027	\$ 2.200	1.989	0,08	<b>PERU UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,625 % fällig am 24.01.2032 (c)(d)	2.000	1.548	0,07	4,027 % fällig am 03.08.2050	800	503	0,02	InRetail Consumer			
7,500 % fällig am 27.06.2029 (c)(d)	3.400	2.955	0,12	Summe Oman		14.400	0,63	3,250 % fällig am 22.03.2028	3.700	3.181	0,14
7,625 % fällig am 10.01.2028 (c)(d)	300	273	0,01	<b>OMAN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
8,375 % fällig am 14.10.2030 (c)(d)	400	374	0,02	Oman Government International Bond				Fondo MIVIVIENDA S.A.			
<b>Corp. GEO S.A.B. de C.V.</b>				<b>4,750 % fällig am 15.06.2026</b>				<b>4,625 % fällig am 12.04.2027</b>			
8,875 % fällig am 25.09.2014 ^	500	0	0,00	4,875 % fällig am 01.02.2025	3.000	2.956	0,13	1,950 % fällig am 17.11.2036	€ 8.300	6.568	0,28
Metalsa S.A. de C.V.				5,375 % fällig am 08.03.2027	5.600	5.504	0,23	3,000 % fällig am 15.01.2034	\$ 7.700	6.416	0,27
3,750 % fällig am 04.05.2031	10.600	8.356	0,35	5,625 % fällig am 17.01.2028	8.200	8.126	0,34	3,230 % fällig am 28.07.2121	0	0	0,00
Sitios Latinoamerica S.A.B. de C.V.				6,000 % fällig am 01.08.2029	12.300	12.328	0,52	3,600 % fällig am 15.01.2072	8.200	5.611	0,24
5,375 % fällig am 04.04.2032	6.500	5.893	0,25	6,250 % fällig am 25.01.2031	6.200	6.303	0,27	6,550 % fällig am 14.03.2037	0	0	0,00
				6,500 % fällig am 08.03.2047	2.650	2.478	0,11	Summe Peru		33.477	1,42
				6,750 % fällig am 28.10.2027	14.400	14.903	0,63	<b>PHILIPPINEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								Globe Telecom, Inc.			
								4,200 % fällig am 02.08.2026	6.700	6.239	0,27
								(c)			
								PLDT, Inc.			
								3,450 % fällig am 23.06.2050	3.900	2.662	0,11
								Summe Philippinen		8.901	0,38
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Philippines Government International Bond			
								2,650 % fällig am 10.12.2045	1.800	1.215	0,05
								2,950 % fällig am 05.05.2045	10.500	7.496	0,32
								3,200 % fällig am 06.07.2046	4.200	3.109	0,13

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
3,700 % fällig am 01.03.2041	\$ 300	\$ 247	0,01
5,500 % fällig am 17.01.2048	10.600	10.890	0,46
6,375 % fällig am 23.10.2034	800	895	0,04
9,500 % fällig am 02.02.2030	1.100	1.381	0,06
		25.233	1,07
Summe Philippinen		34.134	1,45
<b>POLEN STAATSEMISSIONEN</b>			
Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375 % fällig am 22.05.2033	3.800	3.785	0,16
Poland Government International Bond 4,875 % fällig am 04.10.2033	11.200	11.015	0,47
5,500 % fällig am 16.11.2027	6.700	6.883	0,29
5,500 % fällig am 04.04.2053	11.500	11.603	0,49
Summe Polen		33.286	1,41
<b>KATAR STAATSEMISSIONEN</b>			
Qatar Government International Bond 4,400 % fällig am 16.04.2050	21.100	19.239	0,81
4,500 % fällig am 23.04.2028	7.000	7.014	0,30
4,817 % fällig am 14.03.2049	12.465	12.005	0,51
5,103 % fällig am 23.04.2048	1.000	999	0,04
Summe Katar		39.257	1,66
<b>RUMÄNIEN STAATSEMISSIONEN</b>			
Romania Government International Bond 1,750 % fällig am 13.07.2030 (g)	€ 4.200	3.503	0,15
2,000 % fällig am 08.12.2026	300	299	0,01
2,000 % fällig am 14.04.2033	11.300	8.732	0,37
2,124 % fällig am 16.07.2031 (g)	31.610	26.227	1,11
2,124 % fällig am 16.07.2031	1.500	1.245	0,05
2,125 % fällig am 07.03.2028	4.600	4.366	0,18
2,625 % fällig am 02.12.2040	3.950	2.631	0,11
2,750 % fällig am 14.04.2041	7.800	5.236	0,22
2,875 % fällig am 13.04.2042	8.600	5.782	0,25
3,375 % fällig am 28.01.2050	6.200	4.254	0,18
3,500 % fällig am 03.04.2034	3.000	2.609	0,11
3,750 % fällig am 07.02.2034	950	840	0,04
4,125 % fällig am 11.03.2039	1.000	852	0,04
4,625 % fällig am 03.04.2049	2.200	1.856	0,08
5,000 % fällig am 27.09.2026	1.650	1.809	0,08
6,125 % fällig am 22.01.2044	\$ 1.200	1.160	0,05
6,625 % fällig am 27.09.2029	€ 1.900	2.158	0,09
7,625 % fällig am 17.01.2053	\$ 8.600	9.474	0,40
Summe Rumänien		83.033	3,52
<b>RUSLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
MMK International Capital DAC 4,375 % fällig am 13.06.2024 ^	2.800	168	0,01
<b>SENEGAL STAATSEMISSIONEN</b>			
Senegal Government International Bond 4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 1.200	1.131	0,05
5,375 % fällig am 08.06.2037	5.500	4.028	0,17
6,250 % fällig am 23.05.2033	\$ 5.800	4.702	0,20
Summe Senegal		9.861	0,42
<b>SERBIEN STAATSEMISSIONEN</b>			
Serbia Government International Bond 1,000 % fällig am 23.09.2028	€ 6.200	5.250	0,22
1,650 % fällig am 03.03.2033	12.400	9.028	0,38
2,125 % fällig am 01.12.2030	\$ 4.000	3.084	0,13
3,125 % fällig am 15.05.2027	€ 7.300	7.165	0,30
6,500 % fällig am 26.09.2033	\$ 9.500	9.340	0,40
Summe Serbien		33.867	1,43
<b>SINGAPUR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. 4,250 % fällig am 25.03.2027	5.208	4.577	0,19

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Flex Ltd. 4,875 % fällig am 15.06.2029	\$ 200	\$ 191	0,01
United Overseas Bank Ltd. 1,250 % fällig am 14.04.2026	6.500	5.844	0,25
Summe Singapur		10.612	0,45
<b>SÜDAFRIKA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Entwicklungsbank für das südliche Afrika 8,600 % fällig am 21.10.2024 (f) ZAR	253.300	13.178	0,56
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029	\$ 9.100	8.023	0,34
5,750 % fällig am 30.09.2049	21.800	15.486	0,65
10,500 % fällig am 21.12.2026 ZAR	565.700	31.099	1,32
		54.608	2,31
Summe Südafrika		67.786	2,87
<b>SÜDKOREA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Hana Bank 3,500 % fällig am 19.10.2026 (c)(d)	\$ 6.500	5.820	0,25
Hanwha Life Insurance Co. Ltd. 3,379 % fällig am 04.02.2032	6.700	6.004	0,25
Hyundai Capital Services, Inc. 1,250 % fällig am 08.02.2026	8.200	7.317	0,31
KB Kookmin Card Co. Ltd. 1,500 % fällig am 13.05.2026	10.000	8.858	0,37
4,000 % fällig am 09.06.2025	7.900	7.594	0,32
Kodit Global Co. Ltd. 4,954 % fällig am 25.05.2026	1.200	1.182	0,05
Kookmin Bank 2,500 % fällig am 04.11.2030 (d)	2.500	2.031	0,09
Mirae Asset Securities Co. Ltd. 1,375 % fällig am 07.07.2024	17.600	16.674	0,71
NongHyup Bank 1,250 % fällig am 28.07.2026	13.000	11.418	0,48
Shinhan Bank Co. Ltd. 4,375 % fällig am 13.04.2032 (d)	9.000	8.208	0,35
Shinhan Card Co. Ltd. 1,375 % fällig am 19.10.2025	3.000	2.714	0,11
1,375 % fällig am 23.06.2026	3.000	2.637	0,11
Shinhan Financial Group Co. Ltd. 2,875 % fällig am 12.05.2026 (c)(d)	8.000	7.050	0,30
3,340 % fällig am 05.02.2030 (d)	5.100	4.885	0,21
SK Hynix, Inc. 2,375 % fällig am 19.01.2031	5.300	4.091	0,17
Woori Card Co. Ltd. 1,750 % fällig am 23.03.2026	6.000	5.330	0,23
		101.813	4,31
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Export-Import Bank of Korea 2,125 % fällig am 18.01.2032	7.200	5.901	0,25
4,875 % fällig am 11.01.2026	200	198	0,01
5,125 % fällig am 11.01.2033	8.400	8.617	0,36
Korea Expressway Corp. 1,125 % fällig am 17.05.2026	4.800	4.253	0,18
Korea Water Resources Corp. 3,500 % fällig am 27.04.2025	6.500	6.267	0,27
		25.236	1,07
Summe Südkorea		127.049	5,38
<b>SPANIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Santander S.A. 5,147 % fällig am 18.08.2025	9.600	9.434	0,40

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>SRI LANKA STAATSEMISSIONEN</b>			
Sri Lanka Government International Bond 5,750 % fällig am 18.04.2023 ^	\$ 6.900	\$ 3.147	0,13
5,875 % fällig am 25.07.2022 ^	1.236	575	0,02
6,125 % fällig am 03.06.2025 ^	3.700	1.765	0,08
6,200 % fällig am 11.05.2027 ^	4.100	1.888	0,08
6,750 % fällig am 18.04.2028 ^	6.800	3.131	0,13
6,825 % fällig am 18.07.2026 ^	3.800	1.800	0,08
6,850 % fällig am 14.03.2024 ^	900	414	0,02
6,850 % fällig am 03.11.2025 ^	3.000	1.430	0,06
7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	16.800	7.735	0,33
7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	1.600	737	0,03
Summe Sri Lanka		22.622	0,96
<b>ÜBERNATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
African Export-Import Bank 2,634 % fällig am 17.05.2026	5.500	4.977	0,21
Asian Development Bank 4,700 % fällig am 12.03.2024 MXN	89.800	4.951	0,21
6,550 % fällig am 26.01.2025 ZAR	118.000	5.985	0,25
Banque Ouest Africaine de Developpement 2,750 % fällig am 22.01.2033	€ 5.400	4.301	0,18
5,000 % fällig am 27.07.2027	\$ 800	733	0,03
Eastern & Southern African Trade & Development Bank 4,125 % fällig am 30.06.2028	6.900	5.448	0,23
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 5,310 % fällig am 05.02.2026 ZAR	114.000	5.564	0,24
International Finance Corp. 8,000 % fällig am 09.10.2023 IDR	57.500.000	3.852	0,16
		35.811	1,51
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ghana Government International Bond 10,750 % fällig am 14.10.2030 ^	\$ 200	135	0,01
Summe Supranational		35.946	1,52
<b>SCHWEIZ UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Credit Suisse AG 4,750 % fällig am 09.08.2024	4.100	4.008	0,17
UBS Group AG 4,490 % fällig am 05.08.2025	4.200	4.107	0,17
6,373 % fällig am 15.07.2026	3.200	3.181	0,14
Summe Schweiz		11.296	0,48
<b>TANSANIA KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania 9,048 % fällig am 26.04.2028	€ 5.273	5.673	0,24
<b>TUNESIEN STAATSEMISSIONEN</b>			
Banque Centrale de Tunisie Government International Bond 5,625 % fällig am 17.02.2024	4.300	3.902	0,17
5,750 % fällig am 30.01.2025 (g)	\$ 1.400	937	0,04
6,375 % fällig am 15.07.2026	€ 900	572	0,02
6,750 % fällig am 31.10.2023	1.201	1.220	0,05
Summe Tunesien		6.631	0,28

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>TÜRKEI</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Akbank T.A.S. 6,800 % fällig am 22.06.2031 (d)	\$ 6.500	\$ 5.942	0,25
Turkish Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.09.2028	200	184	0,01
		6.126	0,26
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Export-Credit Bank of Turkey 5,750 % fällig am 06.07.2026	11.000	9.965	0,42
8,250 % fällig am 24.01.2024	900	899	0,04
Turkey Government International Bond 4,875 % fällig am 16.04.2043	8.200	5.284	0,22
5,125 % fällig am 17.02.2028	2.500	2.180	0,09
5,750 % fällig am 11.05.2047	23.700	16.254	0,69
5,875 % fällig am 26.06.2031	2.400	2.006	0,09
5,950 % fällig am 15.01.2031	900	761	0,03
6,000 % fällig am 14.01.2041	0	0	0,00
6,875 % fällig am 17.03.2036	0	0	0,00
9,125 % fällig am 13.07.2030	5.300	5.267	0,22
		42.616	1,80
Summe Türkei		48.742	2,06
<b>UKRAINE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
NPC Ukrenergo 6,875 % fällig am 09.11.2028 ^	8.100	1.741	0,08
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
State Agency of Roads of Ukraine 6,250 % fällig am 24.06.2030 ^	\$ 7.900	1.722	0,07
Ukraine Government International Bond 4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	€ 2.700	644	0,03
6,875 % fällig am 21.05.2031 ^	\$ 8.300	1.916	0,08
7,253 % fällig am 15.03.2035 ^	23.400	5.453	0,23
7,375 % fällig am 25.09.2034 ^	5.900	1.385	0,06
7,750 % fällig am 01.09.2024 ^	3.900	979	0,04
7,750 % fällig am 01.09.2025 ^	6.800	1.736	0,07
7,750 % fällig am 01.09.2026 ^	12.300	2.996	0,13
7,750 % fällig am 01.09.2027 ^	9.000	2.172	0,09
7,750 % fällig am 01.09.2028 ^	100	24	0,00
8,994 % fällig am 01.02.2026 ^	4.300	1.088	0,05
		20.115	0,85
Summe Ukraine		21.856	0,93
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
First Abu Dhabi Bank PJSC 4,774 % fällig am 06.06.2028	6.500	6.447	0,27
MDGH GMTN RSC Ltd. 3,700 % fällig am 07.11.2049	3.000	2.392	0,10
3,950 % fällig am 21.05.2050	800	667	0,03
5,084 % fällig am 22.05.2053	2.000	1.993	0,09
Sweihan PV Power Co. PJSC 3,625 % fällig am 31.01.2049	4.965	4.019	0,17
		15.518	0,66
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
NMC OpCo Ltd. 11,255 % fällig am 25.03.2027	AED 25.528	7.019	0,30
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,125 % fällig am 30.09.2049	\$ 800	588	0,02
3,875 % fällig am 16.04.2050	4.600	3.879	0,16
Emirate of Dubai Government International Bond 3,900 % fällig am 09.09.2050	700	508	0,02
Finanzministerium der Regierung von Schardscha 4,000 % fällig am 28.07.2050	4.800	3.084	0,13
4,375 % fällig am 10.03.2051	3.000	2.061	0,09
6,500 % fällig am 23.11.2032	12.300	12.719	0,54
		22.839	0,96
Summe Vereinigte Arabische Emirate		45.376	1,92
<b>GROSSBRITANNIEN</b>			

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Barclays PLC 5,304 % fällig am 09.08.2026	\$ 6.000	\$ 5.855	0,25
5,746 % fällig am 09.08.2033	1.000	968	0,04
HSBC Holdings PLC 3,803 % fällig am 11.03.2025	300	294	0,01
5,210 % fällig am 11.08.2028	2.500	2.447	0,10
Lloyds Banking Group PLC 4,716 % fällig am 11.08.2026	2.600	2.527	0,11
NatWest Group PLC 4,269 % fällig am 22.03.2025	200	197	0,01
5,076 % fällig am 17.01.2030	300	286	0,01
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC 7,875 % fällig am 15.07.2028 ^	6.500	2.490	0,11
8,250 % fällig am 09.07.2026 ^	3.100	1.194	0,05
Ukreximbank Via Biz Finance PLC 9,750 % fällig am 22.01.2025	650	569	0,02
		16.827	0,71
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Canada Square Funding PLC 5,316 % fällig am 17.01.2030	£ 2.016	2.548	0,11
Polaris PLC 6,141 % fällig am 23.05.2059	5.080	6.471	0,27
6,154 % fällig am 27.05.2057	322	409	0,02
Rochester Financing PLC 5,602 % fällig am 18.12.2044	2.033	2.554	0,11
Stratton Mortgage Funding PLC 5,765 % fällig am 12.03.2052	515	653	0,03
Towd Point Mortgage Funding PLC 6,097 % fällig am 20.05.2045	853	1.082	0,04
6,546 % fällig am 20.02.2054	2.079	2.644	0,11
Tower Bridge Funding PLC 5,629 % fällig am 20.12.2063	1.476	1.867	0,08
		18.228	0,77
Summe Großbritannien		35.055	1,48
<b>USA</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,630 % fällig am 25.02.2037	\$ 700	673	0,03
6,275 % fällig am 25.11.2035	639	622	0,03
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 3,156 % fällig am 25.01.2037 ^	2.325	728	0,03
Long Beach Mortgage Loan Trust 5,450 % fällig am 25.09.2036	801	510	0,02
MASTR Asset-Backed Securities Trust 5,590 % fällig am 25.11.2036	888	529	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,945 % fällig am 25.03.2034	739	713	0,03
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 5,300 % fällig am 25.07.2036	172	155	0,01
Option One Mortgage Loan Trust 5,370 % fällig am 25.05.2037	230	136	0,01
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,930 % fällig am 25.09.2035	1.000	841	0,04
Saxon Asset Securities Trust 5,460 % fällig am 25.09.2037	44	41	0,00
Soundview Home Loan Trust 5,330 % fällig am 25.02.2037	194	56	0,00
6,050 % fällig am 25.10.2037	124	97	0,00
		5.101	0,22
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Alphabet, Inc. 2,250 % fällig am 15.08.2060	\$ 4.100	2.497	0,10
Bank of America Corp. 0,981 % fällig am 25.09.2025	8.700	8.177	0,35
Credit Suisse AG AT1 Claim ^	2.100	84	0,00
Ford Motor Co. 3,250 % fällig am 12.02.2032	12.000	9.451	0,40

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
JPMorgan Chase & Co. 0,653 % fällig am 16.09.2024	\$ 2.600	\$ 2.570	0,11
Morgan Stanley 0,864 % fällig am 21.10.2025	2.500	2.326	0,10
Pricoa Global Funding 4,200 % fällig am 28.08.2025	450	436	0,02
Rutas 2 and 7 Finance Ltd. 0,000 % fällig am 30.09.2036 (b)	4.680	3.069	0,13
Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % fällig am 09.09.2026	12.000	11.792	0,50
		40.402	1,71
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc. 4,407 % fällig am 15.11.2061	3.300	3.137	0,13
Benchmark Mortgage Trust 4,261 % fällig am 10.10.2051	4.400	4.065	0,17
CitiMortgage Alternative Loan Trust 5,800 % fällig am 25.10.2036	75	63	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust 5,500 % fällig am 25.05.2036 ^	118	48	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 3,519 % fällig am 30.11.2037	586	538	0,02
IndyMac Mortgage Loan Trust 3,062 % fällig am 25.11.2037	204	167	0,01
5,510 % fällig am 25.02.2037	255	246	0,01
5,790 % fällig am 25.07.2045	56	44	0,00
JPMorgan Resecuritization Trust 2,500 % fällig am 25.03.2056	32	30	0,00
Lehman XS Trust 5,530 % fällig am 25.09.2046	210	180	0,01
5,650 % fällig am 25.08.2037	747	682	0,03
Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,300 % fällig am 25.02.2037	397	358	0,02
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 3,732 % fällig am 25.10.2037 ^	61	54	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,883 % fällig am 25.03.2036	192	175	0,01
		9.787	0,41
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2053	1.300	1.103	0,05
3,500 % fällig am 01.08.2053	2.600	2.372	0,10
		3.475	0,15
<b>US-SCHATZOBBLIGATIONEN</b>			
U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.02.2042 (g)	8.600	6.700	0,28
3,250 % fällig am 15.05.2042	66.400	59.285	2,51
3,375 % fällig am 15.08.2042	25.500	23.158	0,98
U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 31.08.2029	37.800	35.910	1,52
		125.053	5,29
Summe USA		183.818	7,78
<b>URUGUAY</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Uruguay Government International Bond 4,975 % fällig am 20.04.2055	14.600	14.243	0,60
5,100 % fällig am 18.06.2050	14.418	14.403	0,61
5,750 % fällig am 28.10.2034	11.200	12.120	0,52
7,625 % fällig am 21.03.2036	0	0	0,00
7,875 % fällig am 15.01.2033	0	0	0,00
Summe Uruguay		40.766	1,73
<b>VIETNAM</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Vietnam Government International Bond 4,800 % fällig am 19.11.2024	1.000	984	0,04

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	\$ 6.243		0,26	Electricite de France S.A. 5,510 % fällig am 03.08.2023	\$ 2.600	\$ 2.586	0,11	Mondelez International, Inc. 5,370 % fällig am 24.07.2023	\$ 900	\$ 897	0,04
		\$ 6.135		5,510 % fällig am 04.08.2023	2.650	2.635	0,11	5,370 % fällig am 25.07.2023	350	349	0,02
								5,400 % fällig am 19.07.2023	750	748	0,03
								5,430 % fällig am 13.07.2023	2.600	2.595	0,11
								5,430 % fällig am 14.07.2023	4.000	3.992	0,17
<b>SAMBIA</b>											
<b>STAATSEMISSIONEN</b>											
Zambia Government International Bond 5,375 % fällig am 20.09.2022 ^	1.200	633	0,03	Humana, Inc. 5,510 % fällig am 02.08.2023	250	249	0,01	Summe kurzfristige Instrumente		14.349	0,61
8,500 % fällig am 14.04.2024 ^	4.400	2.568	0,11	5,510 % fällig am 03.08.2023	300	298	0,01	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	2.242.384	94,92
Summe Sambia		3.201	0,14								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,120 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 84.900	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 30.04.2024	\$ (86.590)	\$ 84.900	\$ 84.936	3,59
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	6.040	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(6.161)	6.040	6.040	0,26
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (92.751)	\$ 90.940	\$ 90.976	3,85

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	418	\$ 805	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	411	573	0,02
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	17	(38)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	426	(408)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	348	(603)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	665	1.198	0,05
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	3.134	(5.364)	(0,23)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	119	195	0,01
				\$ (3.642)	(0,16)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (3.642)	(0,16)

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 300	\$ 1	0,00

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,585 %	28.06.2026	£ 13.300	\$ (26)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.09.2023	\$ 1.800	25	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	21.09.2024	63.400	2.253	0,11
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	68.300	(283)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.12.2031	1.800	(308)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,415	04.01.2027	BRL 78.000	356	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,453	04.01.2027	44.100	209	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,620	04.01.2027	17.700	100	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,828	02.01.2025	68.400	46	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,220	02.01.2025	160.300	117	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,015	04.01.2027	81.200	(1.062)	(0,05)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	02.01.2025	28.100	(151)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025	28.200	(153)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025	66.100	(401)	0,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,400 %	02.01.2025	BRL	93.200	\$ 568	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.09.2023	\$	1.800	(25)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	30.11.2024	ZAR	346.600	677	0,03
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK	639.600	(157)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	€	12.500	(111)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,455	10.01.2028	PLN	18.000	(37)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,490	10.01.2028		17.100	(41)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,585	18.05.2028	MXN	34.400	(17)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,740	07.03.2028		110.800	75	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,760	19.05.2028		1.600	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,900	21.05.2027		120.600	(67)	0,00
						\$ 1.586	0,07
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						\$ 1.587	0,07

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	4.100	\$ (16)	\$ (19)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	4.100	(16)	(12)	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	2.600	(8)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	2.600	(8)	(13)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	1.900	(4)	(4)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	1.900	(4)	(7)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	2.100	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	2.100	(7)	(10)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	1.900	(5)	(4)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	1.900	(5)	(7)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	3.600	(12)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	3.600	(12)	(15)	0,00
							\$ (104)	\$ (106)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Oman Government International Bond	(1,000) %	20.12.2027	\$ 2.200	\$ 72	\$ (42)	\$ 30	0,00	
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	4.300	715	(260)	455	0,02	
BPS	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	700	23	(13)	10	0,00	
BRC	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	3.400	91	(45)	46	0,00	
CBK	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	15.000	(167)	51	(116)	0,00	
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	2.800	467	(170)	297	0,01	
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	15.000	(167)	51	(116)	0,00	
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2028	43.200	(1.141)	(170)	(1.311)	(0,06)	
MYC	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	2.500	423	(158)	265	0,01	
						\$ 316	\$ (756)	\$ (440)	(0,02)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2031	\$ 1.200	\$ (181)	\$ 63	\$ (118)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	200	1	1	2	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	18.100	13	179	192	0,01
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	6.400	26	86	112	0,01
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2031	11.900	(502)	267	(235)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	9.400	(90)	91	1	0,00

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BPS	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2025	\$ 1.200	\$ (66)	\$ 46	\$ (20)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(20)	8	(12)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2026	10.400	(639)	605	(34)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2027	8.200	(589)	409	(180)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	2	2	4	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.300	9	20	29	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.000	5	44	49	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	4.200	(2)	15	13	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	500	0	2	2	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.100	(5)	27	22	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2026	6.100	54	53	107	0,01
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	700	2	1	3	0,00
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.400	(6)	10	4	0,00
	Serbia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.600	(142)	70	(72)	0,00
South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	32.000	(2.760)	522	(2.238)	(0,09)	
Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.800	(751)	292	(459)	(0,02)	
BRC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	800	(96)	37	(59)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2030	1.400	(194)	68	(126)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	5.800	18	33	51	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.500	14	31	45	0,00
	Hungary Government International Bond	1,000	20.12.2023	4.000	(29)	40	11	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2025	17.500	360	(77)	283	0,01
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	6.500	49	24	73	0,00
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	800	(6)	9	3	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	4.200	(1)	14	13	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(3)	4	1	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	3	(1)	2	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2024	2.300	4	12	16	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.300	0	39	37	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.100	18	19	37	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.000	140	(17)	123	0,01
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.800	(148)	150	2	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	10.400	(638)	271	(367)	(0,01)
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	600	(2)	4	2	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	200	(11)	12	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2031	1.500	(227)	80	(147)	(0,01)
GLM	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2028	9.500	18	101	119	0,01
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	14.000	(34)	74	40	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2028	10.100	37	29	66	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	1	3	4	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	13.700	98	141	239	0,01
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.500	5	1	6	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2024	11.200	50	33	83	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	8.500	77	19	96	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.000	(10)	10	0	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	4.300	(840)	321	(519)	(0,02)
HUS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(1)	2	1	0,00
	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	8.000	(179)	114	(65)	0,00
	Hungary Government International Bond	1,000	20.06.2027	5.700	(290)	212	(78)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2024	7.400	60	16	76	0,00
JPM	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	900	(2)	12	10	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.500	(40)	44	4	0,00
	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	1.500	(289)	178	(111)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	2.800	(173)	143	(30)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2030	2.900	(405)	144	(261)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.400	6	24	30	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2026	15.000	208	64	272	0,01
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	16.300	112	179	291	0,01
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	3.800	0	12	12	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.800	19	32	51	0,00
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	200	(5)	5	0	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	9.800	45	127	172	0,01
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2026	20.000	80	261	341	0,02
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.600	(206)	43	(163)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.800	(356)	139	(217)	(0,01)
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.300	11	12	23	0,00
					\$ (8.393)	\$ 6.060	\$ (2.333)	(0,10)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	07.2023	€	905	\$	989	\$	2	0,00		
	07.2023	ILS	34.300		9.926		677	0,03		
	07.2023	¥	700		5		0	0,00		
	07.2023	PLN	393		94		(3)	0,00		
	07.2023	\$	7.163	€	6.665		109	0,00		
	07.2023		2.337	£	1.848		12	0,00		
	07.2023		29	PLN	122		1	0,00		
BPS	07.2023	€	336	\$	366		0	0,00		
	07.2023	\$	228.990	€	208.990		(982)	(0,04)		
	07.2023		11.951	¥	1.661.103		(458)	(0,02)		
	07.2023		18	MYR	84		0	0,00		
	08.2023	€	208.990	\$	229.312		992	0,04		
	08.2023	MYR	75.495		16.251		28	0,00		
	08.2023	\$	8	CNY	53		0	0,00		
	08.2023	ZAR	189.371		10.176		192	0,01		
	09.2023	\$	3.045	INR	250.285		(2)	0,00		
	11.2023	ILS	25.816		7.485		482	0,02		
BRC	07.2023	\$	15	MYR	70		0	0,00		
	08.2023	COP	38.490.507	\$	9.035		(69)	(0,00)		
	08.2023	ZAR	350.461		18.705		317	(86)	231	0,01
	09.2023	\$	61	ILS	218		(2)	(2)	0,00	
	09.2023	ZAR	253.669		14.363		1.028	0	1.028	0,04
	10.2023	MXN	202.568		10.811		(772)	(772)	(0,03)	
CBK	07.2023	CZK	5.142		234		0	0	0,00	
	07.2023	€	15.747		16.966		(2)	(2)	0,00	
	07.2023	ILS	183.353		56.947		(215)	(214)	(0,01)	
	07.2023	\$	1.348	€	1.232		0	(4)	0,00	
	08.2023	COP	19.735.373	\$	4.667		(1)	(1)	0,00	
	08.2023	ILS	133.218		41.282		5.358	0	5.358	0,23
	11.2023		116.445		34.322		2.735	0	2.735	0,12
	11.2023	\$	1.610	EGP	51.961		(111)	(111)	(0,01)	
DUB	07.2023	ILS	24.133		6.892		385	0	385	0,02
	10.2023	ZAR	152.660		8.383		386	0	386	0,02
	11.2023	EGP	146.354		5.151		930	0	930	0,04
GLM	07.2023	BRL	68.480		14.182		(13)	(13)	0,00	
	07.2023	DOP	659.238		11.385		(415)	(415)	(0,02)	
	07.2023	\$	12.767	BRL	68.263		1.383	0	1.383	0,06
	07.2023		72	PLN	304		3	3	0,00	
	08.2023	DOP	372.278	\$	6.612		(77)	(51)	0,00	
	09.2023	\$	14.182	BRL	69.239		11	11	0,00	
	10.2023	DOP	216.683		3.865		24	0	24	0,00
	11.2023		158.353		2.848		62	0	62	0,00
	11.2023	EGP	25.380		900		168	0	168	0,01
	11.2023	\$	5.231	EGP	158.950		(646)	(646)	(0,03)	
JPM	12.2023	DOP	128.789	\$	2.313		54	0	54	0,00
	07.2023	£	122		154		(1)	(1)	0,00	
	07.2023	¥	565.444		3.954		42	0	42	0,00
	08.2023	COP	11.592.523		2.734		(19)	(19)	0,00	
	08.2023	MXN	222.130		12.821		(27)	(27)	0,00	
	08.2023	\$	8	CNY	56		0	0	0,00	
	08.2023		154	£	122		1	0	1	0,00
	08.2023		3.954	¥	563.041		(42)	(42)	0,00	
	09.2023	COP	7.349.683	\$	1.728		4	4	0,00	
	09.2023	PEN	1.851		503		(5)	(5)	0,00	
	09.2023	\$	59	ILS	209		(2)	(2)	0,00	
	10.2023	MXN	94.231		5.367		(22)	(22)	0,00	
MBC	07.2023	€	1.618		1.735		(30)	(30)	0,00	
	07.2023	£	18.528		22.935		(621)	(621)	(0,03)	
	07.2023	\$	38.868	ILS	141.185		(808)	(808)	(0,03)	
	08.2023		234	ZAR	4.333		(5)	(5)	0,00	
	09.2023		8.698	INR	715.169		(5)	(5)	0,00	
	11.2023		41.667	ILS	150.231		(916)	(916)	(0,04)	
MYI	07.2023	€	7.215	\$	7.857		(15)	(15)	0,00	
	07.2023	£	20		25		0	0	0,00	
	07.2023	\$	114	CZK	2.521		1	0	1	0,00
	07.2023		239	€	219		0	0	0,00	
	07.2023		1.860	£	1.474		14	0	14	0,00
	08.2023		1.621	ZAR	29.663		(57)	(57)	0,00	
	09.2023	AED	26.160	\$	7.122		0	0	0,00	
	11.2023	EGP	40.209		1.425		265	0	265	0,01
RBC	07.2023	\$	20	MXN	394		2	0	2	0,00
	08.2023		12.997		225.246		30	0	30	0,00
SCX	07.2023		74	£	59		1	0	1	0,00
	07.2023		19	MYR	85		0	0	0,00	
	08.2023	CNH	349		51		3	0	3	0,00
	08.2023	\$	50	CNH	343		(3)	(3)	0,00	
	08.2023		36.697	ILS	133.218		(772)	(772)	(0,03)	
SOG	07.2023	€	195.421	\$	210.222		(2.982)	(2.982)	(0,13)	
	07.2023	PLN	1.598		371		(22)	(22)	0,00	
SSB	09.2023	BRL	61.602		12.151		(477)	(477)	(0,02)	
TOR	07.2023	\$	21.195	£	16.680		11	0	11	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
UAG	08.2023	£ 16.680	\$ 21.200	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	0,00
	07.2023	€ 2.860	\$ 3.060	0	(60)	(60)	0,00
	07.2023	\$ 28.664	ILS 100.600	0	(1.555)	(1.555)	(0,07)
	08.2023	ZAR 1.355	\$ 71	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	\$ 51	ILS 181	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	ZAR 83.188	\$ 4.745	372	0	372	0,01
	10.2023	49.197	2.657	80	0	80	0,00
	11.2023	ILS 7.970	2.305	143	0	143	0,01
				\$ 23.870	\$ (12.317)	\$ 11.553	0,49

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 406	CHF 363	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2023	CHF 17.412	\$ 19.469	7	0	7	0,00
	07.2023	\$ 27.869	CHF 25.218	319	0	319	0,01
MBC	08.2023	19.469	17.362	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	CHF 2	\$ 2	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	487	538	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07.2023	\$ 32.107	CHF 28.961	264	0	264	0,01
				\$ 590	\$ (13)	\$ 577	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 1.058	\$ 1.149	\$ 1	\$ (6)	\$ (5)	0,00
BPS	07.2023	\$ 396.548	€ 368.983	6.014	0	6.014	0,25
	07.2023	€ 382.136	\$ 418.682	1.774	(2)	1.772	0,08
CBK	07.2023	\$ 396.560	€ 368.873	5.887	(7)	5.880	0,25
	08.2023	412.433	375.883	0	(1.785)	(1.785)	(0,08)
JPM	07.2023	€ 370.707	\$ 402.816	1	(1.627)	(1.626)	(0,07)
	07.2023	\$ 11.375	€ 10.549	135	(1)	134	0,01
MBC	08.2023	385.865	354.416	1.333	0	1.333	0,06
	07.2023	€ 375.492	\$ 410.000	338	0	338	0,01
SOG	07.2023	\$ 25.373	€ 23.731	518	0	518	0,02
	08.2023	410.573	375.492	0	(350)	(350)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 38.829	\$ 41.694	6	(674)	(668)	(0,03)
	07.2023	\$ 29.612	€ 27.391	271	0	271	0,01
				\$ 21.896	\$ (4.452)	\$ 17.444	0,74

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 13	\$ 17	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2023	\$ 263	£ 208	2	0	2	0,00
	07.2023	46.039	37.219	1.281	(1)	1.280	0,06
BRC	07.2023	£ 27	\$ 34	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 104	£ 82	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£ 940	\$ 1.191	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	\$ 458	£ 362	2	0	2	0,00
MBC	07.2023	45.908	37.082	1.237	0	1.237	0,05
MYI	07.2023	£ 18	\$ 23	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 45.592	£ 36.683	1.045	0	1.045	0,04
				\$ 3.567	\$ (6)	\$ 3.561	0,15

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Investor NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 183	NOK 2.022	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
BPS	07.2023	NOK 1.399	\$ 130	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 130	NOK 1.397	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	NOK 75	\$ 7	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 157	NOK 1.762	8	0	8	0,00
GLM	07.2023	NOK 1.479	\$ 137	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 137	NOK 1.478	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	140	1.548	5	0	5	0,00
				\$ 19	\$ (1)	\$ 18	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Investor SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2023	SEK	8.925	\$ 827	\$ 1	\$ 0	0,00		
	07.2023	\$	8	SEK 84	0	0	0,00		
	08.2023		789	8.509	0	(1)	0,00		
BRC	07.2023		45	483	0	0	0,00		
CBK	07.2023		566	6.178	6	0	0,00		
GLM	07.2023	SEK	1.245	\$ 115	0	0	0,00		
	07.2023	\$	6	SEK 69	0	0	0,00		
MBC	07.2023	SEK	13	\$ 1	0	0	0,00		
	07.2023	\$	530	SEK 5.712	0	(2)	0,00		
MYI	07.2023	SEK	8.523	\$ 789	0	0	0,00		
	07.2023	\$	810	SEK 8.699	0	(5)	0,00		
SCX	08.2023		789	8.512	0	0	0,00		
	07.2023	SEK	205	\$ 19	0	0	0,00		
	07.2023	\$	529	SEK 5.723	1	0	0,00		
						\$ 8	\$ (8)	\$ 0	0,00
Summe Freiverkehrsfinaanzderivate						\$ 30.274		1,28	

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2053 (e)	\$ 650	\$ (551)	(0,02)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (551)	(0,02)

### EINLAGENZERTIFIKATE

Banco Davivienda S.A. 13,501 % fällig am 13.12.2024 15,389 % fällig am 21.02.2024	COP	10.517.000 3.593.000	2.518 873	0,11 0,04
BanColombia S.A. 5,917 % fällig am 27.01.2024 13,320 % fällig am 08.06.2025 13,637 % fällig am 14.12.2024 16,137 % fällig am 01.09.2024		16.789.000 5.439.000 14.365.000 5.832.000	3.870 1.307 3.460 1.413	0,16 0,06 0,15 0,06
BBVA Colombia S.A. 5,870 % fällig am 15.07.2024 14,540 % fällig am 13.01.2024 16,412 % fällig am 25.04.2024		12.069.000 7.110.900 258.000	2.715 1.689 60	0,11 0,07 0,00
Summe Einlagenzertifikate		\$ 17.905		0,76
Summe Anlagen		\$ 2.378.897		100,70
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (16.564)		(0,70)
Nettovermögen		\$ 2.362.333		100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(e) Zum 30. Juni 2023 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,64 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Entwicklungsbank für das südliche Afrika	8,600 %	21.10.2024	07.10.2021	\$ 17.010	\$ 13.178	0,56

(g) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 37.109 USD (31. Dezember 2022: 38.910 USD) und Barmittel in Höhe von 264 USD (31. Dezember 2022: 300 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von 280 USD (31. Dezember 2022: 807 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 15.395 USD (31. Dezember 2022: 18.655 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 4.530 USD (31. Dezember 2022: 6.470 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.215.125	\$ 27.259	\$ 2.242.384
Pensionsgeschäfte	0	90.940	0	90.940
Einlagen bei Kreditinstituten	0	6.492	11.413	17.905
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	932	27.287	0	28.219
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(551)	0	(551)
<b>Summen</b>	<b>\$ 932</b>	<b>\$ 2.339.293</b>	<b>\$ 38.672</b>	<b>\$ 2.378.897</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.396.551	\$ 25.705	\$ 2.422.256
Pensionsgeschäfte	0	44.661	0	44.661
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	1.659	1.659
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	5.273	27.624	(11)	32.886
<b>Summen</b>	<b>\$ 5.273</b>	<b>\$ 2.468.836</b>	<b>\$ 27.353</b>	<b>\$ 2.501.462</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,190 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ (701)	\$ (701)	(0,03)
BPS	3,650	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (19.808)	(21.717)	(0,92)
BRC	4,800	05.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (789)	(793)	(0,03)
MYI	3,900	05.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(3.511)	(3.534)	(0,15)
	4,250	05.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(1.518)	(1.528)	(0,06)
NOM	3,250	05.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(2.171)	(2.188)	(0,09)
	5,050	05.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(4.872)	(4.911)	(0,21)
SCX	3,580	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.449)	(1.589)	(0,07)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (36.961)</b>	<b>(1,56)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 7.190	\$ (5.690)	\$ 1.500	\$ 5	\$ 0	\$ 5
BPS	4.978	(3.290)	1.688	(1.369)	2.060	691
BRC	714	(420)	294	(218)	320	102
CBK	15.561	(14.983)	578	22.572	(21.703)	869
DUB	1.336	(990)	346	(250)	270	20
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
GLM	557	(440)	117	619	(580)	39
GST	(1.439)	1.460	21	(2.119)	2.110	(9)
HUS	1	0	1	1	0	1
JPM	382	(360)	22	(645)	680	35
MBC	(1.547)	1.240	(307)	5.068	(4.320)	748
MYC	631	(540)	91	(538)	760	222
MYI	1.264	(500)	764	23	0	23
RBC	32	0	32	(189)	0	(189)
SCX	(506)	420	(86)	9.690	(9.190)	500
SOG	2.614	(1.930)	684	(20)	0	(20)
SSB	(477)	620	143	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(1.018)	790	(228)	(311)	270	(41)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	85,19	84,95
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	9,73	12,05
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,00	0,17
Pensionsgeschäfte	3,85	1,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,16)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,07	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,28	1,30
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,02)	k. A.
Einlagezertifikate	0,76	0,07
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,56)	(1,56)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	2,30	1,90
Armenien	0,28	0,27
Bahamas	0,36	0,33
Bahrain	0,97	0,93
Benin	0,44	0,36
Bermuda	0,15	0,13
Brasilien	1,77	3,00
Bulgarien	0,25	k. A.
Cayman-Inseln	1,89	2,06
Chile	2,26	2,80
China	0,00	0,01
Kolumbien	2,71	2,57
Costa Rica	0,86	1,12
Zypern	0,27	0,24
Dominikanische Republik	4,41	2,95
Ecuador	1,59	2,19
Ägypten	1,75	2,28
El Salvador	0,73	0,48
Frankreich	k. A.	0,10
Gabun	0,06	k. A.
Georgien	0,39	0,39
Deutschland	k. A.	0,02
Ghana	1,32	1,16
Guernsey, Kanalinseln	0,12	0,12
Hongkong	1,96	1,28
Ungarn	3,39	2,09
Indien	1,38	1,69
Indonesien	2,86	2,63
International	0,22	k. A.
Irland	0,08	0,08
Israel	k. A.	2,24
Elfenbeinküste	0,95	1,27
Jamaika	0,16	0,17
Jersey, Kanalinseln	0,52	0,48
Jordanien	0,66	0,38
Kasachstan	1,19	1,46
Kenia	0,58	0,54
Luxemburg	0,28	0,36
Mazedonien	0,74	k. A.
Malaysia	1,23	0,13
Mauritius	0,40	0,85
Mexiko	2,98	2,31
Mongolei	0,31	0,65
Marokko	0,65	0,77
Multinational	0,02	0,02
Namibia	0,09	0,09
Niederlande	1,36	0,87
Oman	2,89	3,07
Panama	3,26	2,85
Paraguay	1,03	0,91
Peru	1,42	1,36
Philippinen	1,45	1,24
Polen	1,41	0,40
Katar	1,66	1,81
Rumänien	3,52	2,26
Russland	0,01	0,04
Senegal	0,42	0,41
Serbien	1,43	0,84
Singapur	0,45	0,43
Südafrika	2,87	3,59
Südkorea	5,38	4,60
Spanien	0,40	0,38
Sri Lanka	0,96	0,67
Supranational	1,52	1,81
Schweiz	0,48	0,58

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Tansania	0,24	0,24
Tunesien	0,28	0,34
Türkei	2,06	2,08
Ukraine	0,93	0,78
Vereinigte Arabische Emirate	1,92	1,00
Großbritannien	1,48	1,65
USA	7,78	7,06
Uruguay	1,73	1,65
Usbekistan	k. A.	0,03
Vietnam	0,04	0,04
Jungferninseln (Britisch)	0,26	0,73
Sambia	0,14	0,12
Kurzfristige Instrumente	0,61	8,43
Pensionsgeschäfte	3,85	1,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,16)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,07	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen		0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	(0,02)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	(0,10)	(0,18)
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,49	0,21
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,91	1,27
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,02)	k. A.
Einlagenzertifikate	0,76	0,07
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,70)	(0,35)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Corporate Bond Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>								<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
Ecopetrol S.A. TBD % fällig am 17.08.2024	\$ 1.000	\$ 985	0,62	IRISA Norte Finance Ltd. 8,750 % fällig am 30.05.2024	\$ 6	\$ 6	0,00	Abu Dhabi National Energy Co. PJSC 4,375 % fällig am 24.01.2029	\$ 1.100	\$ 1.088	0,68
Eifenbeinküste 7,985 % fällig am 19.03.2027	€ 800	€ 851	0,53	Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % fällig am 21.01.2032	800	698	0,44	Adani Electricity Mumbai Ltd. 3,949 % fällig am 12.02.2030	400	298	0,19
SOCAR Turkey Enerji A/S 6,553 % fällig am 11.08.2026	1.000	1.058	0,66	Interoceania Finance Ltd. 0,000 % fällig am 30.11.2025 (c)	28	26	0,02	Alfa Desarrollo SpA 4,550 % fällig am 27.09.2051	995	731	0,46
		2.894	1,81	Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	300	20	0,01	ALROSA Finance S.A. 3,100 % fällig am 25.06.2027 ^	1.100	66	0,04
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 3,500 % fällig am 31.03.2027	\$ 700	663	0,41	Kasikornbank PCL 3,343 % fällig am 02.10.2031 (g)	600	530	0,33	Andrade Gutierrez International S.A. (9,000 % bar oder 10,500 % PIK) 9,000 % fällig am 28.12.2029 (a)	1	0	0,00
AIA Group Ltd. 3,600 % fällig am 09.04.2029	1.100	1.019	0,64	Kookmin Bank 2,500 % fällig am 04.11.2030 (g)	1.100	894	0,56	AngloGold Ashanti Holdings PLC 3,375 % fällig am 01.11.2028	200	175	0,11
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC 5,950 % fällig am 15.04.2030 (g)	1.300	78	0,05	Kuwait Projects Co. SPC Ltd. 4,500 % fällig am 23.02.2027	482	411	0,26	3,750 % fällig am 01.10.2030	300	258	0,16
Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % fällig am 10.01.2025	200	193	0,12	MAF Sukuk Ltd. 4,638 % fällig am 14.05.2029	1.000	979	0,61	6,500 % fällig am 15.04.2040	800	807	0,51
Banco de Chile 2,990 % fällig am 09.12.2031	1.400	1.197	0,75	MDGH GMTN RSC Ltd. 5,500 % fällig am 28.04.2033	300	316	0,20	Antofagasta PLC 2,375 % fällig am 14.10.2030	700	571	0,36
Banco de Credito del Peru S.A. 2,700 % fällig am 11.01.2025	1.300	1.243	0,78	Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023	213	212	0,13	5,625 % fällig am 13.05.2032	200	199	0,12
Banco de Credito e Inversiones S.A. 3,500 % fällig am 12.10.2027	400	370	0,23	NBK SPC Ltd. 1,625 % fällig am 15.09.2027	2.000	1.786	1,12	ATP Tower Holdings LLC 4,050 % fällig am 27.04.2026	500	430	0,27
Banco Inbursa S.A. 4,375 % fällig am 11.04.2027	1.325	1.252	0,78	NE Property BV 1,875 % fällig am 09.10.2026	€ 500	474	0,30	Axiata SPV2 Bhd. 2,163 % fällig am 19.08.2030	300	255	0,16
Banco Internacional del Peru SAA Interbank 3,250 % fällig am 04.10.2026	1.000	931	0,58	2,000 % fällig am 20.01.2030	100	81	0,05	Axiata SPV5 Labuan Ltd. 3,064 % fällig am 19.08.2050	500	349	0,22
Banco Mercantil del Norte S.A. 6,625 % fällig am 24.01.2032 (e)(g)	250	193	0,12	NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % fällig am 10.03.2028 (e)	\$ 400	272	0,17	BOC Aviation USA Corp. 6,250 % fällig am 29.04.2024	700	676	0,42
Banco Santander Chile 2,700 % fällig am 10.01.2025	1.200	1.148	0,72	6,250 % fällig am 07.03.2024 (e)	200	147	0,09	Braskem Netherlands Finance BV 4,500 % fällig am 10.01.2028	700	644	0,40
Banco Santander Mexico S.A. 5,375 % fällig am 17.04.2025	1.800	1.782	1,12	OEC Finance Ltd. (4,375 % bar oder 4,375 % PIK) 4,375 % fällig am 25.10.2029 (a)	742	33	0,02	Canacol Energy Ltd. 5,750 % fällig am 24.11.2028	700	599	0,38
Bangkok Bank PCL 3,733 % fällig am 25.09.2034 (g)	400	340	0,21	OEC Finance Ltd. (5,250 % bar oder 5,250 % PIK) 5,250 % fällig am 27.12.2033 (a)	457	22	0,01	Celulosa Arauco y Constitucion S.A. 5,500 % fällig am 30.04.2049	700	587	0,37
Bank Hapoalim B.M. 3,255 % fällig am 21.01.2032 (g)	1.300	1.118	0,70	OEC Finance Ltd. (7,125 % bar oder 7,125 % PIK) 7,125 % fällig am 26.12.2046 (a)	1.657	112	0,07	Champion Path Holdings Ltd. 4,850 % fällig am 27.01.2028	200	162	0,10
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033 (g)	1.300	1.288	0,81	OTP Bank Nyrt 8,750 % fällig am 15.05.2033	200	201	0,13	China Modern Dairy Holdings Ltd. 2,125 % fällig am 14.07.2026	600	514	0,32
Bank Mandiri Persero Tbk PT 2,000 % fällig am 19.04.2026	800	724	0,45	Powerlong Real Estate Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 30.04.2025	1.300	135	0,08	CK Hutchison International Ltd. 4,750 % fällig am 21.04.2028	500	495	0,31
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3,750 % fällig am 30.03.2026 (g)	800	741	0,46	QNB Finance Ltd. 2,625 % fällig am 12.05.2025	500	475	0,30	Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK) 3,000 % fällig am 31.12.2026 (a)	307	182	0,11
BOC Aviation Ltd. 1,750 % fällig am 21.01.2026	700	632	0,40	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,250 % fällig am 23.05.2023 (g)	1.700	102	0,06	Corp. GEO S.A.B. de C.V. 8,875 % fällig am 25.09.2014 ^	850	0	0,00
Cibanco S.A. Ibm 4,962 % fällig am 18.07.2029	900	846	0,53	Seazen Group Ltd. 4,450 % fällig am 13.07.2025	1.400	728	0,46	CSN Inova Ventures 6,750 % fällig am 28.01.2028	700	650	0,41
Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,125 % fällig am 22.10.2025	200	63	0,04	Shinhan Bank Co. Ltd. 4,500 % fällig am 26.03.2028	900	847	0,53	CT Trust 5,125 % fällig am 03.02.2032	1.000	804	0,50
Credicorp Ltd. 2,750 % fällig am 17.06.2025	500	473	0,30	Shinhan Card Co. Ltd. 2,500 % fällig am 27.01.2027	500	446	0,28	Digicel International Finance Ltd. 8,750 % fällig am 25.05.2024	145	133	0,08
Entwicklungsbank für das südliche Afrika 8,600 % fällig am 21.10.2024 (h)	ZAR 22.300	1.160	0,73	+Shriram Finance Ltd. 4,150 % fällig am 18.07.2025	327	309	0,19	Ecopetrol S.A. 6,875 % fällig am 29.04.2030	1.800	1.643	1,03
Emaar Sukuk Ltd. 3,875 % fällig am 17.09.2029	\$ 400	376	0,24	SNB Funding Ltd. 2,900 % fällig am 29.01.2027	1.700	1.591	1,00	7,375 % fällig am 18.09.2043	800	668	0,42
Fab Sukuk Co. Ltd. 2,500 % fällig am 21.01.2025	325	311	0,19	Sovcombank Via SovCom Capital DAC 3,400 % fällig am 26.01.2025 ^	1.100	30	0,02	Energean Israel Finance Ltd. 5,375 % fällig am 30.03.2028	700	633	0,40
3,875 % fällig am 22.01.2024	1.100	1.089	0,68	Standard Chartered PLC 6,170 % fällig am 09.01.2027	500	500	0,31	Fomento Economico Mexicano S.A.B. de C.V. 4,375 % fällig am 10.05.2043	600	528	0,33
4,581 % fällig am 17.01.2028	400	398	0,25	7,767 % fällig am 16.11.2028	700	743	0,46	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 200	151	0,09
First Abu Dhabi Bank PJSC 5,125 % fällig am 13.10.2027	900	913	0,57	Sunac China Holdings Ltd. 6,500 % fällig am 09.07.2023 ^	500	78	0,05	5,000 % fällig am 18.05.2026	\$ 500	376	0,24
Gacfi First Investment Co. 5,125 % fällig am 14.02.2053	500	451	0,28	7,000 % fällig am 09.07.2025 ^	600	91	0,06	5,950 % fällig am 19.10.2025	300	241	0,15
GLP Pte. Ltd. 3,875 % fällig am 04.06.2025	200	139	0,09	Trust Fibra Uno 6,390 % fällig am 15.01.2050	600	475	0,30	Freeport Indonesia PT 4,763 % fällig am 14.04.2027	900	873	0,55
4,500 % fällig am 17.05.2026 (e)	300	112	0,07	Turkiye Is Bankasi A/S 6,125 % fällig am 25.04.2024	200	196	0,12	6,200 % fällig am 14.04.2052	800	723	0,45
Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. 9,620 % fällig am 28.06.2018 ^	MXN 34.709	0	0,00	Woori Bank 4,750 % fällig am 30.04.2024 (g)	1.000	986	0,62	Fresnillo PLC 4,250 % fällig am 02.10.2050	800	600	0,38
Huarong Finance Co. Ltd. 3,375 % fällig am 24.02.2030	\$ 200	152	0,10	Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 17.02.2025 ^	400	3	0,00	GEMS MENASA Cayman Ltd. 7,125 % fällig am 31.07.2026	200	194	0,12
				7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	200	3	0,00	Geopark Ltd. 5,500 % fällig am 17.01.2027	800	651	0,41
				Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026	600	494	0,31	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd. 6,125 % fällig am 15.05.2029	700	709	0,44
						36.941	23,13	Greensaif Pipelines Bidco SARL 6,129 % fällig am 23.02.2038	500	511	0,32
								6,510 % fällig am 23.02.2042	200	208	0,13



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES	
		MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS
Grupo Bimbo S.A.B. de C.V. 4,000 % fällig am 06.09.2049	\$ 500	\$ 405	0,25	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. 6,332 % fällig am 30.09.2027	\$ 588	\$ 600	0,38	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025	\$ 700	\$ 676	0,42
Guara Norte SARL 5,198 % fällig am 15.06.2034	1.415	1.240	0,78	Rede D'or Finance SARL 4,500 % fällig am 22.01.2030	213	182	0,11	IHS Holding Ltd. 5,625 % fällig am 29.11.2026	400	350	0,22
Health & Happiness International Holdings Ltd. 13,500 % fällig am 26.06.2026	800	757	0,47	Reliance Industries Ltd. 2,875 % fällig am 12.01.2032	900	751	0,47	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	750	733	0,46
Hikma Finance USA LLC 3,250 % fällig am 09.07.2025	1.000	949	0,59	ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	300	281	0,18	Israel Electric Corp. Ltd. 3,750 % fällig am 22.02.2032	200	171	0,11
HTA Group Ltd. 7,000 % fällig am 18.12.2025	600	569	0,36	Sands China Ltd. 3,350 % fällig am 08.03.2029	300	250	0,16	4,250 % fällig am 14.08.2028	1.600	1.494	0,94
IHS Netherlands Holdco BV 8,000 % fällig am 18.09.2027	760	695	0,44	4,300 % fällig am 08.01.2026	200	188	0,12	LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % fällig am 04.02.2039	662	595	0,37
Industrias Penoles S.A.B. de C.V. 4,750 % fällig am 06.08.2050	800	637	0,40	4,875 % fällig am 18.06.2030	450	401	0,25	MSU Energy S.A. 6,875 % fällig am 01.02.2025	400	280	0,18
InRetail Consumer 3,250 % fällig am 22.03.2028	1.200	1.032	0,65	5,625 % fällig am 08.08.2025	300	293	0,18	NGD Holdings BV 6,750 % fällig am 31.12.2026	284	209	0,13
Invepar Holdings LLC 1,000 % fällig am 31.12.2049 (h)	210	0	0,00	5,900 % fällig am 08.08.2028	900	859	0,54	Peru LNG SRL 5,375 % fällig am 22.03.2030	500	403	0,25
Inversiones CMPC S.A. 3,000 % fällig am 06.04.2031	500	414	0,26	Sasol Financing USA LLC 5,875 % fällig am 27.03.2024	500	494	0,31	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 5,250 % fällig am 24.01.2042	300	268	0,17
JSW Steel Ltd. 5,050 % fällig am 05.04.2032	600	486	0,30	6,500 % fällig am 27.09.2028	1.700	1.522	0,95	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	887	893	0,56
KazMunayGas National Co. JSC 5,750 % fällig am 19.04.2047	200	163	0,10	Saudi Arabian Oil Co. 2,250 % fällig am 24.11.2030	1.600	1.334	0,84	9,250 % fällig am 06.07.2024	56	56	0,04
6,375 % fällig am 24.10.2048	1.500	1.286	0,81	4,250 % fällig am 16.04.2039	1.500	1.326	0,83	9,750 % fällig am 06.01.2027	500	517	0,32
Kosmos Energy Ltd. 7,125 % fällig am 04.04.2026	1.010	889	0,56	Seplat Energy PLC 7,750 % fällig am 01.04.2026	400	337	0,21	Saudi Electricity Sukuk Programme Co. 5,684 % fällig am 11.04.2053	400	397	0,25
7,750 % fällig am 01.05.2027	200	172	0,11	Severstal OAO Via Steel Capital S.A. 3,150 % fällig am 16.09.2024 ^	800	38	0,02	Southern Gas Corridor CJSC 6,875 % fällig am 24.03.2026	900	916	0,57
Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030	200	169	0,11	Sitios Latinoamerica S.A.B. de C.V. 5,375 % fällig am 04.04.2032	900	816	0,51	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	405	398	0,25
Leviathan Bond Ltd. 6,500 % fällig am 30.06.2027	800	768	0,48	SK Hynix, Inc. 2,375 % fällig am 19.01.2031	800	618	0,39	Thaioil Treasury Center Co. Ltd. 3,750 % fällig am 18.06.2050	700	469	0,29
LG Chem Ltd. 3,625 % fällig am 15.04.2029	1.600	1.494	0,94	4,400 % fällig am 16.01.2028	400	402	0,25			9.469	5,93
Medco Oak Tree Pte. Ltd. 7,375 % fällig am 14.05.2026	700	689	0,43	SMC Global Power Holdings Corp. 5,450 % fällig am 09.12.2026 (e)	400	291	0,18	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		112.159	70,23
Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	600	572	0,36	Stillwater Mining Co. 4,000 % fällig am 16.11.2026	1.400	1.250	0,78	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
5,375 % fällig am 04.12.2029	400	332	0,21	Studio City Co. Ltd. 7,000 % fällig am 15.02.2027	800	750	0,47	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.09.2053	3.100	3.040	1,90
5,625 % fällig am 17.07.2027	700	635	0,40	Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 5,950 % fällig am 17.07.2026	600	599	0,38	<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>			
5,750 % fällig am 21.07.2028	400	354	0,22	Suzano Austria GmbH 3,750 % fällig am 15.01.2031	300	256	0,16	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045	8.000	6.762	4,23
Metalsa S.A. de C.V. 3,750 % fällig am 04.05.2031	800	631	0,39	7,000 % fällig am 16.03.2047	400	404	0,25	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Metinvest BV 5,625 % fällig am 17.06.2025	€ 850	658	0,41	Telecomunicaciones Digitales S.A. 4,500 % fällig am 30.01.2030	300	255	0,16	Canada Square Funding PLC 5,316 % fällig am 17.01.2059	£ 92	116	0,07
MGM China Holdings Ltd. 5,375 % fällig am 15.05.2024	\$ 800	788	0,49	Tengzhchevroil Finance Co. International Ltd. 3,250 % fällig am 15.08.2030	700	536	0,34	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates 5,380 % fällig am 25.10.2035	\$ 404	375	0,23
Nakilat, Inc. 6,067 % fällig am 31.12.2033	357	374	0,23	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 3,750 % fällig am 09.05.2027	€ 1.900	1.880	1,19	Citigroup Mortgage Loan Trust 3,938 % fällig am 25.08.2036	271	239	0,15
OAS Restructuring BVI Ltd. 5,000 % fällig am 31.03.2035 (h)	BRL 475	5	0,00	TMS Issuer SARL 5,780 % fällig am 23.08.2032	\$ 200	206	0,13	Countrywide Alternative Loan Trust 5,797 % fällig am 20.12.2035	48	45	0,03
OCP S.A. 5,125 % fällig am 23.06.2051	\$ 1.400	1.024	0,64	Turkish Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.09.2028	649	598	0,37	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 3,884 % fällig am 25.11.2037	32	29	0,02
6,875 % fällig am 25.04.2044	500	461	0,29	Unigel Luxembourg S.A. 8,750 % fällig am 01.10.2026	900	296	0,19	Polaris PLC 6,154 % fällig am 27.05.2057	£ 46	58	0,04
Odebrecht Holdco Finance Ltd. 0,000 % fällig am 10.09.2058 (c)	3.424	22	0,01	Vale Overseas Ltd. 3,750 % fällig am 08.07.2030	400	352	0,22	Rochester Financing PLC 5,602 % fällig am 18.12.2044	131	165	0,10
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd. 0,000 % fällig am 31.07.2023 (c)(e)	1.416	3	0,00	6,875 % fällig am 21.11.2036	700	733	0,46	Tower Bridge Funding PLC 5,629 % fällig am 20.12.2063	87	110	0,07
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd. 3,750 % fällig am 27.07.2026	1.000	946	0,59	Vale S.A. 0,000 % (e)	BRL 6.700	427	0,27			1.137	0,71
Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	300	289	0,18	Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024	\$ 500	488	0,31	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Pertamina Persero PT 5,625 % fällig am 20.05.2043	800	772	0,48	5,500 % fällig am 15.01.2026	500	465	0,29	Citigroup Mortgage Loan Trust 7,250 % fällig am 25.05.2036	\$ 361	192	0,12
Petron Corp. 5,950 % fällig am 19.04.2026 (e)	300	279	0,17	YPF S.A. 6,950 % fällig am 21.07.2027	300	247	0,15	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,370 % fällig am 25.09.2037 ^	36	37	0,02
Petronas Capital Ltd. 3,404 % fällig am 28.04.2061	700	500	0,31	Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	500	450	0,28	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 5,340 % fällig am 25.04.2037	136	89	0,06
Petrorio Luxembourg Trading SARL 6,125 % fällig am 09.06.2026	500	481	0,30	Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % fällig am 13.01.2026	700	638	0,40	JPMorgan Mortgage Acquisition Corp. 6,125 % fällig am 25.12.2035	1.100	992	0,62
Prosus NV 3,061 % fällig am 13.07.2031	1.300	1.017	0,64			65.749	41,17	NovaStar Mortgage Funding Trust 5,350 % fällig am 25.09.2037	108	105	0,07
3,257 % fällig am 19.01.2027	200	181	0,11	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>						1.415	0,89
4,987 % fällig am 19.01.2052	1.000	722	0,45	Cikarang Listrindo Tbk PT 4,950 % fällig am 14.09.2026	500	477	0,30				
				Empresa Electrica Cochran SpA 5,500 % fällig am 14.05.2027	180	167	0,10				

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>STAATSEMISSIONEN</b>														
Argentina Government International Bond 0,500 % fällig am 09.07.2030	\$ 18	\$ 5	0,00		Ukraine Government International Bond 4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	€ 300	72	0,05		5,450 % fällig am 13.07.2023	300	300	0,19	
1,500 % fällig am 09.07.2035	11	3	0,00		7,750 % fällig am 01.09.2026 ^	\$ 300	73	0,05						
Chile Government International Bond 4,340 % fällig am 07.03.2042	900	801	0,50				6.844	4,29						1,146 0,72
Colombia Government International Bond 4,500 % fällig am 28.01.2026	1.000	954	0,60		<b>AKTIEN</b>									
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP 25.900	505	0,32		<b>STAMMAKTIEEN</b>					<b>ENERGIE</b>				
Dominican Republic Government International Bond 5,300 % fällig am 21.01.2041	\$ 200	157	0,10		Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (b)(h)					361.648 39 0,02				
7,050 % fällig am 03.02.2031	200	200	0,13		<b>FINANZWERTE</b>					<b>BAUSTOFFE</b>				
Export-Credit Bank of Turkey 8,250 % fällig am 24.01.2024	600	600	0,38		Hipotecaria Su Casita S.A. (b)					332.624 0 0,00				
9,375 % fällig am 31.01.2026	300	299	0,19		Petra Diamonds Ltd. (b)					331.402 284 0,18				
Ungarische Entwicklungsbank 6,500 % fällig am 29.06.2028	200	198	0,12		<b>OPTIONSSCHEINE</b>					175.616 0 0,00				
Oman Government International Bond 6,250 % fällig am 25.01.2031	400	407	0,25		<b>PAR (000S)</b>									
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN 800	228	0,14		<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>					<b>COMMERCIAL PAPER</b>				
Poland Government International Bond 4,250 % fällig am 14.02.2043	€ 400	429	0,27		Dominion Resources, Inc. 5,430 % fällig am 31.07.2023					\$ 0 25 249 0,15				
Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033	400	309	0,19		Electricite de France S.A. 5,510 % fällig am 03.08.2023					0 30 298 0,19				
4,625 % fällig am 03.04.2049	500	422	0,26		Mondelez International, Inc. 6,375 % fällig am 14.07.2023					\$ 300 \$ 299 0,19				
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	\$ 300	300	0,19		National Grid Holdings Ltd.									
5,000 % fällig am 18.01.2053	200	186	0,12											
Turkey Government International Bond 4,875 % fällig am 16.04.2043	300	193	0,12											
9,375 % fällig am 19.01.2033	\$ 500	\$ 503	0,31											

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 449	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (458)	\$ 449	\$ 449	0,28
	5,060	30.06.2023	03.07.2023	3.500	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 15.11.2031	(3.570)	3.500	3.500	2,19
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (4.028)</b>	<b>\$ 3.949</b>	<b>\$ 3.949</b>	<b>2,47</b>

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	23	\$ 32	0,02
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	187	(534)	(0,34)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	18	(37)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	20	(39)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	7	8	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	39	(77)	(0,05)
				\$ (647)	(0,41)
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ (647)</b>	<b>(0,41)</b>

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.06.2026	€ 100	\$ (5)	0,00

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	\$ 3.800	\$ 10	0,01
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	400	11	0,01
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	2.400	17	0,01
iTraxx Asia Ex-Japan 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	3.500	39	0,02
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000	20.06.2028	€ 1.100	30	0,02
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	1.900	20	0,01
				\$ 127	0,08

**ZINSSWAPS**

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,000 %	21.09.2024	\$ 12.500	\$ 429	0,27
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,750	21.06.2047	1.700	182	0,11
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,090	04.01.2027	BRL 6.500	8	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR		2,665	15.03.2028	KRW 999.100	(3)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,750	21.09.2023	\$ 1.700	17	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		7,205	22.04.2027	ZAR 7.200	17	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		7,210	22.04.2027	35.600	(27)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		4,611	06.06.2028	CZK 17.200	(5)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,930	29.06.2028	PLN 1.700	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,207	19.06.2028	MXN 6.900	(3)	0,00
						\$ 614	0,38
						\$ 736	0,46

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	America Movil S.A.B. de C.V.	1,000 %	20.12.2025	\$ 1.200	\$ (30)	\$ 42	\$ 12	0,01
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2028	500	(87)	12	(75)	(0,05)
CBK	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	50	0	1	1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	900	(42)	10	(32)	(0,02)
GST	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	1	1	2	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	400	(9)	6	(3)	0,00
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	400	(9)	8	(1)	0,00
					\$ (176)	\$ 80	\$ (96)	(0,06)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 31	\$ 34	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	PLN 2.207	542	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 198	CNY 1.361	0	(10)	(10)	(0,01)
	09.2023	PHP 17.450	\$ 315	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 105	HKD 822	0	0	0	0,00
	11.2023	519	ILS 1.865	0	(13)	(13)	(0,01)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BPS	07.2023	CZK	\$	34	\$	0	0,00			
	07.2023	\$	€	5.835		(27)	(0,02)			
	08.2023	CNH	\$	898		44	0,03			
	08.2023	€		6.403		28	0,02			
	08.2023	\$	CNY	1.601		(13)	(0,01)			
	08.2023		ZAR	475		0	0,00			
	08.2023	ZAR	\$	36		1	0,00			
	10.2023			407		10	0,01			
	11.2023	ILS		1.152		70	0,04			
	08.2023	COP	1.828.778		429		(3)	0,00		
08.2023	\$		ZAR	575		(1)	0,00			
08.2023		504	BRL	2.456		3	0,00			
07.2023	€	94	\$	101		(2)	0,00			
07.2023	ILS	5.208		1.570	166	166	0,10			
07.2023	\$	93	€	85		0	0,00			
07.2023		698	£	552		4	0,00			
08.2023	COP	1.339.576	\$	317		0	0,00			
09.2023		285.244		68		1	0,00			
07.2023	BRL	1.499		277		(34)	(0,02)			
10.2023	ZAR	6.500		357	16	16	0,01			
07.2023	DOP	24.918		430		(16)	(0,01)			
07.2023	\$	312	BRL	1.504		0	0,00			
09.2023	BRL	1.521	\$	312		0	0,00			
09.2023	\$	425	THB	15.007		1	0,00			
10.2023	ZAR	2.087	\$	112		3	0,00			
08.2023	CNH	2.932		424	20	20	0,01			
08.2023	COP	786.729		186		(1)	0,00			
08.2023	\$	247	CNY	1.689		(13)	(0,01)			
08.2023	ZAR	480	\$	25		(1)	0,00			
09.2023	COP	370.343		87		0	0,00			
09.2023	\$	4	ILS	13		0	0,00			
09.2023		360	MXN	6.245		(1)	0,00			
07.2023	£	1.101	\$	1.363		(37)	(0,02)			
09.2023	\$	331	IDR	4.964.613		(1)	0,00			
09.2023		504	INR	41.455		0	0,00			
07.2023		5	€	4		0	0,00			
07.2023		1.451	ILS	5.226		(42)	(0,03)			
07.2023		299	MYR	1.394		0	0,00			
09.2023	PEN	829	\$	227		(1)	0,00			
09.2023	\$	331	PEN	1.208		0	0,00			
11.2023		1.145	ILS	4.047		(48)	(0,03)			
07.2023	¥	430.000	\$	3.294	311	311	0,19			
08.2023	CNH	1.390		202	10	10	0,01			
08.2023	\$	657	CNY	4.484		(36)	(0,02)			
07.2023	€	5.795	\$	6.234		(88)	(0,05)			
07.2023	\$	1.399	£	1.101		1	0,00			
08.2023	£	1.101	\$	1.399		(1)	0,00			
08.2023	ZAR	7.538		393		(5)	0,00			
09.2023	\$	96	ZAR	1.685		(8)	0,00			
11.2023	ILS	1.993	\$	576	36	36	0,02			
				\$	725	\$	(403)	\$	322	0,20

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BPS	07.2023	CHF	\$	3.382	\$	1	0,00			
	07.2023	\$	CHF	4.088		51	0,03			
	08.2023			3.016		(1)	0,00			
JPM	07.2023	CHF	\$	22		0	0,00			
MBC	07.2023			7		0	0,00			
MYI	07.2023	145		160		(2)	0,00			
SCX	07.2023	\$	CHF	2.921		14	0,01			
UAG	07.2023	CHF	\$	3.484		(7)	0,00			
	07.2023	\$	CHF	2.632		13	0,01			
	08.2023			3.114		7	0,00			
				\$	86	\$	(10)	\$	76	0,05

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	\$	14	\$	0	0,00
	07.2023	\$	€	38.150		622	0,39
BPS	07.2023	€	\$	42.244		181	0,11

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	\$ 40.945	€ 38.088	\$ 609	\$ 0	\$ 609	0,38
	08.2023	42.098	38.367	0	(182)	(182)	(0,11)
CBK	07.2023	€ 39.264	\$ 42.667	0	(170)	(170)	(0,11)
	08.2023	\$ 40.863	€ 37.532	141	0	141	0,09
JPM	07.2023	€ 38.338	\$ 41.861	34	0	34	0,02
	07.2023	\$ 1.995	€ 1.866	41	0	41	0,03
	08.2023	41.920	38.338	0	(36)	(36)	(0,02)
MBC	07.2023	€ 30	\$ 32	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 5	€ 5	0	0	0	0,00
SOG	07.2023	40.973	38.088	581	0	581	0,36
				\$ 2.209	\$ (389)	\$ 1.820	1,14
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 2.122	1,33

BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Banco Davivienda S.A. 13,501 % fällig am 13.12.2024	COP 714.000	\$ 171	0,11
BanColombia S.A. 5,917 % fällig am 27.01.2024	1.097.400	253	0,16
13,320 % fällig am 08.06.2025	369.000	89	0,05
13,637 % fällig am 14.12.2024	978.000	235	0,15
16,137 % fällig am 01.09.2024	400.000	97	0,06
BBVA Colombia S.A. 5,870 % fällig am 15.07.2024	816.000	184	0,11
14,540 % fällig am 13.01.2024	467.400	111	0,07
Summe Einlagenzertifikate		\$ 1.140	0,71
Summe Anlagen		\$ 161.716	101,24
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (1.983)	(1,24)
Nettovermögen		\$ 159.733	100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,79 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 39	\$ 39	0,03
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	1.498	1.160	0,76
Invepar Holdings LLC 1,000 % fällig am 31.12.2049	16.11.2018	0	0	0,00
OAS Restructuring BVI Ltd, 5,000 % fällig am 31.03.2035	16.11.2018	14	5	0,00
OAS S.A. - Exp. 21.01.2039	16.11.2018	5	0	0,00
		\$ 1.556	\$ 1.204	0,79

Barmittel in Höhe von 1.722 USD (31. Dezember 2022: 1.839 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 135.341	\$ 3.354	\$ 138.695
Investmentfonds	15.721	0	0	15.721
Pensionsgeschäfte	0	3.949	0	3.949
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	32	2.179	0	2.211
Einlagen bei Kreditinstituten	0	364	776	1.140
Summen	\$ 15.753	\$ 141.833	\$ 4.130	\$ 161.716

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)		Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)		Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)		Marktwert
	\$		\$		\$		
Übertragbare Wertpapiere	\$	458	\$	140.620	\$	2.309	\$ 143.387
Investmentfonds		16.419		99		0	16.518
Pensionsgeschäfte		0		8.386		0	8.386
Finanzderivate <sup>(3)</sup>		191		3.630		0	3.821
<b>Summen</b>	<b>\$</b>	<b>17.068</b>	<b>\$</b>	<b>152.735</b>	<b>\$</b>	<b>2.309</b>	<b>\$ 172.112</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ (141)	\$ 0	\$ (141)
BOA	598	(460)	138	92	(40)	52
BPS	771	(750)	21	(36)	0	(36)
BRC	(67)	0	(67)	(2)	0	(2)
BSH	3	0	3	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	109	0	109	1.221	(1.150)	71
DUB	(18)	0	(18)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(12)	0	(12)	1	0	1
GST	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	40	0	40	14	0	14
MCB	(38)	0	(38)	648	(550)	98
MYC	(1)	0	(1)	(5)	0	(5)
MYI	(93)	0	(93)	76	0	76
RBC	311	(280)	31	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	(12)	0	(12)	981	(940)	41
SOG	493	(370)	123	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	36	0	36	(36)	0	(36)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	68,61	67,07
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	18,23	17,79
Investmentfonds	9,84	9,77
Pensionsgeschäfte	2,47	4,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,41)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,46	0,50
Freiverkehrsfinanzderivate	1,33	1,66
Einlagenzertifikate	0,71	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,81	1,15
Unternehmensanleihen und Wechsel	70,23	70,02
US-Regierungsbehörden	1,90	0,76
US-Schatzobligationen	4,23	3,90
Non-Agency-MBS	0,71	0,77
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,89	0,84
Staatsemissionen	4,29	3,53
Stammaktien	0,20	0,52
Optionsscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	2,58	3,37
Investmentfonds	9,84	9,77
Pensionsgeschäfte	2,47	4,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,41)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,08	0,20
Zinsswaps	0,38	0,31

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen —		
Schutzverkauf	(0,06)	(0,02)
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,20	(0,24)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,19	1,92
Einlagezertifikate	0,71	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,24)	(1,85)
Nettovermögen	100,00	100,00



# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>BRASILIEN</b>				<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>				<b>LUXEMBURG</b>			
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>BRASILIANISCHE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
Banco BTG Pactual S.A.				12,000 % fällig am 03.10.2025				5,250 % fällig am 23.05.2023			
8,300 % fällig am 15.08.2024 BRL				P				^(g)			
10,000 \$ 2,011 0,87				84.300 \$ 1.602 0,69				\$ 1.600 \$ 96 0,04			
Oi S.A.				244.600 4.772 2,07				Tierra Mojada Luxembourg SARL			
0,000 % fällig am 25.02.2035				Dominican Republic Government International Bond				5,750 % fällig am 01.12.2040			
350 62 0,03				13,625 % fällig am 03.02.2033				0 0 0,00			
Vale S.A.				50.200 1.129 0,49				Summe Luxemburg			
0,000 % (e)				13,625 % fällig am 10.02.2034				96 0,04			
46.580 2.969 1,29				56.700 1.295 0,56							
Summe Brasilien				Summe Dominikanische Republik							
5,042 2,19				8.798 3,81							
<b>CAYMAN INSELN</b>				<b>GUATEMALA</b>				<b>MALAYSIA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Kaisa Group Holdings Ltd.				Guatemala Government International Bond				Khazanah Capital Ltd.			
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^				6,600 % fällig am 13.06.2036 \$				4,876 % fällig am 01.06.2033			
\$ 3.400 226 0,10				900 907 0,39				700 693 0,30			
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^				<b>UNGARN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
700 47 0,02				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Malaysia Government International Bond			
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^				MVM Energetika Zrt				3,800 % fällig am 17.08.2023 MYR			
200 13 0,01				7,500 % fällig am 09.06.2028				14.600 3.131 1,36			
Poinsettia Finance Ltd.				Summe Ungarn				Summe Malaysia			
6,625 % fällig am 17.06.2031				600 599 0,26				3.824 1,66			
797 658 0,28				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>MEXIKO</b>			
Sunac China Holdings Ltd.				Ungarische Entwicklungsbank				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,500 % fällig am 09.07.2023 ^				6,500 % fällig am 29.06.2028				Metalsa S.A. de C.V.			
400 62 0,03				Summe Ungarn				3,750 % fällig am 04.05.2031 \$			
7,250 % fällig am 14.06.2022 ^				2.200 2.182 0,95				800 631 0,27			
200 30 0,01				2.781 1,21				Petroleos Mexicanos			
Summe Cayman Inseln				<b>INDIEN</b>				6,375 % fällig am 23.01.2045			
1,036 0,45				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				1,800 1,107 0,48			
				JWS Hydro Energy Ltd.				Trust Fibra Uno			
<b>CHILE</b>				4,125 % fällig am 18.05.2031				6,390 % fällig am 15.01.2050			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				588 497 0,21				1,250 990 0,43			
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				<b>IRLAND</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
6,000 % fällig am 01.04.2033 CLP				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Mexico Government International Bond			
6.390.000 8.433 3,66				<b>Black Diamond CLO DAC</b>				8,500 % fällig am 18.11.2038 MXN			
				4,060 % fällig am 20.01.2032 €				46.000 2.618 1,14			
<b>CHINA</b>				Cairn CLO DAC				Summe Mexiko			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,957 % fällig am 15.10.2031				5.346 2,32			
Yango Justice International Ltd.				Carlyle Euro CLO DAC				<b>NIEDERLANDE</b>			
7,500 % fällig am 17.02.2025 ^				3,877 % fällig am 15.01.2031				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
\$ 1.100 10 0,00				1,394 1.489 0,65				JAB Holdings BV			
				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				4,500 % fällig am 08.04.2052 \$			
<b>KOLUMBIEN</b>				Harvest CLO DAC				1,500 1,160 0,50			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,073 % fällig am 15.11.2031				Angola Via Avenir BV			
Ecopetrol S.A.				Oak Hill European Credit Partners DAC				10,163 % fällig am 07.12.2023			
5,875 % fällig am 28.05.2045				3,940 % fällig am 20.10.2031				12,772 % fällig am 03.07.2023			
700 480 0,21				500 531 0,23				123 123 0,06			
				6,044 2,62				Sagax Euro MTN NL BV			
<b>KONGO</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				1,000 % fällig am 17.05.2029 €			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				EP Infrastructure A/S				1,300 1,012 0,44			
Belarus International Bond				1,816 % fällig am 02.03.2031 €				Summe Niederlande			
6,000 % fällig am 30.06.2029				1.400 1,073 0,47				2.832 1,23			
625 529 0,23				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>PANAMA</b>			
<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>				Czech Republic Government International Bond				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,000 % fällig am 13.10.2033 CZK				Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.			
EP Infrastructure A/S				2,750 % fällig am 23.07.2029				5,125 % fällig am 11.08.2061 \$			
1,816 % fällig am 02.03.2031 €				49.000 2.050 0,89				600 463 0,20			
1.400 1,073 0,47				2.773 1,20				<b>PARAGUAY</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Tschechische Republik				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Czech Republic Government International Bond				3,846 1,67				Paraguay Government International Bond			
2,000 % fällig am 13.10.2033 CZK								5,850 % fällig am 21.08.2033			
2,750 % fällig am 23.07.2029								(a)			
49.000 2.050 0,89								500 501 0,22			
2.773 1,20											
Summe Tschechische Republik											
3,846 1,67											
<b>DÄNEMARK</b>				<b>ISRAEL</b>				<b>PERU</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				Bank Leumi Le-Israel B.M.				Banco de Credito del Peru S.A.			
1,000 % fällig am 01.10.2050 DKK				7,129 % fällig am 18.07.2033 (g) \$				4,650 % fällig am 17.09.2024 PEN			
0 0 0,00				400 396 0,17				2.600 688 0,30			
1,500 % fällig am 01.10.2053				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
0 0 0,00				Israel Government International Bond				Peru Government International Bond			
Nykredit Realkredit A/S				0,150 % fällig am 31.07.2023 ILS				5,940 % fällig am 12.02.2029			
1,000 % fällig am 01.10.2050				20.800 5.584 2,42				700 190 0,08			
0 0 0,00				Summe Israel				6,950 % fällig am 12.08.2031			
0 0 0,00				5.980 2,59				7,300 % fällig am 12.08.2033			
1,500 % fällig am 01.10.2053								33.800 9.628 4,18			
0 0 0,00								9.874 4,28			
0 0 0,00								Summe Peru			
1,500 % fällig am 01.10.2053								10.562 4,58			
0 0 0,00											
TDC Net A/S								<b>POLEN</b>			
6,500 % fällig am 01.06.2031 €								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
500 546 0,24								Bank Gospodarstwa Krajowego			
Summe Dänemark								5,375 % fällig am 22.05.2033 \$			
546 0,24								1.200 1.195 0,52			

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS		
<b>Poland Government International Bond</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>US-SCHATZobligationen</b>					
0,250 % fällig am 25.10.2026	PLN	33.200	6,864	Finanzministerium der Regierung von Scharadscha				U.S. Treasury Bonds					
2,750 % fällig am 25.04.2028		12.700	2,760	4,000 % fällig am 28.07.2050	800	514	0,22	1,125 % fällig am 15.05.2040			3,3		
4,875 % fällig am 04.10.2033	\$	1.000	984	Summe Vereinigte Arabische Emirate		2.302	1,00	1,750 % fällig am 15.08.2041	11.900	7.724	5		
Summe Polen		11.803	5,12					16.400	11.534	0	5,0		
				<b>GROSSBRITANNIEN</b>				2,375 % fällig am 15.02.2042	20.200	15.736	3	6,8	
<b>RUMÄNIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				U.S. Treasury Notes					
<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				Petra Diamonds U.S. Treasury PLC (6,066 % bar und 3,967 % PIK)				2,500 % fällig am 30.04.2024	5.600	5.466	7	2,3	
Romania Government International Bond				10,033 % fällig am				Summe USA				21,4	
4,250 % fällig am 28.04.2036	RON	3.100	532	08.03.2026 (b)	241	226	0,10		40.460	5			
6,625 % fällig am 27.09.2029	€	900	1.022	Royalty Pharma PLC	1.500	1.014	0,44		49.476	6			
Summe Rumänien		1.554	0,67	3,550 % fällig am 02.09.2050		1.240	0,54						
								<b>USBEKISTAN</b>					
<b>RUSLAND</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				Canada Square Funding PLC				Ipoteka-Bank ATIB					
Russia Government International Bond				5,316 % fällig am 17.01.2059	£	275	347	0,15	5,500 % fällig am 19.11.2025	700	647	8	
1,125 % fällig am 20.11.2027 ^		100	51	Polaris PLC				Uzbek Industrial and Construction Bank ATB					
5,100 % fällig am 28.03.2035 ^	\$	200	89	6,154 % fällig am 27.05.2057	46	58	0,02	5,750 % fällig am 02.12.2024	700	667	9		
Summe Russland		140	0,06	Rochester Financing PLC	262	330	0,14	Summe Usbekistan		1.314	7		
				5,602 % fällig am 18.12.2044									
<b>SERBIEN</b>				Stratton Mortgage Funding PLC									
<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				5,765 % fällig am 12.03.2052	63	80	0,03						
Serbia Government International Bond				Towd Point Mortgage Funding PLC									
4,500 % fällig am 20.08.2032	RSD	13.800	114	5,841 % fällig am 20.07.2045	646	822	0,36						
Summe Serbien				Tower Bridge Funding PLC									
				5,629 % fällig am 20.12.2063	174	220	0,10						
				Summe Großbritannien		1.857	0,80						
<b>SUDAFRIKA</b>						3.097	1,34	<b>SAMBIA</b>					
<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				<b>USA</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>					
South Africa Government International Bond				<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Zambia Government International Bond					
6,500 % fällig am 28.02.2041	ZAR	64.900	2.036	Aames Mortgage Investment Trust				13,000 % fällig am					
8,000 % fällig am 31.01.2030		49.500	2.316	6,455 % fällig am 25.06.2035	\$	900	793	0,34	25.01.2031	ZMW	25.900	871	8
10,500 % fällig am				ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust									
21.12.2026		237.400	13.051	6,170 % fällig am 25.04.2035		367	352	0,15					
Summe Südafrika		17.403	7,55	Citigroup Mortgage Loan Trust									
				5,450 % fällig am 25.10.2036		649	416	0,18					
<b>SÜDKOREA</b>				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust									
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,125 % fällig am 25.12.2035		297	292	0,13					
Mirae Asset Securities Co. Ltd.				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust									
2,625 % fällig am 30.07.2025	\$	600	548	5,360 % fällig am 25.10.2036		165	163	0,07					
Summe Südkorea				5,420 % fällig am 25.07.2036		257	217	0,10					
				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust									
<b>ÜBERNATIONAL</b>				6,125 % fällig am 25.07.2034		22	21	0,01					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust									
Africa Finance Corp.				5,470 % fällig am 25.07.2036		900	854	0,37					
2,875 % fällig am 28.04.2028		600	496	0,21			3.108	1,35					
Summe Übernational				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>									
				Charter Communications Operating LLC									
<b>SCHWEIZ</b>				3,950 % fällig am 30.06.2062		1.700	1.047	0,45					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Energy Transfer LP									
Credit Suisse AG				6,000 % fällig am 15.06.2048		1.200	1.140	0,50					
4,713 % fällig am 31.05.2024	€	400	435	National Fuel Gas Co.									
0,19				2,950 % fällig am 01.03.2031		1.300	1.041	0,45					
<b>TUNESIEN</b>				Pacific Gas & Electric Co.									
<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				4,950 % fällig am 01.07.2050		1.300	1.023	0,44					
Banque Centrale de Tunisie Government International Bond				Summe USA									
6,750 % fällig am 31.10.2023		200	203	0,09									
Summe Tunesien				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>									
				Ecopetrol S.A.									
<b>TÜRKEI</b>				TBD % fällig am 17.08.2024		1.000	985	0,43					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Türkei									
Turkish Airlines Pass-Through Trust				1.988	0,86								
4,200 % fällig am 15.09.2028	\$	549	506	0,22									
Summe Türkei				<b>NON-AGENCY-MBS</b>									
				IndyMac Mortgage Loan Trust									
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				5,490 % fällig am 25.11.2036	\$	692	\$ 672	9	0,2				
SOCAR Turkey Enerji A/S				Summe Kreditbeteiligungen									
6,553 % fällig am 11.08.2026	€	1.400	1.482	0,64									
Summe Kreditbeteiligungen				1.988	0,86								
				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>									
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				PIMCO Select Funds plc -									
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				PIMCO US Dollar									
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC				Short-Term Floating									
4,696 % fällig am 24.04.2033	\$	600	598	NAV Fund (f)	1.204.286	11.992	0	5,2					
First Abu Dhabi Bank PJSC				Summe Organismen für gemeinsame Anlagen									
4,774 % fällig am 06.06.2028	\$	1.200	\$ 1.190	0,52									
Summe Vereinigte Arabische Emirate				1.788	0,78								
				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>									
				PIMCO ETFs plc - PIMCO									
				US Dollar Short									
				Maturity UCITS ETF (f)	6.300	626	7	0,2					
				Summe Investmentfonds		\$ 12.618	7						

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 939	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	\$ (958)	\$ 939	\$ 939	0,41
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (958)	\$ 939	\$ 939	0,41

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2023	2	\$ 1	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	47	(29)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	554	(1.102)	(0,48)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	18	37	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	1	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	75	(123)	(0,05)
				\$ (1.215)	(0,53)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (1.215)	(0,53)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Newell Brands, Inc.	1,000 %	20.06.2028	\$ 700	\$ 5	0,00

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	\$ 23.900	\$ 439	0,19
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	22.200	155	0,07
				\$ 594	0,26

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,000 %	20.09.2028	INR 1.577.940	\$ 77	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	\$ 9.300	(133)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	2.500	363	0,16
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2025	7.900	(846)	(0,37)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2025	400	(35)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	3.070	(573)	(0,25)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.12.2050	1.500	594	0,26
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	6.800	1.467	0,64
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	4.500	920	0,40
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	21.06.2024	7.100	(117)	(0,05)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2024	270	15	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	4.100	447	0,19
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,562	14.02.2024	22.300	811	0,35
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.12.2031	2.700	440	0,19

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,580 %	02.01.2025	BRL	10.000	\$ (261) (0,11)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,220	02.01.2025		4.600	(89) (0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,745	02.01.2025		10.500	143 0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,950	04.01.2027		8.300	(148) (0,06)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		8,570	04.01.2027		11.900	167 0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI		8,615	02.01.2025		6.000	(25) (0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,120	04.01.2027		2.500	(13) (0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,206	04.01.2027		9.400	(43) (0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,446	04.01.2027		28.200	(79) (0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,565	04.01.2027		45.800	60 0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,665	02.01.2024		5.800	(44) (0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,755	02.01.2024		22.000	(159) (0,07)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		10,800	02.01.2024		51.900	363 0,16
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,833	02.01.2024		31.800	(221) (0,10)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		10,995	02.01.2024		15.300	(96) (0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,055	04.01.2027		22.200	16 0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,065	02.01.2024		10.600	(63) (0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,148	02.01.2024		2.600	(15) (0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,170	04.01.2027		24.800	(43) (0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,400	04.01.2027		15.500	92 0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,410	04.01.2027		15.500	93 0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,420	02.01.2026		38.300	174 0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,810	02.01.2025		65.900	(93) (0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,890	02.01.2025		88.400	36 0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,905	04.01.2027		37.800	(312) (0,14)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,920	02.01.2024		99.100	377 0,16
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,005	02.01.2025		22.100	15 0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,090	04.01.2027		25.200	(73) (0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,091	04.01.2027		21.700	195 0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,210	02.01.2025		15.500	23 0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,290	02.01.2024		54.800	(203) (0,09)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,350	01.07.2024		52.300	(27) (0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,490	01.07.2024		56.100	(44) (0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,533	02.01.2029		16.000	(209) (0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,595	01.07.2024		46.000	51 0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,684	02.01.2029		19.000	264 0,11
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,746	02.01.2029		20.500	292 0,13
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,940	04.01.2027		27.000	345 0,15
Zahlung	1-Year BRL-CDI		13,080	01.07.2024		100.300	198 0,09
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,218	02.01.2029		39.300	(664) (0,29)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,500	16.03.2027	CNY	35.200	(50) (0,02)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,500	15.03.2028		71.500	14 0,01
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,750	21.06.2028		101.900	17 0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		2,690	24.07.2024	COP	7.257.000	175 0,08
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		2,740	24.07.2024		7.084.900	(169) (0,07)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		3,100	26.11.2025		2.651.000	81 0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,060	26.11.2025		14.071.000	360 0,16
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,110	23.03.2026		4.493.200	(101) (0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,651	26.11.2025		2.624.800	(59) (0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		5,050	16.07.2026		34.330.400	(810) (0,35)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		6,130	26.10.2026		25.320.800	405 0,18
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		6,885	31.01.2025		24.609.000	311 0,13
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,080	02.02.2027		1.622.900	14 0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,090	28.04.2028		1.750.200	9 0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,130	31.01.2027		8.865.000	74 0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,130	28.04.2028		618.500	4 0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,140	28.04.2028		1.855.800	12 0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,320	31.03.2027		2.908.000	9 0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,560	30.03.2027		4.424.200	22 0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,686	30.03.2027		26.334.600	154 0,07
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,830	31.03.2028		4.898.000	(54) (0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,940	24.03.2030		11.638.000	(216) (0,09)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,140	28.04.2028		3.977.000	51 0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,520	15.03.2028		35.000.000	592 0,26
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,800	17.01.2028		9.809.000	172 0,07
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		10,265	12.04.2025		41.439.000	(73) (0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		11,640	21.10.2025		11.114.000	(149) (0,06)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		11,930	10.11.2025		5.929.100	92 0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		12,000	26.11.2025		427.000	(7) 0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		12,060	09.11.2025		4.198.000	68 0,03
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR		3,250	15.03.2033	KRW	13.900.100	(97) (0,04)
Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS		2,250	15.03.2028	THB	234.710	(67) (0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		0,000	16.09.2023	\$	9.300	134 0,06
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.09.2023		7.900	(93) (0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,250	16.09.2023		6.000	66 0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,250	17.09.2023		3.470	(37) (0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,500	18.09.2023		4.370	44 0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,500	21.09.2023		7.100	(73) (0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,750	15.09.2023		2.700	26 0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		5,757	14.04.2026	ZAR	96.300	(360) (0,16)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		0,905	24.11.2023	CLP	1.293.300	73 0,03

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,070 %	10.12.2023	CLP	1.218.000	\$ (65)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,080	10.12.2023		1.218.000	(64)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,090	10.12.2023		2.828.000	(158)	(0,07)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,345	11.06.2025		1.350.000	167	0,07
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,947	23.11.2027		999.000	176	0,08
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,950	05.05.2026		1.239.600	(180)	(0,08)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,965	24.11.2027		851.000	147	0,06
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,020	30.04.2026		1.300.000	(188)	(0,08)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,183	04.12.2027		2.661.000	(436)	(0,19)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,360	22.01.2025		1.099.200	(149)	(0,06)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,640	01.03.2026		795.000	110	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,530	06.07.2026		1.995.000	250	0,11
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,000	06.07.2028		1.019.000	111	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,130	01.03.2025		1.820.000	115	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,180	01.10.2028		790.000	17	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030		1.286.000	15	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,260	01.03.2026		620.000	27	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,360	27.03.2028		1.914.900	31	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,370	01.10.2028		3.136.000	30	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,470	01.09.2030		460.000	(4)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,548	10.04.2028		833.000	(2)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,570	01.10.2028		245.000	(5)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,589	10.04.2028		1.694.000	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,600	12.12.2027		1.803.000	(16)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,635	12.12.2027		3.695.000	(39)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,700	17.05.2028		1.602.100	(23)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,720	28.01.2025		4.012.000	225	0,10
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,734	18.05.2028		9.093.000	(150)	(0,07)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,754	28.01.2025		3.238.000	175	0,08
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,760	28.01.2025		1.933.000	104	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,915	01.02.2025		3.534.300	181	0,08
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,020	02.03.2029		190.000	8	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,070	28.02.2028		3.391.700	(60)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,194	10.03.2028		1.681.200	47	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,223	13.03.2028		680.300	23	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,255	13.03.2028		478.200	15	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,270	02.03.2027		415.700	7	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,330	09.03.2028		526.800	19	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,360	25.05.2027		24.600	2	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,386	24.05.2027		1.861.000	59	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,440	07.03.2028		1.344.000	53	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,500	12.12.2025		2.564.000	(19)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,535	09.01.2026		9.540.000	(163)	(0,07)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,567	12.12.2025		1.464.000	(12)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,570	22.12.2025		1.277.000	(18)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,590	22.12.2025		3.565.000	(40)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,590	21.03.2027		4.540.300	49	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,805	06.03.2027		1.852.000	63	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,000	27.09.2032		1.785.800	301	0,13
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,265	07.03.2026		262.400	9	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,270	07.03.2026		2.463.000	57	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,370	06.03.2026		1.686.000	42	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,690	10.05.2025		7.125.500	7	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month CZK-PRIBOR	1,025	29.07.2030	CZK	35.800	(171)	(0,07)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,224	28.01.2031		44.500	(439)	(0,19)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,575	26.03.2026		28.100	(136)	(0,06)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,725	22.07.2026		23.800	(118)	(0,05)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,815	28.01.2031		34.200	276	0,12
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	2,000	19.06.2024		26.100	(68)	(0,03)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,490	18.01.2032		10.600	32	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,680	03.03.2027		78.400	135	0,06
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,164	14.03.2027		73.600	105	0,05
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,220	14.03.2027		73.500	98	0,04
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,300	18.03.2027		143.400	(140)	(0,06)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,310	15.03.2027		19.100	22	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,320	15.03.2027		7.200	8	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,560	14.07.2032		111.300	(112)	(0,05)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028		248.000	(80)	(0,03)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,640	18.05.2028		64.400	7	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,740	28.02.2033		91.700	160	0,07
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,040	17.04.2028		27.900	22	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,100	18.04.2028		11.800	11	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,110	22.03.2026		72.500	30	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,125	22.03.2026		50.000	20	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,480	15.03.2026		216.500	4	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,606	28.06.2027		54.800	80	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	15.12.2040	€	300	141	0,06
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053		600	16	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028		1.500	(5)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	19.06.2024	HUF	1.427.600	(480)	(0,21)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,760	21.01.2030		380.000	372	0,16

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,958 %	19.03.2026	HUF	398.600	\$ (239)	(0,10)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	5.500	04.03.2027		2.382.600	804	0,35
Zahlung	6-Month HUF-BBR	6.280	18.03.2027		2.363.300	(556)	(0,24)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	13.600	12.12.2024		1.418.700	(353)	(0,15)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1.110	12.01.2031	PLN	9.800	640	0,28
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1.165	28.01.2031		4.400	(131)	(0,06)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month PLN-WIBOR	1.215	29.07.2030		10.300	338	0,15
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1.855	28.01.2031		6.000	(316)	(0,14)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1.933	17.01.2025		11.800	(289)	(0,13)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2.635	28.10.2026		32.900	(244)	(0,11)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	3.035	09.12.2026		42.000	560	0,24
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4.075	07.03.2027		28.700	277	0,12
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4.830	18.03.2027		28.300	(48)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4.895	17.03.2027		15.000	(54)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4.920	17.03.2027		15.000	(51)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6.300	25.04.2028		11.900	(54)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6.670	28.06.2027		14.400	194	0,08
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6.725	27.06.2027		20.700	(289)	(0,13)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6.843	28.06.2027		1.500	22	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7.310	30.06.2027		11.000	(210)	(0,09)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5.080	16.06.2025	MXN	16.400	(82)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5.700	12.09.2030		35.400	(271)	(0,12)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5.770	09.10.2030		150.700	1.127	0,49
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5.850	19.08.2030		12.100	(89)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5.875	16.08.2030		16.800	(119)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5.880	16.08.2030		8.700	(61)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5.920	16.08.2030		9.100	(63)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6.240	10.07.2026		113.600	(441)	(0,19)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6.480	28.05.2040		16.700	(34)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6.495	17.07.2026		140.500	541	0,23
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6.505	17.07.2026		102.100	392	0,17
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6.580	01.01.2025		29.700	(93)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6.830	27.12.2029		19.900	(77)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7.570	19.11.2026		145.200	(463)	(0,20)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7.675	04.06.2029		65.100	(103)	(0,05)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8.465	16.08.2027		167.300	22	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8.480	24.03.2027		121.900	(74)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8.560	18.05.2028		14.500	(6)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8.585	18.05.2028		14.700	(7)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8.600	18.05.2028		7.400	(4)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8.610	18.05.2028		7.600	(4)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8.645	18.05.2028		7.600	(5)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8.656	18.05.2028		17.300	(12)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8.700	05.11.2027		8.700	4	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8.740	07.03.2028		192.900	(194)	(0,08)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8.743	05.11.2027		37.900	21	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8.760	05.11.2027		25.400	15	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8.773	05.11.2027		20.000	12	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9.045	04.11.2027		17.200	20	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9.053	04.11.2027		18.900	23	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9.117	04.11.2027		47.100	63	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9.165	05.11.2026		25.600	15	0,01
						\$ 4.668	2,02
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 5.267	2,28

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### DEVIENOPTIEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Put - OTC EUR versus CZK	CZK	23,830	01.11.2023	802	\$	356	0,15
GLM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	203	\$	123	0,05
	Put - OTC EUR versus PLN	PLN	4,560	01.11.2023	403	\$	317	0,14
JPM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	403	\$	243	0,11
MYI	Put - OTC USD versus MXN	MXN	18,500	25.07.2023	4.228	\$	313	0,14
UAG	Call - OTC USD versus ZAR	ZAR	20,500	09.10.2023	6.748	\$	68	0,03
					\$ 398	\$ 1.420	0,62	



## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

### STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs <sup>(1)</sup>	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten <sup>(2)</sup>	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600 %	27.12.2023	2.800	\$ 0	\$ 1	0,00
	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,050	27.12.2023	2.800	0	3	0,00
CBK	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,100	20.12.2023	8.800	0	1	0,00
	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	29.12.2023	2.600	0	0	0,00
MYI	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	27.12.2023	3.900	0	1	0,00
					\$ 0	\$ 6	0,00

### VERKAUFSOPTIONEN

#### DEIVISOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYI	Call - OTC USD versus CLP	CLP 850.000	18.07.2023	2.436	\$ (34)	\$ (3)	0,00
	Put - OTC USD versus MXN	MXN 17.750	25.07.2023	8.456	(54)	(275)	(0,12)
	Call - OTC USD versus MXN	21.000	07.03.2024	4.072	(91)	(29)	(0,01)
					\$ (179)	\$ (307)	(0,13)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

<sup>(2)</sup> Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.12.2024	\$ 1.800	\$ 27	\$ (43)	\$ (16)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	400	24	(16)	8	0,01
BPS	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	1.400	65	(38)	27	0,01
BRC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.000	16	(25)	(9)	0,00
CBK	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	100	(1)	0	(1)	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	200	12	(4)	8	0,00
GST	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.000	(23)	2	(21)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	6.500	304	(176)	128	0,06
HUS	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.100	(13)	1	(12)	(0,01)
JPM	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	3.200	63	(91)	(28)	(0,01)
					\$ 474	\$ (390)	\$ 84	0,04

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	\$ 200	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.200	(84)	31	(53)	(0,02)
GST	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	2	1	3	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	600	(14)	9	(5)	0,00
					\$ (96)	\$ 41	\$ (55)	(0,02)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month INR-LIBOR zzgl. 0,672 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.09.2028	INR 177.590	\$ 2.160	\$ 4	\$ 2	\$ 6	0,00



Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	\$ 100	ARS 4.488	\$ 0	\$ 97	\$ 97	0,04
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month INR-LIBOR zzgl. 0,664 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.09.2028	INR 709.400	\$ 8.637	4	(23)	(19)	(0,01)
SCX	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month INR-LIBOR zzgl. 0,664 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.09.2028	180.040	2.190	4	2	6	0,00
SCX	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month INR-LIBOR zzgl. 0,664 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.09.2028	438.090	5.338	5	(14)	(9)	0,00
						\$ 17	\$ 64	\$ 81	0,03

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750 %	15.06.2027	MYR 21.600	\$ (38)	\$ 57	\$ 19	0,01
BPS	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,670	16.06.2026	10.600	0	(62)	(62)	(0,03)
JPM	Zahlung	6-Month CLP-CHLIBOR	3,020	06.06.2024	CLP 770.000	0	(55)	(55)	(0,02)
MYC	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	15.12.2026	MYR 13.400	3	58	61	0,03
MYI	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,340	18.09.2029	3.500	0	(17)	(17)	(0,01)
SCX	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,430	06.03.2025	CNY 25.600	0	23	23	0,01
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,020	04.02.2025	26.000	0	41	41	0,02
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,750	15.09.2026	MYR 3.700	11	(33)	(22)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,230	23.08.2024	6.500	0	7	7	0,00
UAG	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,920	15.01.2025	CNY 43.900	0	90	90	0,04
						\$ (24)	\$ 109	\$ 85	0,04

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	DKK 1.623	\$ 234	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	07.2023	INR 368.549	4.581	94	0	94	0,04
	07.2023	KES 81.859	578	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	MXN 165.028	8.964	0	(634)	(634)	(0,28)
	07.2023	PLN 1.742	418	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	\$ 433	DKK 2.943	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	4.572	INR 368.549	0	(85)	(85)	(0,04)
	07.2023	199	PLN 823	3	0	3	0,00
	08.2023	AUD 308	\$ 208	3	0	3	0,00
	08.2023	DKK 2.939	433	2	0	2	0,00
	08.2023	€ 992	1.065	0	(20)	(20)	(0,01)
	08.2023	¥ 291.300	2.108	80	0	80	0,03
	08.2023	MXN 19.292	1.044	0	(73)	(73)	(0,03)
	08.2023	\$ 1.061	CNY 7.281	0	(54)	(54)	(0,02)
	08.2023	142	EGP 4.728	6	0	6	0,00
	08.2023	1.528	€ 1.406	9	0	9	0,00
	08.2023	ZAR 108.235	\$ 5.782	75	0	75	0,03
	09.2023	KRW 4.273	3	0	0	0	0,00
	09.2023	NGN 56.791	98	26	0	26	0,01
	09.2023	PEN 17.182	4.685	0	(27)	(27)	(0,01)
	09.2023	TWD 22.335	736	17	0	17	0,01
	09.2023	\$ 10	NGN 7.760	0	0	0	0,00
	09.2023	4.439	PEN 16.471	78	0	78	0,03
	10.2023	114	KES 17.190	4	0	4	0,00
	10.2023	ZAR 17.796	\$ 959	26	0	26	0,01
BPS	07.2023	CZK 63.184	2.937	38	0	38	0,02
	07.2023	PHP 5.138	91	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	PLN 468	113	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 3.038	MYR 13.943	0	(45)	(45)	(0,02)
	07.2023	22	PLN 91	0	0	0	0,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	08.2023	CNH	13.452	\$	1.955	\$	99	0,04
	08.2023	MYR	14.815		3.189		5	0,00
	08.2023	TWD	11.180		366		7	0,00
	08.2023	\$	2.372	CNY	16.273	(121)	(121)	(0,05)
	08.2023		1.208	COP	5.426.193	0	80	0,03
	08.2023		2.294	€	2.092	(7)	(7)	0,00
	08.2023	ZAR	621	\$	33	0	1	0,00
	09.2023	PEN	11.310		3.090	(11)	(11)	0,00
	09.2023	\$	91	PHP	5.138	0	2	0,00
	09.2023		0	THB	9	0	0	0,00
	10.2023		1.387	ZAR	27.192	0	37	0,02
	10.2023	ZAR	39.034	\$	2.099	0	54	0,02
	12.2023	NGN	14.580		18	0	0	0,00
	12.2023	\$	4.502	MXN	80.258	0	39	0,02
BRC	07.2023	BRL	11.242	\$	2.343	0	13	0,01
	07.2023	¥	3.144.000		24.308	2.513	2.513	1,09
	07.2023	\$	2.317	MYR	10.643	(32)	(32)	(0,01)
	08.2023	COP	5.597.988	\$	1.314	(10)	(10)	0,00
	08.2023	\$	2.024	£	1.612	0	27	0,01
	08.2023		283	¥	37.513	(22)	(22)	(0,01)
	08.2023	ZAR	129.385	\$	6.550	(270)	(269)	(0,12)
	09.2023	ILS	2.436		681	0	23	0,01
	09.2023	\$	1.804	MXN	31.492	0	6	0,00
	10.2023	MXN	70.947	\$	3.787	(270)	(270)	(0,12)
CBK	07.2023	CLP	13.318.245		16.456	(128)	(128)	(0,06)
	07.2023	CZK	55.760		2.588	0	29	0,01
	07.2023	ILS	20.381		5.868	0	372	0,16
	07.2023	MXN	43.942		2.529	(29)	(29)	(0,01)
	07.2023	PLN	9.114		2.181	(60)	(60)	(0,03)
	07.2023	\$	1.215	BRL	5.833	(6)	(6)	0,00
	07.2023		591	COP	2.696.790	51	51	0,02
	07.2023		94	PHP	5.138	(1)	(1)	0,00
	07.2023		34	PLN	137	0	0	0,00
	07.2023		4.157	RON	18.796	(24)	(24)	(0,01)
	07.2023		209	UYU	8.254	0	12	0,01
	07.2023	UYU	8.254	\$	220	(1)	(1)	0,00
	08.2023	BRL	6.565		1.270	(84)	(84)	(0,04)
	08.2023	CAD	31		23	0	0	0,00
	08.2023	CLP	1.097.369		1.325	(39)	(39)	(0,02)
	08.2023	CNY	6.135		890	0	42	0,02
	08.2023	COP	1.959.460		463	0	0	0,00
	08.2023	EGP	11.401		329	(29)	(29)	(0,01)
	08.2023	€	1.582		1.700	(30)	(30)	(0,01)
	08.2023	PEN	7.977		2.042	(151)	(151)	(0,07)
	08.2023	TWD	11.639		381	0	7	0,00
	08.2023	\$	9.726	CLP	7.958.093	123	123	0,05
	08.2023		216	CNH	1.509	(8)	(8)	0,00
	08.2023		1.419	€	1.295	(4)	(4)	0,00
	08.2023		333	£	263	0	2	0,00
	09.2023	COP	413.251	\$	98	0	1	0,00
	09.2023	KRW	8.866		7	0	0	0,00
	09.2023	MXN	39.108		2.099	(146)	(146)	(0,06)
	09.2023	PHP	111.257		1.975	(33)	(33)	(0,01)
	09.2023	\$	7.443	IDR	111.078.693	(65)	(65)	(0,03)
	09.2023		4.199	INR	348.032	0	31	0,01
	09.2023	ZMW	14.094	\$	803	0	16	0,01
	10.2023	\$	97	NGN	58.212	(25)	(25)	(0,01)
	02.2024	EGP	6.270	\$	167	(1)	(1)	0,00
	02.2024	\$	409	EGP	14.313	(26)	(26)	(0,01)
DUB	07.2023	\$	700	KES	101.607	0	19	0,01
	10.2023		252	NGN	149.289	(66)	(66)	(0,03)
	10.2023	ZAR	13.689	\$	752	0	35	0,02
	02.2024	\$	2.218	EGP	77.705	(134)	(134)	(0,06)
FAR	10.2023		3.047	ZAR	59.715	0	81	0,04
GLM	07.2023	BRL	35.370	\$	7.082	(250)	(250)	(0,11)
	07.2023	DOP	215.614		3.725	(132)	(132)	(0,06)
	07.2023	RON	756		168	0	1	0,00
	07.2023	\$	7.897	BRL	40.783	(11)	557	0,24
	07.2023		104	MXN	1.803	0	1	0,00
	07.2023		202	PLN	856	0	8	0,00
	07.2023		159	RON	719	(1)	(1)	0,00
	08.2023	BRL	5.517	\$	1.149	0	11	0,00
	08.2023	DOP	89.524		1.555	(51)	(51)	(0,02)
	08.2023	\$	1.699	CHF	1.504	(11)	(11)	0,00
	08.2023	ZAR	44.848	\$	2.417	0	52	0,02
	09.2023	\$	4.973	BRL	24.276	0	4	0,00
	09.2023		4.688	THB	161.733	(92)	(92)	(0,04)
	09.2023		2.005	TWD	61.018	(42)	(42)	(0,02)
	10.2023	DOP	81.364	\$	1.450	0	7	0,00
	10.2023	NGN	287.412		513	0	156	0,07
	10.2023	ZAR	34.001		1.812	0	32	0,01
	11.2023	€	3.075	PLN	13.819	0	5	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
IND	07.2023	DKK 4.770	\$ 689	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	(0,00)	
	11.2023	€ 443	HUF 205.188	98	0	98	0,04	
JPM	06.2024	\$ 815	TWD 20.969	0	(122)	(122)	(0,05)	
	07.2023	4.382	MXN 77.122	107	0	107	0,05	
	07.2023	75	NGN 41.102	0	(22)	(22)	(0,01)	
	07.2023	49	PLN 207	2	0	2	0,00	
	07.2023	78	SGD 103	0	(2)	(2)	0,00	
	08.2023	BRL 21.667	\$ 4.228	0	(242)	(242)	(0,11)	
	08.2023	CAD 51	38	0	0	0	0,00	
	08.2023	CNH 3.945	571	27	0	27	0,01	
	08.2023	COP 1.102.429	260	0	(2)	(2)	0,00	
	08.2023	£ 2.412	3.055	0	(12)	(12)	(0,01)	
	08.2023	HUF 1.006.288	2.883	1	(25)	(24)	(0,01)	
	08.2023	\$ 2.560	CHF 2.251	0	(33)	(33)	(0,01)	
	08.2023	1.321	CNY 9.032	0	(71)	(71)	(0,03)	
	08.2023	199	EGP 6.673	10	0	10	0,00	
	08.2023	5.951	€ 5.434	0	(10)	(10)	0,00	
	08.2023	46	¥ 6.165	0	(3)	(3)	0,00	
	08.2023	2.064	MXN 35.765	4	0	4	0,00	
	08.2023	2.564	ZAR 49.713	67	(11)	56	0,02	
	08.2023	ZAR 2.121	\$ 109	0	(3)	(3)	0,00	
	09.2023	COP 730.861	172	0	0	0	0,00	
	09.2023	ILS 2.338	658	26	0	26	0,01	
	09.2023	INR 385.462	4.685	0	0	0	0,00	
	09.2023	THB 51.883	1.513	39	0	39	0,02	
	09.2023	\$ 83	NGN 49.296	0	(21)	(21)	(0,01)	
	09.2023	1.963	PEN 7.229	19	0	19	0,01	
	09.2023	1.414	THB 48.585	0	(34)	(34)	(0,01)	
	10.2023	MXN 129.137	\$ 7.355	0	(30)	(30)	(0,01)	
	10.2023	\$ 128	NGN 79.447	0	(30)	(30)	(0,01)	
	11.2023	HUF 205.375	€ 443	0	(98)	(98)	(0,04)	
	12.2023	NGN 67.068	\$ 108	26	0	26	0,01	
	12.2023	\$ 130	NGN 81.907	0	(30)	(30)	(0,01)	
	01.2024	50	EGP 1.641	0	(5)	(5)	0,00	
	02.2024	EGP 47.299	\$ 1.248	0	(20)	(20)	(0,01)	
04.2024	KES 133.703	870	0	(13)	(13)	(0,01)		
MBC	07.2023	\$ 1	KES 146	0	0	0	0,00	
	07.2023	21	PLN 89	1	0	1	0,00	
	08.2023	€ 8.529	\$ 9.412	87	0	87	0,04	
	08.2023	HUF 2.616.833	7.669	109	0	109	0,05	
	08.2023	¥ 1.470.000	10.760	517	0	517	0,22	
	08.2023	\$ 134	€ 122	0	0	0	0,00	
	08.2023	952	ZAR 18.547	26	0	26	0,01	
	09.2023	KRW 7.923	\$ 6	0	0	0	0,00	
	09.2023	\$ 1.103	INR 91.298	7	0	7	0,00	
	09.2023	52	THB 1.772	0	(1)	(1)	0,00	
	01.2024	64	EGP 2.100	0	(6)	(6)	0,00	
	MYI	07.2023	CZK 53.519	\$ 2.428	2	(30)	(28)	(0,01)
		07.2023	€ 2	2	0	0	0	0,00
		07.2023	PLN 431	100	0	(6)	(6)	0,00
		07.2023	\$ 199	COP 840.548	1	0	1	0,00
07.2023		385	DKK 2.625	0	0	0	0,00	
07.2023		14	€ 13	0	0	0	0,00	
07.2023		29	MYR 132	0	0	0	0,00	
07.2023		141	PLN 596	5	0	5	0,00	
08.2023		DKK 2.621	\$ 385	0	0	0	0,00	
08.2023		€ 1.355	1.469	0	(12)	(12)	(0,01)	
08.2023		TWD 12.030	397	10	0	10	0,00	
08.2023		\$ 1.464	€ 1.352	14	0	14	0,01	
08.2023		4.042	¥ 537.176	0	(303)	(303)	(0,13)	
08.2023		5	TWD 157	0	0	0	0,00	
08.2023		179	ZAR 3.493	5	0	5	0,00	
09.2023		THB 23.649	\$ 691	19	0	19	0,01	
09.2023		\$ 4.432	IDR 65.926.864	0	(53)	(53)	(0,02)	
09.2023		6.498	THB 222.630	0	(171)	(171)	(0,07)	
10.2023		ZAR 408	\$ 22	1	0	1	0,00	
01.2024		EGP 18.824	507	0	(7)	(7)	0,00	
01.2024		NGN 116.850	190	50	0	50	0,02	
01.2024	\$ 306	EGP 10.285	0	(26)	(26)	(0,01)		
02.2024	EGP 38.449	\$ 923	0	(109)	(109)	(0,05)		
RBC	07.2023	\$ 4.622	MXN 88.927	555	0	555	0,24	
	08.2023	£ 466	\$ 589	0	(4)	(4)	0,00	
	08.2023	\$ 15.174	MXN 262.971	35	0	35	0,02	
SCX	09.2023	2.206	PEN 8.088	12	0	12	0,01	
	07.2023	NGN 50.237	\$ 95	30	0	30	0,01	
	07.2023	\$ 3.045	MYR 13.996	0	(41)	(41)	(0,02)	
	07.2023	12	NGN 9.216	0	0	0	0,00	
	08.2023	CNH 1.870	\$ 272	14	0	14	0,01	
	08.2023	\$ 3.513	CNY 23.983	0	(195)	(195)	(0,08)	
	09.2023	PEN 23.124	\$ 6.277	0	(64)	(64)	(0,03)	
	09.2023	THB 53.690	1.555	29	0	29	0,01	
	09.2023	TWD 18.663	612	12	0	12	0,01	
	09.2023	\$ 3.084	INR 255.716	24	0	24	0,01	
	12.2023	449	KES 66.039	1	0	1	0,00	
	01.2024	0	EGP 13	0	0	0	0,00	
	01.2024	142	NGN 116.724	0	(2)	(2)	0,00	

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SOG	06.2024	KES	68.980	\$ 449	\$ 0	\$ (1)	0,00
	07.2023	PLN	53.350	12.384	0	(737)	(0,32)
	07.2023	RON	9.512	2.110	19	0	0,01
	09.2023	\$	1.103	COP 4.692.294	0	(2)	(2)
SSB	01.2024		147	EGP 4.785	0	(16)	(0,01)
	07.2023		16.603	CLP 13.337.338	5	0	0,00
	08.2023	CLP	13.375.858	\$ 16.603	1	0	0,00
TOR	09.2023	\$	6.819	BRL 34.571	268	0	0,12
	08.2023		1.866	¥ 247.402	0	(143)	(0,06)
UAG	07.2023	¥	505.000	\$ 3.852	357	0	0,15
	07.2023	PLN	397		0	0	0,00
	08.2023	CNY	1.122		8	0	0,00
	08.2023	£	2.113		0	(16)	(0,01)
	09.2023	ILS	2.023		18	0	0,01
	09.2023	SGD	5.607		40	0	0,02
	10.2023	\$	981	ZAR 18.020	0	(36)	(0,02)
				\$ 7.742	\$ (6.212)	\$ 1.530	0,66

### ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	3.038	\$ 3.286	\$ 0	\$ (28)	(0,01)
	07.2023	THB	17.888	503	0	(2)	0,00
	07.2023	\$	0	BRL 1	0	0	0,00
	07.2023		6.085	€ 5.662	92	0	0,04
BPS	08.2023		504	THB 17.888	2	0	0,00
	07.2023	BRL	0	\$ 0	0	0	0,00
	07.2023	CNY	17.239		11	0	0,01
	07.2023	€	24.212		114	0	0,05
	07.2023	\$	25.374	€ 23.603	378	0	0,16
	08.2023		2.386	CNY 17.215	0	(6)	(0,00)
BRC	08.2023		26.555	€ 24.202	0	(116)	(0,05)
	07.2023		2.850	PLN 12.033	112	0	0,05
BSH	07.2023		6		0	0	0,00
CBK	07.2023	€	2	\$ 3	0	0	0,00
	07.2023	INR	52		0	0	0,00
	07.2023	MXN	20.510		0	(2)	(0,00)
	07.2023	\$	100	BRL 477	0	(1)	(0,00)
	07.2023		391	€ 362	3	0	0,00
	07.2023		1.140	MXN 20.510	56	0	0,02
	07.2023		295	TRY 7.190	0	(20)	(0,01)
	08.2023	BRL	477	\$ 99	1	0	0,00
	08.2023	\$	1.187	MXN 20.510	3	0	0,00
	07.2023	BRL	479	\$ 96	0	(4)	(0,00)
GLM	07.2023	\$	346	RON 1.604	7	0	0,00
	07.2023		518	THB 17.888	0	(13)	(0,01)
	07.2023	€	22.383	\$ 24.440	20	0	0,01
JPM	07.2023	INR	137.691		0	(16)	(0,01)
	07.2023	\$	1.679	INR 137.810	1	0	0,00
	08.2023	INR	137.936	\$ 1.679	0	(1)	(0,00)
	08.2023	\$	24.475	€ 22.383	0	(21)	(0,01)
	07.2023	€	3.950	\$ 4.263	0	(47)	(0,02)
MBC	07.2023	\$	17	CNY 120	0	0	0,00
	07.2023		397	€ 367	4	0	0,00
	07.2023		233	£ 188	6	0	0,00
	07.2023	PLN	12.063	\$ 2.978	9	0	0,00
MYI	07.2023	TRY	1		0	0	0,00
	07.2023	\$	343	IDR 5.171.080	2	0	0,00
	08.2023	IDR	5.173.035	\$ 343	0	(1)	(0,00)
	08.2023	\$	2.978	PLN 12.080	0	(9)	(0,00)
SCX	07.2023		0	IDR 7.297	0	0	0,00
SOG	07.2023		25.381	€ 23.594	360	0	0,16
TOR	07.2023	£	188	\$ 239	0	0	0,00
UAG	08.2023	\$	239	£ 188	0	0	0,00
	07.2023	IDR	5.151.443	\$ 343	0	0	0,00
	07.2023	\$	2.442	CNY 17.166	0	(77)	(0,03)
				\$ 1.181	\$ (364)	\$ 817	0,35

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	\$	\$	\$	\$	0,00
	07.2023	PLN		0	0	0	0,00
	07.2023	THB		0	0	0	0,00
	07.2023	\$	TRY	0	0	0	0,00
	08.2023	39	PLN	0	0	0	0,00
	08.2023	6	THB	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	37	PLN	1	0	1	0,00
BSH	07.2023	0		0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£	\$	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	INR		0	0	0	0,00
	07.2023	MXN		0	0	0	0,00
	07.2023	\$	MXN	1	0	1	0,00
	08.2023	15		0	0	0	0,00
GLM	07.2023	6	THB	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	€	\$	0	0	0	0,00
	07.2023	£		0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	INR		0	0	0	0,00
	07.2023	\$	INR	0	0	0	0,00
	08.2023	INR	\$	0	0	0	0,00
	08.2023	\$	€	0	0	0	0,00
	08.2023	269	£	1	0	1	0,00
MBC	07.2023	0	CNY	0	0	0	0,00
	07.2023	290	£	8	0	8	0,01
MYI	07.2023	323		7	0	7	0,00
	07.2023	3	IDR	0	0	0	0,00
	07.2023	3	ZAR	0	0	0	0,00
	08.2023	IDR	\$	0	0	0	0,00
	09.2023	\$	TRY	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	0	IDR	0	0	0	0,00
	07.2023	2	MXN	0	0	0	0,00
SOG	07.2023	37	€	1	0	1	0,00
	07.2023	ZAR	\$	0	0	0	0,00
	08.2023	\$	ZAR	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	£	\$	0	0	0	0,00
	08.2023	\$	£	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	IDR	\$	0	0	0	0,00
	07.2023	\$	CNY	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	71	£	1	0	1	0,00
	07.2023	3	TRY	0	0	0	0,00
				\$	\$	\$	
				20	(3)	17	0,01
						\$	
						3.678	1,60

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Banco Davivienda S.A.			
13,501 % fällig am 13.12.2024			
15,389 % fällig am 21.02.2024	COP	\$ 240	0,10
		289.500	0,03
BanColombia S.A.			
5,917 % fällig am 27.01.2024		1.311.000	0,13
13,320 % fällig am 08.06.2025		540.000	0,06
13,637 % fällig am 14.12.2024		1.432.000	0,15
16,137 % fällig am 01.09.2024		561.000	0,06
BBVA Colombia S.A.			
5,870 % fällig am 15.07.2024		1.187.000	0,11
14,540 % fällig am 13.01.2024		543.100	0,06
Summe Einlagenzertifikate		\$ 1.619	0,70
Summe Anlagen		\$ 228.545	99,12
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 2.023	0,88
Nettovermögen		\$ 230.568	100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
  - (a) Wertpapier per Emissionstermin.
  - (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
  - (c) Nullkuponwertpapier.
  - (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 7.501 USD (31. Dezember 2022: 4.974 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.161 USD (31. Dezember 2022: 5.521 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 201.556	\$ 4.083	\$ 205.639
Investmentfonds	12.618	0	0	12.618
Pensionsgeschäfte	0	939	0	939
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(29)	7.759	0	7.730
Einlagen bei Kreditinstituten	0	501	1.118	1.619
<b>Summen</b>	<b>\$ 12.589</b>	<b>\$ 210.755</b>	<b>\$ 5.201</b>	<b>\$ 228.545</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 180.287	\$ 1.313	\$ 181.600
Investmentfonds	14.173	624	0	14.797
Pensionsgeschäfte	0	706	0	706
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	126	3.194	(7)	3.313
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	137	137
<b>Summen</b>	<b>\$ 14.299</b>	<b>\$ 184.811</b>	<b>\$ 1.443</b>	<b>\$ 200.553</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ (17)	\$ 0	\$ (17)
BOA	(46)	600	554	(2.672)	2.460	(212)
BPS	520	(460)	60	(2.204)	1.480	(724)
BRC	2.030	(1.920)	110	(334)	510	176
CBK	(156)	0	(156)	(169)	10	(159)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(239)	0	(239)
DUB	(146)	0	(146)	653	(650)	3
FAR	81	0	81	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	763	(590)	173	(338)	440	102
GST	110	(360)	(250)	203	(260)	(57)
HUS	(12)	0	(12)	(8)	0	(8)
IND	(34)	80	(46)	(94)	340	246
JPM	(245)	210	(35)	224	0	224
MBC	711	(620)	91	847	(804)	43
MYC	61	0	61	84	0	84
MYI	(612)	551	(61)	(104)	281	177
RBC	598	(670)	(72)	(4)	0	(4)
SCX	(153)	260	107	922	(790)	132
SOG	(375)	460	85	86	0	86
SSB	274	(350)	(76)	630	(630)	0
TOR	(143)	0	(143)	151	0	151
UAG	452	(470)	(18)	251	(420)	(169)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	64,86	54,96
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,33	32,75
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,83
Investmentfonds	5,47	7,21
Pensionsgeschäfte	0,41	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,53)	0,34
Zentral abgerechnete Finanzderivate	2,28	2,31
Freiverkehrsfinanzderivate	1,60	(1,04)
Einlagenzertifikate	0,70	0,07

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	k. A.	0,49
Bahamas	k. A.	0,37
Weissrussland	k. A.	0,08
Brasilien	2,19	2,65
Cayman-Inseln	0,45	0,70
Chile	3,66	k. A.
China	0,00	0,02
Kolumbien	0,21	k. A.
Kongo	0,23	0,27
Tschechische Republik	1,67	k. A.
Dänemark	0,24	2,08
Dominikanische Republik	3,81	1,52
Ghana	k. A.	0,48
Guatemala	0,39	k. A.
Ungarn	1,21	k. A.
Indien	0,21	k. A.
Irland	2,79	3,14
Israel	2,59	2,82
Elfenbeinküste	0,37	0,45
Jersey, Kanalinseln	k. A.	1,29
Luxemburg	0,04	1,19
Malaysia	1,66	k. A.
Mexiko	2,32	4,32
Niederlande	1,23	2,16
Panama	0,20	k. A.
Paraguay	0,22	k. A.
Peru	4,58	3,18
Polen	5,12	1,16
Rumänien	0,67	k. A.
Russland	0,06	0,05
Serbien	0,05	0,05
Südafrika	7,55	5,04
Südkorea	0,24	k. A.
Supranational	0,21	k. A.
Schweiz	0,19	k. A.
Tunesien	0,09	0,09
Türkei	0,86	0,91
Vereinigte Arabische Emirate	1,00	0,26
Großbritannien	1,34	1,36
USA	21,46	20,18
Usbekistan	0,57	0,62
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	1,24
Sambia	0,38	k. A.
Kurzfristige Instrumente	19,13	30,37
Investmentfonds	5,47	7,21
Pensionsgeschäfte	0,41	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,53)	0,34
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,26	0,08
Zinsswaps	2,02	2,23
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,62	0,29
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,13)	k. A.
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	0,04	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	(0,02)	(0,42)
Cross-Currency Swaps	0,03	0,04
Zinsswaps	0,04	0,12
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,66	(1,81)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,36	0,75
Einlagenzertifikate	0,70	0,07
Sonstige Aktiva und Passiva	0,88	2,23
Nettovermögen	100,00	100,00



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK STAATSEMISSIONEN</b>				<b>MALAYSIA STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>ASERBAIDSCHAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik				Malaysia Government International Bond			
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				12,000 % fällig am 03.10.2025 DOP 3.800 \$ 72 0,36				2,632 % fällig am 15.04.2031 MYR 30 \$ 6 0,03			
7,230 % fällig am 17.03.2026 \$ 200 \$ 195 0,97				13,000 % fällig am 30.01.2026 3.200 63 0,31				3,800 % fällig am 17.08.2023 5.400 1.158 5,77			
<b>BRASILIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Dominican Republic Government International Bond				Malaysia Government Investment Issue			
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				13,625 % fällig am 03.02.2033 8.000 180 0,90				3,422 % fällig am 30.09.2027 30 6 0,03			
0,000 % fällig am 31.07.2023 (b)(e) 23 0 0,00				13,625 % fällig am 10.02.2034 200 4 0,02				3,990 % fällig am 15.10.2025 400 87 0,43			
Oi S.A.				Summe Dominikanische Republik 319 1,59				4,369 % fällig am 31.10.2028 110 24 0,12			
0,000 % fällig am 25.02.2035 BRL 50 9 0,05				<b>UNGARN STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Malaysia 1.281 6,38			
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL				Ungarische Entwicklungsbank				<b>MEXIKO UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
9,850 % fällig am 16.07.2032 2.502 478 2,38				0,375 % fällig am 09.06.2026 € 100 95 0,47				Petroleos Mexicanos			
Vale S.A.				6,500 % fällig am 29.06.2028 \$ 200 198 0,99				10,000 % fällig am 07.02.2033 \$ 50 46 0,23			
0,000 % (e) 1.490 95 0,47				Hungary Government International Bond				Urbi Desarrolos Urbanos S.A.B. de C.V.			
Summe Brasilien 582 2,90				4,750 % fällig am 24.11.2032 HUF 6.200 15 0,08				8,790 % fällig am 09.12.2014 ^ MXN 5.000 0 0,00			
<b>CAYMAN INSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,000 % fällig am 22.02.2027 € 50 55 0,27				Summe Mexiko 826 4,11			
Interoceana Finance Ltd.				6,750 % fällig am 22.10.2028 HUF 4.200 12 0,06				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
0,000 % fällig am 30.11.2025 (b) \$ 14 13 0,07				Summe Ungarn 375 1,87				Mexico Government International Bond			
<b>CHILE STAATSEMISSIONEN</b>				<b>INDONESIEN STAATSEMISSIONEN</b>				5,000 % fällig am 06.03.2025 1.800 97 0,48			
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				Indonesia Government International Bond				7,000 % fällig am 03.09.2026 4.900 267 1,33			
5,000 % fällig am 01.10.2028 CLP 30.000 37 0,18				7,500 % fällig am 15.06.2035 IDR 65.000 5 0,02				7,500 % fällig am 03.06.2027 4.700 260 1,30			
6,000 % fällig am 01.04.2033 55.000 72 0,36				<b>IRLAND FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				7,750 % fällig am 29.05.2031 2.300 127 0,63			
6,000 % fällig am 01.01.2043 5.000 7 0,04				Black Diamond CLO DAC				8,500 % fällig am 31.05.2029 500 29 0,14			
Summe Chile 116 0,58				4,060 % fällig am 20.01.2032 € 84 90 0,45				Summe Mexiko 826 4,11			
<b>CHINA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				<b>NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Flourish Century				4,073 % fällig am 15.11.2031 100 107 0,53				Angola Via Avenir BV			
6,600 % fällig am 04.02.2022 ^ (h) \$ 200 22 0,11				Harvest CLO DAC				10,163 % fällig am 07.12.2023 \$ 5 5 0,03			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				4,250 % fällig am 26.06.2030 89 95 0,47				<b>PERU UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
China Government International Bond				Summe Irland 292 1,45				Banco de Credito del Peru S.A.			
3,020 % fällig am 27.05.2031 CNY 600 85 0,42				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,650 % fällig am 17.09.2024 PEN 1.230 326 1,62			
Summe China 107 0,53				Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>KOLUMBIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				9,350 % fällig am 06.08.2022 ^ RUB 33.000 11 0,06				Fondo MIVIENDA S.A.			
Empresas Publicas de Medellin ESP				Summe Irland 303 1,51				7,000 % fällig am 14.02.2024 130 35 0,17			
7,625 % fällig am 10.09.2024 COP 540.000 120 0,60				<b>ISRAEL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Peru Government International Bond			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Bank Leumi Le-Israël B.M.				7,300 % fällig am 12.08.2033 400 114 0,57			
Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter				7,129 % fällig am 18.07.2033 (g) \$ 200 198 0,98				Summe Peru 475 2,36			
7,875 % fällig am 12.08.2024 12.000 3 0,01				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>POLEN STAATSEMISSIONEN</b>			
Summe Kolumbien 123 0,61				Israel Government International Bond				Poland Government International Bond			
<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK STAATSEMISSIONEN</b>				0,150 % fällig am 31.07.2023 ILS 400 108 0,54				1,250 % fällig am 25.10.2030 PLN 150 27 0,14			
Czech Republic Government International Bond				1,500 % fällig am 30.11.2023 500 133 0,66				2,750 % fällig am 25.10.2029 300 63 0,31			
2,000 % fällig am 13.10.2033 CZK 400 15 0,07				Summe Israel 439 2,18				6,000 % fällig am 25.10.2033 200 50 0,25			
2,500 % fällig am 25.08.2028 4.600 192 0,96				<b>JERSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,500 % fällig am 25.07.2028 300 80 0,40			
Summe Tschechische Republik 207 1,03				Corsair International Ltd.				Summe Polen 220 1,10			
<b>DÄNEMARK UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,772 % fällig am 28.01.2027 € 100 109 0,54				<b>RUMÄNIEN STAATSEMISSIONEN</b>			
Jyske Realkredit A/S				<b>LUXEMBURG STAMMAKTIEN</b>				Romania Government International Bond			
1,500 % fällig am 01.10.2053 DKK 0 0 0,00				DrillCo Holding Lux S.A. (a) 311 6 0,03				4,250 % fällig am 28.04.2036 RON 100 17 0,09			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				DrillCo Holding Lux S.A. (a)(h) 787 15 0,08				<b>SÜDAFRIKA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
1,000 % fällig am 01.10.2050 0 0 0,00				Summe Stammaktien 21 0,11				Entwicklungsbank für das südliche Afrika			
1,500 % fällig am 01.10.2053 0 0 0,00				<b>PAR (000S)</b>				8,600 % fällig am 21.10.2024 (h) ZAR 3.200 167 0,83			
Nykredit Realkredit A/S				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Eskom Holdings SOC Ltd.			
1,000 % fällig am 01.10.2050 0 0 0,00				FORESEA Holding S.A.				7,850 % fällig am 02.04.2026 5.000 252 1,25			
1,000 % fällig am 01.10.2053 0 0 0,00				7,500 % fällig am 15.06.2030 \$ 14 12 0,06				Summe Par 419 2,08			
1,500 % fällig am 01.10.2053 0 0 0,00				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Realkredit Danmark A/S				5,250 % fällig am 23.05.2023 ^ (g) 200 12 0,06				South Africa Government International Bond			
1,000 % fällig am 01.10.2050 0 0 0,00				Summe Luxemburg 45 0,23				2,000 % fällig am 31.01.2025 (d) 2.615 134 0,67			
1,500 % fällig am 01.10.2053 0 0 0,00								7,000 % fällig am 28.02.2031 800 34 0,17			
Summe Dänemark 0 0,00											



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,750 %	15.03.2028	INR	5.600	\$ 1	0,00
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	15.03.2028	SGD	40	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	\$	1.450	51	0,25
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,140	04.01.2027	BRL	1.400	(34)	(0,16)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,325	04.01.2027		300	5	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,450	04.01.2027		300	(5)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,675	04.01.2027		1.700	(4)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,240	04.01.2027		400	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,565	04.01.2027		1.300	3	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,244	02.01.2026		800	(3)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,405	02.01.2029		100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,420	02.01.2026		900	4	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,708	02.01.2025		100	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,740	02.01.2025		200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,750	02.01.2025		200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024		1.300	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	01.07.2024		1.400	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,533	02.01.2029		400	(5)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,595	01.07.2024		1.200	1	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,684	02.01.2029		500	7	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,746	02.01.2029		500	7	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024		2.600	5	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025		200	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,218	02.01.2029		1.000	(17)	(0,08)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	1,860	07.05.2025	CNY	1.700	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.09.2027		2.770	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	15.03.2028		790	0	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	15.03.2028		420	(1)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	20.09.2028		500	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,995	24.11.2025	COP	113.800	4	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,125	15.01.2026		386.000	13	0,06
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,975	23.06.2027		216.900	7	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,040	13.01.2031		1.002.000	50	0,24
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,200	18.09.2030		824.860	(14)	(0,07)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,175	28.05.2027		1.045.600	21	0,11
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,630	11.01.2027		1.088.400	14	0,07
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,080	02.02.2027		79.000	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,130	31.01.2027		81.000	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,140	01.02.2027		149.300	1	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,500	15.02.2025		112.850	1	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,585	14.02.2027		236.000	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,890	08.04.2027		173.000	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,913	08.04.2027		266.200	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,940	08.04.2027		134.000	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,190	13.06.2029		494.700	4	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,200	11.03.2027		366.000	1	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,240	15.03.2027		101.600	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,305	28.04.2028		341.800	2	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,320	31.03.2027		203.000	1	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,390	13.06.2028		179.900	1	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,560	30.03.2027		58.200	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,686	30.03.2027		346.500	2	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,820	05.06.2028		314.400	(4)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,890	12.05.2029		269.000	4	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,940	24.03.2030		431.000	(8)	(0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,050	03.11.2027		3.357.000	34	0,17
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,050	02.05.2033		35.360	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,055	26.08.2026		200.000	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,177	26.11.2025		218.700	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,270	26.11.2025		243.000	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,280	26.11.2025		610.000	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,310	26.11.2025		473.000	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,370	17.03.2030		73.900	(2)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,393	21.03.2030		172.000	(4)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,423	17.03.2030		218.700	(5)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,430	16.06.2027		130.000	(2)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,470	01.07.2025		285.000	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,110	26.11.2025		274.280	(2)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,640	21.10.2025		817.000	(11)	(0,05)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,590	18.05.2028	ILS	200	0	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,665	15.03.2028	KRW	119.500	(1)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033		326.460	(3)	(0,01)
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB	4.520	1	0,01
Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,750	15.03.2033		50	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,375	20.10.2026	ZAR	2.740	14	0,07
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,067	21.12.2026		3.100	10	0,05

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,635 %	04.02.2027	ZAR 5.500	\$ 2	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,205	22.04.2027	1.200	3	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,210	22.04.2027	900	2	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,565	22.03.2026	2.900	3	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	17.10.2027	8.760	(2)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,830	23.02.2030	800	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,290	26.05.2028	2.500	2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,080	01.06.2030	CLP 62.000	(13)	(0,07)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,110	01.06.2030	20.000	(4)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,120	05.02.2030	29.000	(4)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,215	14.01.2030	143.000	26	0,13
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	20.03.2033	189.200	4	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,180	01.10.2028	35.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030	37.210	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,370	01.10.2028	17.900	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	20.03.2028	155.400	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	01.10.2028	35.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,420	01.10.2028	76.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,470	01.09.2030	50.000	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,570	01.10.2028	70.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,890	17.03.2032	12.100	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,930	17.03.2032	12.100	(2)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,010	16.02.2029	30.000	2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,020	02.03.2029	2.900	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,110	01.09.2030	23.100	2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,250	01.10.2028	4.600	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,370	29.06.2029	39.000	3	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,380	03.06.2027	116.000	5	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,420	24.03.2029	16.000	2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,550	15.06.2032	16.000	3	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,610	17.06.2032	40.300	6	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	01.10.2028	11.600	2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,195	01.10.2028	6.500	1	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK 4.700	(1)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 10	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	300	(4)	(0,02)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	7,840	07.02.2033	HUF 6.600	0	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	8,740	28.04.2028	14.400	(1)	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	13,600	12.12.2024	5.100	(1)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,980	09.06.2030	PLN 300	17	0,09
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,950	13.12.2026	1.500	21	0,10
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027	800	9	0,04
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,320	09.03.2027	150	1	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,220	20.03.2033	200	0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,310	21.03.2033	200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,340	28.03.2027	100	0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,430	16.03.2028	200	0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,520	20.03.2026	500	0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,620	21.03.2026	600	0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024	3.000	(30)	(0,14)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	7,310	30.06.2027	500	7	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,340	12.02.2024	MXN 22.060	(62)	(0,30)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,850	19.02.2025	3.700	18	0,09
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,463	18.05.2040	800	7	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,100	13.06.2031	3.590	15	0,08
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,950	20.02.2032	2.000	(1)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,050	24.02.2032	890	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,300	16.06.2028	600	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,414	14.12.2027	90	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,448	27.04.2028	400	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,457	27.04.2028	800	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,465	16.08.2027	400	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,515	17.12.2027	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,560	18.05.2028	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,585	18.05.2028	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,600	18.05.2028	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,600	04.03.2033	1.300	(3)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,656	18.05.2028	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,720	19.05.2028	200	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,722	19.05.2028	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,728	22.05.2028	700	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,755	19.05.2028	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,900	21.05.2027	900	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,060	18.06.2027	1.400	(1)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,090	08.07.2027	1.000	(1)	(0,01)
					<b>\$ 163</b>	<b>0,81</b>
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					<b>\$ 163</b>	<b>0,81</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens	
BOA	Put - OTC EUR versus CZK	CZK	23,830	01.11.2023	25	\$ 3	\$ 11	0,06
GLM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	9	1	6	0,03
	Put - OTC EUR versus PLN	PLN	4,560	01.11.2023	19	2	15	0,07
JPM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	19	2	12	0,06
MYI	Put - OTC USD versus BRL	BRL	4,820	22.08.2023	202	2	3	0,01
	Put - OTC USD versus MXN	MXN	18,500	25.07.2023	221	6	16	0,08
RBC	Put - OTC USD versus CAD	CAD	1,305	13.07.2023	228	1	0	0,00
UAG	Call - OTC EUR versus USD	\$	1,140	13.07.2023	207	1	0	0,00
	Call - OTC USD versus ZAR	ZAR	20,500	09.10.2023	363	5	4	0,02
					\$	23	\$ 67	0,33

#### STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs <sup>(2)</sup>	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten <sup>(2)</sup>	Markt-wert	% des Nettovermögens	
BOA	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600 %	27.12.2023	100	\$ 0	\$ 0	0,00	
	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,050	27.12.2023	100	0	0	0,00	
CBK	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,100	20.12.2023	400	0	0	0,00	
	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	29.12.2023	100	0	0	0,00	
MYI	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	27.12.2023	200	0	0	0,00	
					\$	0	\$ 0	0,00

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens	
JPM	Call - OTC USD versus INR	IDR	14,950,000	06.06.2024	58	\$ (2)	(2)	(0,01)
	Put - OTC USD versus INR	14,950,000	06.06.2024	58	(2)	(2)	(0,01)	
MYI	Call - OTC USD versus CLP	CLP	850,000	18.07.2023	129	0	0,00	
	Put - OTC USD versus MXN	MXN	17,750	25.07.2023	442	(3)	(14)	(0,07)
	Call - OTC USD versus MXN	21,000	07.03.2024	211	(4)	(2)	(0,01)	
					\$	(13)	\$ (20)	(0,10)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

<sup>(2)</sup> Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens	
BOA	Turkey Government International Bond	(1,000) %	20.06.2024	\$ 100	\$ 6	\$ (4)	\$ 2	0,01	
GST	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	100	4	(2)	2	0,01	
					\$	10	\$ (6)	\$ 4	0,02

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens	
GST	Poland Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 100	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00	
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	100	(2)	1	(1)	0,00	
					\$	(1)	\$ 1	\$ 0	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,333 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	30.05.2024	\$ 170	ARS 7.557	\$ (1)	\$ 163	\$ 162	0,81
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	60	2.693	0	58	58	0,29
						\$ (1)	\$ 221	\$ 220	1,10

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 200	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	457	0	1	1	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,265	14.06.2029	CLP 11.100	0	(2)	(2)	(0,01)
JPM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	MYR 1.477	(1)	0	(1)	(0,01)
						\$ (1)	\$ (1)	\$ (2)	(0,01)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	KES	4.674	\$ 33	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	PHP	997	18	0	0	0,00
	07.2023	PLN	462	111	0	(3)	(0,01)
	07.2023	\$	47	€ 43	0	0	0,00
	07.2023	699	MXN	12.862	49	0	0,25
	07.2023	5	PLN	19	0	0	0,00
	07.2023	22	TRY	478	0	(4)	(0,02)
	08.2023	CNY	183	\$ 26	1	0	0,00
	08.2023	INR	26.736	325	0	(1)	0,00
	08.2023	MXN	1.664	90	0	(6)	(0,03)
	08.2023	NZD	68	43	1	0	0,01
	08.2023	\$	300	CNY 2.059	0	(15)	(0,08)
	08.2023	7	EGP	249	0	0	0,00
	08.2023	22	TWD	672	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	2.000	\$ 107	2	2	0,01
	09.2023	NGN	2.318	4	1	0	0,01
	09.2023	PEN	651	176	0	(3)	(0,01)
	09.2023	\$	14	HKD 109	0	0	0,00
	09.2023	420	KRW	531.998	0	(14)	(0,07)
	09.2023	101	MYR	463	0	(1)	(0,01)
	09.2023	402	TWD	12.206	0	(9)	(0,05)
	10.2023	4	KES	624	0	0	0,00
	10.2023	ZAR	965	\$ 52	1	0	0,01
	11.2023	€	156	CZK 3.819	3	0	0,02
BPS	07.2023	BRL	451	\$ 94	1	0	0,00
	07.2023	€	30	33	0	0	0,00
	07.2023	PHP	20.565	366	0	(6)	(0,03)
	07.2023	PLN	217	52	0	(1)	0,00
	07.2023	SGD	142	107	2	2	0,01
	07.2023	\$	56	BRL 282	2	0	0,01
	07.2023	61	COP	277.278	5	5	0,02
	07.2023	321	CZK	6.914	0	(4)	(0,02)
	07.2023	436	€	398	0	(1)	(0,01)
	07.2023	22	£	17	0	0	0,00
	07.2023	26	¥	3.682	0	(1)	(0,01)
	07.2023	480	MYR	2.202	0	(7)	(0,03)
	07.2023	26	PHP	1.467	1	0	0,00
	07.2023	83	SGD	109	0	(2)	(0,01)
	08.2023	CNH	28	\$ 4	0	0	0,00
	08.2023	CNY	1.071	156	8	0	0,04
	08.2023	€	213	234	1	0	0,01
	08.2023	MYR	5.479	1.180	2	2	0,01
	08.2023	TWD	976	32	1	0	0,00
	08.2023	\$	354	CNY 2.421	0	(19)	(0,09)
	08.2023	43	COP	193.120	3	0	0,01
	08.2023	200	TWD	6.109	0	(4)	(0,02)
	08.2023	ZAR	974	\$ 53	2	0	0,01
	09.2023	CLP	25.348	31	0	0	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2023	PHP 5.657	\$ 101	0	0	0	(0,01)
	09.2023	THB 2	0	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 365	PHP 20.565	6	0	6	0,03
	09.2023	48	THB 1.658	0	(1)	(1)	0,00
	12.2023	NGN 810	\$ 1	0	0	0	0,00
	12.2023	\$ 70	MXN 1.242	1	0	1	0,00
	01.2024	ILS 6.236	\$ 1.753	58	0	58	0,29
	01.2024	ZAR 2.047	116	10	0	10	0,05
BRC	07.2023	CZK 91	4	0	0	0	0,00
	07.2023	MYR 189	41	1	0	1	0,00
	07.2023	PLN 122	29	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	RON 856	187	1	(2)	(1)	(0,01)
	07.2023	RSD 5.977	55	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 42	PLN 173	0	0	0	0,00
	07.2023	90	SGD 120	0	(2)	(2)	(0,01)
	08.2023	COP 2.752.653	\$ 646	0	(5)	(5)	(0,02)
	08.2023	ZAR 1.530	80	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	IDR 4.959	0	0	0	0	0,00
	09.2023	MXN 7.315	419	0	(1)	(1)	(0,01)
	09.2023	\$ 99	ILS 352	0	(3)	(3)	(0,02)
	09.2023	207	PEN 759	1	0	1	0,01
	10.2023	MXN 3.739	\$ 200	0	(14)	(14)	(0,07)
	10.2023	TRY 498	18	0	0	0	0,00
BSH	08.2023	PEN 61	15	0	(2)	(2)	(0,01)
CBK	07.2023	CLP 593.276	733	0	(6)	(6)	(0,03)
	07.2023	€ 231	248	0	(4)	(4)	(0,02)
	07.2023	PLN 1.113	266	0	(7)	(7)	(0,04)
	07.2023	TRY 4.990	222	32	0	32	0,16
	07.2023	\$ 65	BRL 310	0	0	0	0,00
	07.2023	84	COP 382.066	7	0	7	0,04
	07.2023	272	CZK 5.855	0	(3)	(3)	(0,01)
	07.2023	346	PHP 18.862	0	(5)	(5)	(0,02)
	07.2023	53	PLN 219	1	0	1	0,01
	07.2023	577	RON 2.609	0	(3)	(3)	(0,02)
	07.2023	35	UYU 1.325	0	0	0	0,00
	07.2023	UYU 2.928	\$ 76	0	(2)	(2)	(0,01)
	08.2023	BRL 454	88	0	(5)	(5)	(0,03)
	08.2023	CAD 20	15	0	0	0	0,00
	08.2023	COP 170.335	40	0	0	0	0,00
	08.2023	EGP 661	19	0	(2)	(2)	(0,01)
	08.2023	\$ 943	CLP 771.582	12	0	12	0,06
	08.2023	323	INR 26.736	2	0	2	0,01
	08.2023	9	NOK 89	0	0	0	0,00
	08.2023	60	PEN 236	4	0	4	0,02
	08.2023	208	TWD 6.360	0	(4)	(4)	(0,02)
	08.2023	30	ZAR 565	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	INR 26.736	\$ 323	0	(2)	(2)	(0,01)
	09.2023	KRW 5.215	4	0	0	0	0,00
	09.2023	MXN 2.471	133	0	(9)	(9)	(0,05)
	09.2023	PHP 5.715	101	0	(2)	(2)	(0,01)
	09.2023	\$ 704	IDR 10.510.877	0	(6)	(6)	(0,03)
	09.2023	220	INR 18.255	2	0	2	0,01
	09.2023	ZMW 159	\$ 9	0	0	0	0,00
	10.2023	CLP 5.926	7	0	0	0	0,00
	10.2023	\$ 5	NGN 2.985	0	(1)	(1)	(0,01)
	11.2023	ILS 492	149	16	0	16	0,08
	11.2023	\$ 86	EGP 2.763	0	(6)	(6)	(0,03)
	02.2024	EGP 325	\$ 9	0	0	0	0,00
	02.2024	\$ 31	EGP 1.071	0	(2)	(2)	(0,01)
DUB	07.2023	ILS 392	\$ 112	6	0	6	0,03
	07.2023	RON 188	42	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 626	BRL 3.394	78	0	78	0,38
	10.2023	14	NGN 8.028	0	(4)	(4)	(0,02)
	10.2023	1	ZAR 10	0	0	0	0,00
	11.2023	EGP 1.590	\$ 56	10	0	10	0,05
	01.2024	NGN 3.075	5	1	0	1	0,01
	01.2024	\$ 14	ZAR 285	0	0	0	0,00
	02.2024	128	EGP 4.495	0	(8)	(8)	(0,04)
GLM	07.2023	BRL 3.965	\$ 821	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023	COP 67.560	16	0	0	0	0,00
	07.2023	DOP 909	16	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	EGP 973	31	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	RON 1.256	278	2	0	2	0,01
	07.2023	SGD 30	22	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 152	BRL 796	13	0	13	0,06
	07.2023	164	COP 694.514	2	0	2	0,01
	07.2023	65	CZK 1.393	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023	29	EGP 953	2	0	2	0,01
	07.2023	275	MXN 4.837	7	0	7	0,03
	07.2023	3	PLN 11	0	0	0	0,00



Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	\$	RON	1.254	\$	(1)	(0,01)
	08.2023	BRL	\$	91		(3)	(0,01)
	08.2023	CNH		622		4	0,02
	08.2023	DOP		274		(6)	(0,03)
	08.2023	\$	DOP	8.574		5	0,02
	08.2023		NOK	40		0	0,00
	08.2023	ZAR	\$	78		2	0,01
	09.2023	TRY		65		3	0,02
	09.2023	\$	BRL	3.880		1	0,00
	09.2023		THB	6.923		(4)	(0,02)
	10.2023	DOP	\$	99		1	0,00
	10.2023	NGN		27		8	0,04
	11.2023	EGP		56		10	0,05
	11.2023	€	PLN	652		0	0,00
	11.2023	\$	EGP	365		(2)	(0,01)
	12.2023	DOP	\$	24		1	0,00
	01.2024	EGP		29		(1)	(0,00)
IND	08.2023	CNH	\$	41		1	0,01
	08.2023	\$	NOK	101		0	0,00
	11.2023	€	HUF	9.727		5	0,02
	06.2024	\$	TWD	2.110		0	(0,06)
JPM	07.2023	\$	BRL	212		1	0,01
	07.2023	¥	\$	0		0	0,00
	07.2023	PLN		22		(1)	(0,00)
	07.2023	TRY		80		4	0,02
	07.2023	\$	BRL	212		1	0,00
	07.2023		€	211		5	0,02
	07.2023		MXN	1.295		2	0,01
	07.2023		NGN	2.156		(1)	(0,01)
	07.2023		PHP	1.234		0	0,00
	07.2023		SGD	2.230		(39)	(0,20)
	08.2023	CAD	\$	24		0	0,00
	08.2023	CHF		3		0	0,00
	08.2023	CNH		3		0	0,00
	08.2023	CNY		96		1	0,01
	08.2023	COP		24		0	0,00
	08.2023	HUF		203		(2)	(0,01)
	08.2023	MXN		112		0	0,00
	08.2023	\$	CNH	684		(2)	(0,01)
	08.2023		CNY	2.554		(20)	(0,10)
	08.2023		EGP	412		1	0,00
	08.2023		¥	1.249		0	0,00
	08.2023		ZAR	1.994		3	0,02
	08.2023	ZAR	\$	83		(2)	(0,01)
	09.2023	COP		15		0	0,00
	09.2023	PEN		161		(2)	(0,01)
	09.2023	\$	ILS	338		(4)	(0,02)
	09.2023		INR	2.633		0	0,00
	09.2023		NGN	2.012		(1)	(0,00)
	09.2023		THB	14.363		(11)	(0,05)
	10.2023	MXN	\$	90		0	0,00
	10.2023	\$	NGN	4.093		(2)	(0,01)
	11.2023	HUF	€	21		(5)	(0,02)
	12.2023	NGN	\$	5		1	0,01
	12.2023	\$	NGN	3.792		(1)	(0,01)
	01.2024		EGP	1.065		(3)	(0,02)
	02.2024	EGP	\$	12		0	0,00
	04.2024	KES		47		(1)	(0,00)
MBC	06.2024	\$	IDR	120.000		0	0,00
	07.2023	€	\$	60		(1)	(0,00)
	07.2023	£		127		(3)	(0,02)
	07.2023	PLN		2		0	0,00
	07.2023	\$	COP	322.546		1	0,01
	08.2023	CNY	\$	24		1	0,01
	08.2023	\$	ZAR	353		0	0,00
	09.2023		INR	3.309		0	0,00
	09.2023		KRW	986.170		(22)	(0,11)
	01.2024		EGP	1.358		(4)	(0,02)
MYI	07.2023	CZK	\$	101		1	0,00
	07.2023	MXN		22		(1)	(0,01)
	07.2023	MYR		14		0	0,00
	07.2023	PLN		97		(3)	(0,01)
	07.2023	\$	COP	839.564		1	0,00
	07.2023		MYR	23		0	0,00
	07.2023		PLN	350		2	0,01
	08.2023	CHF	\$	20		0	0,00
	08.2023	TWD		22		0	0,00
	08.2023	\$	TWD	6.574		(6)	(0,03)
	08.2023		ZAR	1.773		2	0,01
	09.2023	TRY	\$	33		0	0,00
	09.2023	\$	IDR	1.912.383		(1)	(0,01)
	09.2023		KRW	1.108.296		(21)	(0,11)
	09.2023		THB	6.547		(5)	(0,03)
	10.2023	ZAR	\$	1		0	0,00
	11.2023	EGP		6		0	0,00
	01.2024			18		0	0,00
	01.2024	NGN		5		1	0,01

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2024	\$ 31	EGP 1.035	0	\$ (3)	\$(3)	(0,01)
	02.2024	EGP 259	\$ 7	0	0	0	0,00
RBC	07.2023	MXN 1.413	73	0	(9)	(9)	(0,04)
	08.2023	\$ 1.546	MXN 26.789	4	0	4	0,02
RYL	07.2023	PLN 114	\$ 27	2	(1)	(1)	(0,01)
SCX	07.2023	NGN 2.635	5	0	0	2	0,01
	07.2023	TRY 2.302	100	12	0	12	0,06
	07.2023	\$ 40	€ 10	0	0	0	0,00
	07.2023	11	KES 5.754	1	0	1	0,01
	07.2023	481	MYR 2.210	0	(7)	(7)	(0,03)
	07.2023	1	NGN 768	0	0	0	0,00
	08.2023	NZD 24	\$ 15	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD 533	17	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 22	CNH 157	0	(1)	(1)	(0,00)
	08.2023	993	CNY 6.782	0	(55)	(55)	(0,27)
	09.2023	CLP 19.358	\$ 24	0	0	0	0,00
	09.2023	TWD 1	0	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 124	IDR 1.857.507	0	0	0	0,00
	09.2023	2.055	INR 170.362	16	0	16	0,08
	09.2023	430	THB 14.863	0	(8)	(8)	(0,04)
	09.2023	335	TWD 10.199	0	(6)	(6)	(0,03)
	11.2023	EGP 219	\$ 6	0	0	0	0,00
	11.2023	\$ 30	EGP 1.165	4	0	4	0,02
	12.2023	21	KES 3.089	0	0	0	0,00
	01.2024	0	EGP 13	0	0	0	0,00
	01.2024	7	NGN 5.754	0	0	0	0,00
	06.2024	KES 3.226	\$ 21	0	0	0	0,00
SOG	07.2023	€ 346	372	0	(5)	(5)	(0,03)
	07.2023	SGD 167	126	3	0	3	0,01
	07.2023	\$ 1.110	PLN 4.781	66	0	66	0,33
	07.2023	29	RON 130	0	(1)	(1)	(0,00)
	01.2024	18	EGP 586	0	(2)	(2)	(0,01)
SSB	07.2023	BRL 579	\$ 115	0	(5)	(5)	(0,02)
	07.2023	\$ 740	CLP 594.127	0	0	0	0,00
	08.2023	CLP 595.843	\$ 740	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW 2.546.459	1.997	56	0	56	0,28
	09.2023	\$ 15	CLP 12.283	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	109	£ 86	0	0	0	0,00
	08.2023	£ 86	\$ 109	0	0	0	0,00
	08.2023	HUF 44.197	126	0	(2)	(2)	(0,01)
UAG	07.2023	COP 817.577	196	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 995	TRY 22.932	0	(123)	(123)	(0,61)
	08.2023	28	CAD 38	1	0	1	0,00
	08.2023	18	CNH 122	0	(1)	(1)	(0,00)
	08.2023	196	COP 823.851	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR 618	\$ 33	0	0	0	0,00
	09.2023	SGD 301	225	2	0	2	0,01
	09.2023	\$ 54	ILS 193	0	(2)	(2)	(0,01)
	10.2023	53	ZAR 974	0	(2)	(2)	(0,01)
	11.2023	CZK 3.820	€ 156	0	(3)	(3)	(0,01)
				\$ 598	\$ (649)	\$ (51)	(0,25)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 218	1,09

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Banco Davivienda S.A. 13,501 % fällig am 13.12.2024 15,389 % fällig am 21.02.2024	COP 91.000 30.000	\$ 22 7	0,11 0,04
BanColombia S.A. 5,917 % fällig am 27.01.2024 13,320 % fällig am 08.06.2025 13,637 % fällig am 14.12.2024 16,137 % fällig am 01.09.2024	141.800 47.000 124.000 51.000	34 11 30 12	0,16 0,05 0,15 0,06
BBVA Colombia S.A. 5,870 % fällig am 15.07.2024 14,540 % fällig am 13.01.2024	104.000 58.400	23 14	0,12 0,07
Summe Einlagenzertifikate		\$ 153	0,76
Summe Anlagen		\$ 19.999	99,58
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 84	0,42
Nettovermögen		\$ 20.083	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,99 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	\$ 215	\$ 167	0,83
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	16	15	0,08
Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2022	25.08.2021	197	22	0,11
		<b>\$ 428</b>	<b>\$ 204</b>	<b>1,02</b>

Barmittel in Höhe von 273 USD (31. Dezember 2022: 282 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

#### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 17.095	\$ 258	\$ 17.353
Investmentfonds	1.960	0	0	1.960
Pensionsgeschäfte	0	150	0	150
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2	381	0	383
Einlagen bei Kreditinstituten	0	54	99	153
Summen	\$ 1.962	\$ 17.680	\$ 357	\$ 19.999

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 15.014	\$ 250	\$ 15.264
Investmentfonds	205	1.853	0	2.058
Pensionsgeschäfte	0	2.766	0	2.766
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	993	0	993
Einlagen bei Kreditinstituten	0	34	44	78
Summen	\$ 205	\$ 20.660	\$ 294	\$ 21.159

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 15	\$ 0	\$ 15	\$ 95	\$ 0	\$ 95
BPS	56	0	56	(152)	0	(152)
BRC	(26)	0	(26)	21	0	21
BSH	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	6	0	6	98	0	98
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)
DUB	84	0	84	13	0	13
GLM	280	(270)	10	404	(270)	134
GST	3	0	3	k. A.	k. A.	k. A.
IND	(6)	0	(6)	(9)	0	(9)
JPM	(73)	0	(73)	49	0	49
MBC	(28)	0	(28)	(34)	0	(34)
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(14)	0	(14)
MYI	(30)	0	(30)	25	0	25
RBC	(5)	0	(5)	1	0	1
RYL	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	(42)	0	(42)	124	0	124

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
SOG	\$ 61	\$ 0	\$ 61	\$ 38	\$ 0	\$ 38
SSB	51	0	51	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(2)	0	(2)	(213)	0	(213)
UAG	(123)	0	(123)	116	0	116

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	69,29	27,93
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	17,00	44,26
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,11	0,70
Investmentfonds	9,76	9,83
Pensionsgeschäfte	0,75	13,22
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,09
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,81	1,99
Freiverkehrsfinanzderivate	1,09	2,67
Einlagezertifikate	0,76	0,37

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	k. A.	0,22
Aserbaidschan	0,97	0,93
Brasilien	2,90	2,81
Cayman-Inseln	0,07	0,21
Chile	0,58	0,03
China	0,53	0,11
Kolumbien	0,61	1,99
Tschechische Republik	1,03	0,85
Dänemark	0,00	1,89
Dominikanische Republik	1,59	0,31
Ungarn	1,87	0,93
Indonesien	0,02	0,00
Irland	1,51	1,52
Israel	2,18	2,07
Jersey, Kanalinseln	0,54	0,51
Luxemburg	0,23	0,13
Malaysia	6,38	k. A.
Mauritius	k. A.	0,87
Mexiko	4,11	1,62
Niederlande	0,03	0,05
Peru	2,36	1,60
Polen	1,10	0,37
Rumänien	0,09	k. A.
Katar	k. A.	0,45
Südafrika	3,47	3,99
Großbritannien	0,62	1,48
USA	5,44	5,71
Uruguay	0,32	k. A.
Sambia	0,08	0,13
Kurzfristige Instrumente	47,77	42,11
Investmentfonds	9,76	9,83
Pensionsgeschäfte	0,75	13,22
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,09
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,81	1,99
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,33	0,13
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,10)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	0,02	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	1,10	1,01
Zinsswaps	(0,01)	0,00
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,25)	1,53
Einlagezertifikate	0,76	0,37
Sonstige Aktiva und Passiva	0,42	(1,06)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				<b>BANKEN UND FINANZEN</b>			
Wm Morrison Supermarkets Ltd. 8,073 % fällig am 04.11.2027	€	800	0,29	Corporate Office Properties LP 2,000 % fällig am 15.01.2029	\$	100	0,03	JAB Holdings BV 5,000 % fällig am 12.06.2033	€	200	0,09
ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig am 13.12.2029	\$	400	0,13	CPI Property Group S.A. 1,750 % fällig am 14.01.2030	€	300	0,10	KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029	\$	1.250	0,49
Acef Holding S.C.A. 0,750 % fällig am 14.06.2028	€	100	0,03	2,750 % fällig am 27.09.2031	€	300	0,10	Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032		640	0,17
1,250 % fällig am 26.04.2030		300	0,10	Credit Agricole Assurances S.A. 1,500 % fällig am 06.10.2031	€	200	0,07	2,650 % fällig am 15.11.2033		200	0,05
AIB Group PLC 2,875 % fällig am 30.05.2031		400	0,16	Crown Castle, Inc. 3,100 % fällig am 15.11.2029	\$	550	0,19	Kookmin Bank 2,500 % fällig am 04.11.2030 (f)		200	0,06
Ally Financial, Inc. 2,200 % fällig am 02.11.2028	\$	600	0,19	CTP NV 1,250 % fällig am 21.06.2029	€	400	0,12	Lendlease Finance Ltd. 3,400 % fällig am 27.10.2027	AUD	1.100	0,25
8,000 % fällig am 01.11.2031		350	0,14	1,500 % fällig am 10.02.2034		400	0,12	Logicor Financier SARL 2,000 % fällig am 17.01.2034	€	500	0,14
American Express Co. 4,050 % fällig am 03.05.2029		500	0,19	Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032 (g)	\$	350	0,12	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,494 % fällig am 13.10.2032	\$	700	0,22
American Tower Corp. 3,100 % fällig am 15.06.2050		200	0,05	3,742 % fällig am 07.01.2033		500	0,14	5,475 % fällig am 22.02.2031		800	0,31
3,800 % fällig am 15.08.2029		150	0,05	6,720 % fällig am 18.01.2029		500	0,20	Mizuho Financial Group, Inc. 2,201 % fällig am 10.07.2031		800	0,25
Asian Development Bank 6,550 % fällig am 26.01.2025	ZAR	42.000	0,84	7,079 % fällig am 10.02.2034		500	0,18	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 5,875 % fällig am 23.05.2042		400	0,16
Banco BTG Pactual S.A. 2,750 % fällig am 11.01.2026	\$	600	0,22	Digital Dutch Finco BV 0,625 % fällig am 15.07.2025	€	600	0,23	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,750 % fällig am 15.11.2031		300	0,10
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028	€	100	0,04	1,000 % fällig am 15.01.2032		500	0,15	NE Property BV 2,000 % fällig am 20.01.2030	€	200	0,06
Banco Mercantil del Norte S.A. 6,625 % fällig am 24.01.2032 (e)(f)	\$	200	0,06	EQT AB 0,875 % fällig am 14.05.2031		600	0,18	3,375 % fällig am 14.07.2027		300	0,12
BanColombia S.A. 3,000 % fällig am 29.01.2025		600	0,22	2,375 % fällig am 06.04.2028		700	0,26	New Immo Holding S.A. 2,750 % fällig am 26.11.2026		200	0,08
Bank Mandiri Persero Tbk PT 2,000 % fällig am 19.04.2026		200	0,07	Equinix, Inc. 2,500 % fällig am 15.05.2031	\$	50	0,02	Nexi SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026		259	0,10
Bank of America Corp. 2,687 % fällig am 22.04.2032		1.100	0,36	3,900 % fällig am 15.04.2032		260	0,09	Nomura Holdings, Inc. 2,172 % fällig am 14.07.2028	\$	600	0,20
6,204 % fällig am 10.11.2028		300	0,12	Equitable Financial Life Global Funding 1,800 % fällig am 08.03.2028		700	0,23	OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027		826	0,28
Bank of Ireland Group PLC 4,875 % fällig am 16.07.2028	€	500	0,21	First American Financial Corp. 2,400 % fällig am 15.08.2031		600	0,18	PennyMac Financial Services, Inc. 5,750 % fällig am 15.09.2031		200	0,06
7,594 % fällig am 06.12.2032	£	400	0,19	Ford Motor Credit Co. LLC 4,687 % fällig am 09.06.2025		200	0,08	Protective Life Global Funding 1,737 % fällig am 21.09.2030		800	0,25
Banque Ouest Africaine de Developpement 2,750 % fällig am 22.01.2033	€	470	0,15	5,584 % fällig am 18.03.2024		200	0,08	Rayonier LP 2,750 % fällig am 17.05.2031		600	0,19
Barclays PLC 4,836 % fällig am 09.05.2028	\$	400	0,14	FS KKR Capital Corp. 3,125 % fällig am 12.10.2028		450	0,14	Reinsurance Group of America, Inc. 6,000 % fällig am 15.09.2033		200	0,08
5,501 % fällig am 09.08.2028		500	0,19	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	€	400	0,13	Rexford Industrial Realty LP 2,150 % fällig am 01.09.2031		100	0,03
7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(f)		200	0,08	Goldman Sachs Group, Inc. 2,383 % fällig am 21.07.2032	\$	800	0,25	Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % fällig am 09.09.2026		800	0,31
BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig am 30.06.2027		400	0,14	Goodman U.S. Finance Five LLC 4,625 % fällig am 04.05.2032		700	0,25	Santander UK Group Holdings PLC 3,823 % fällig am 03.11.2028		200	0,07
4,625 % fällig am 25.02.2031 (e)(f)		200	0,06	Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % fällig am 15.03.2028		500	0,18	6,534 % fällig am 10.01.2029		400	0,16
7,750 % fällig am 16.08.2029 (e)(f)		800	0,30	GPT Wholesale Office Fund 3,222 % fällig am 05.11.2031	AUD	400	0,08	Segro Capital SARL 1,875 % fällig am 23.03.2030	€	250	0,09
Boston Properties LP 2,550 % fällig am 01.04.2032		400	0,12	Grainger PLC 3,000 % fällig am 03.07.2030	£	100	0,04	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026		400	0,14
BPCE S.A. 2,045 % fällig am 19.10.2027		300	0,10	Hanwha Life Insurance Co. Ltd. 3,379 % fällig am 04.02.2032	\$	300	0,11	1,750 % fällig am 24.11.2028		200	0,06
Brookfield Finance UK PLC 2,340 % fällig am 30.01.2032		550	0,17	HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026		610	0,21	SLM Corp. 3,125 % fällig am 02.11.2026	\$	900	0,31
CaixaBank S.A. 3,625 % fällig am 14.09.2028 (e)(f)	€	200	0,06	3,750 % fällig am 15.09.2030		230	0,07	Societe Generale S.A. 4,750 % fällig am 26.05.2026 (e)(f)		200	0,06
3,750 % fällig am 07.09.2029		300	0,13	Host Hotels & Resorts LP 2,900 % fällig am 15.12.2031		100	0,03	6,691 % fällig am 10.01.2034		1.000	0,40
6,208 % fällig am 18.01.2029	\$	500	0,20	3,375 % fällig am 15.12.2029		800	0,27	Sofina S.A. 1,000 % fällig am 23.09.2028	€	200	0,07
Castellum Helsinki Finance Holding Abp 0,875 % fällig am 17.09.2029	€	300	0,09	3,500 % fällig am 15.09.2030		240	0,08	Standard Chartered PLC 2,678 % fällig am 29.06.2032	\$	500	0,15
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,900 % fällig am 12.10.2029		500	0,16	Howard Hughes Corp. 4,375 % fällig am 01.02.2031		700	0,22	3,603 % fällig am 12.01.2033 (g)		200	0,06
Citigroup, Inc. 2,976 % fällig am 05.11.2030	\$	200	0,07	HSBC Holdings PLC 3,973 % fällig am 22.05.2030		200	0,07	6,301 % fällig am 09.01.2029		700	0,28
5,746 % fällig am 25.01.2026 (g)		500	0,20	4,583 % fällig am 19.06.2029		500	0,18	SVB Financial Group 4,570 % fällig am 29.04.2033 ^		370	0,10
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	€	300	0,09	6,254 % fällig am 09.03.2034		600	0,24	Svenska Handelsbanken AB 4,750 % fällig am 01.03.2031 (e)(f)		200	0,06
CNP Assurances 1,250 % fällig am 27.01.2029		400	0,14	Hudson Pacific Properties LP 3,950 % fällig am 01.11.2027		250	0,07	UBS Group AG 4,375 % fällig am 10.02.2031 (e)(f)		200	0,06
Cooperative Rabobank UA 1,004 % fällig am 24.09.2026	\$	900	0,32	5,950 % fällig am 15.02.2028		150	0,05	5,959 % fällig am 12.01.2034		400	0,16
				ING Groep NV 4,125 % fällig am 24.08.2033	€	300	0,12	UniCredit SpA 5,459 % fällig am 30.06.2035		300	0,10
				4,250 % fällig am 16.05.2031 (e)(f)	\$	200	0,05	VIA Outlets BV 1,750 % fällig am 15.11.2028	€	500	0,17
				4,875 % fällig am 16.05.2029 (e)(f)		700	0,21				
				Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 3,000 % fällig am 27.09.2023		10.950	8				
				Intesa Sanpaolo SpA 4,198 % fällig am 01.06.2032		200	0,06				
				5,017 % fällig am 26.06.2024		200	0,08				
				6,625 % fällig am 31.05.2033	£	600	0,29				
				6,625 % fällig am 20.06.2033	\$	500	0,20				



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
4,216 % fällig am 10.08.2033	\$ 105	\$ 92	0,04	3,715 % fällig am 10.11.2036	1.795	1.173	0,46	Structured Asset Investment Loan Trust	1.405	1.205	0,47
4,498 % fällig am 10.08.2035	1.600	1.413	0,55			35.041	13,76	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
4,715 % fällig am 10.08.2033	2.190	1.720	0,67	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				5,440 % fällig am			
5,122 % fällig am 10.08.2035	550	451	0,18	<b>Ameriquist Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>				25.07.2036 ^	1.318	1.254	0,49
<b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>				6,200 % fällig am 25.05.2035	1.275	1.148	0,45	Structured Asset Securities Corp. Trust	72	57	0,02
5,470 % fällig am 25.06.2046 ^	790	682	0,27	Argent Securities Trust	2.021	604	0,24	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust	1.051	1.032	0,41
<b>Bridgegate Funding PLC</b>				5,450 % fällig am 25.06.2036				6,150 % fällig am 25.10.2034		17.041	6,69
8,466 % fällig am 16.10.2062	£ 950	1.196	0,47	<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
9,466 % fällig am 16.10.2062	950	1.192	0,47	5,850 % fällig am 25.08.2036	1.287	1.160	0,46	Chile Government International Bond	300	279	0,11
<b>Commercial Mortgage Trust</b>				6,275 % fällig am 25.02.2035	61	60	0,02	3,500 % fällig am 31.01.2034	300	265	0,11
3,960 % fällig am 10.02.2036	\$ 3.000	2.612	1,03	<b>BNC Mortgage Loan Trust</b>				<b>Fondo MIVIVIENDA S.A.</b>			
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust	1.290	1.089	0,43	3,821 % fällig am 25.10.2036	104	75	0,03	4,625 % fällig am 12.04.2027	300	290	0,11
<b>EMF-UK PLC</b>				<b>Centex Home Equity Loan Trust</b>				Mexico Government International Bond	€ 870	704	0,28
5,970 % fällig am 13.03.2046	£ 3.250	4.093	1,61	6,065 % fällig am 25.10.2035	41	41	0,02	Romania Government International Bond	600	500	0,20
<b>Great Hall Mortgages PLC</b>				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust	5.290	5.290	0,02	1,750 % fällig am 13.07.2030	600	500	0,20
5,282 % fällig am 18.06.2038	2.040	2.514	0,99	5,290 % fällig am 25.06.2047 ^	70	62	0,02	Serbia Government International Bond	400	339	0,13
<b>Independence Plaza Trust</b>				5,670 % fällig am 25.12.2036 ^	305	286	0,11	South Africa Government International Bond	8.000	440	0,17
3,763 % fällig am 10.07.2035	\$ 345	322	0,13	<b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b>				10,500 % fällig am		2.817	1,11
3,911 % fällig am 10.07.2035	1.940	1.797	0,71	4,234 % fällig am 25.03.2036	1.447	1.285	0,51	21.12.2026	ZAR		
4,158 % fällig am 10.07.2035	132	122	0,05	5,900 % fällig am 25.12.2035	968	920	0,36				
4,356 % fällig am 10.07.2035	1.050	944	0,37	<b>GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust</b>							
<b>Madison Avenue Mortgage Trust</b>				5,520 % fällig am 22.02.2055	677	646	0,25				
3,478 % fällig am 15.08.2034	690	588	0,23	<b>GSAMP Trust</b>							
3,600 % fällig am 15.08.2034	225	185	0,07	5,630 % fällig am 25.06.2036	1.837	979	0,38				
4,108 % fällig am 15.08.2034	1.900	1.510	0,59	6,050 % fällig am 25.11.2035 ^	100	94	0,04				
<b>MortgageIT Trust</b>				<b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b>							
5,750 % fällig am 25.08.2035	358	341	0,13	4,459 % fällig am 25.01.2037	4.250	2.327	0,91				
<b>Natixis Commercial Mortgage Securities Trust</b>				<b>Lehman XS Trust</b>							
3,917 % fällig am 15.11.2032	1.220	1.016	0,40	5,470 % fällig am 25.02.2037	598	577	0,23				
<b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>				<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>							
5,530 % fällig am 25.12.2036	75	66	0,03	5,450 % fällig am 25.11.2036	516	372	0,15				
<b>Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust</b>				5,460 % fällig am 25.08.2036	2.555	1.382	0,54				
4,573 % fällig am 25.04.2037	43	34	0,01	<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>							
<b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>				5,825 % fällig am 25.09.2035	500	464	0,18				
5,795 % fällig am 25.04.2035	49	46	0,02	<b>Mosaic Solar Loans LLC</b>							
<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>				4,450 % fällig am 20.06.2042	\$ 486	\$ 459	0,18				
5,161 % fällig am 20.10.2051	£ 3.000	3.775	1,48	<b>Soundview Home Loan Trust</b>							
<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>				5,650 % fällig am 25.10.2036	591	552	0,22				
3,342 % fällig am 25.11.2036 ^	\$ 87	\$ 75	0,03								
<b>Worldwide Plaza Trust</b>											

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettvermögens
BPS	5,100 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 20.900	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030	\$ (21.377)	\$ 20.900	\$ 20.909	8,21
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	3.300	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031	(3.383)	3.300	3.301	1,30
	5,180	30.06.2023	03.07.2023	7.600	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.04.2025	(7.755)	7.600	7.603	2,98
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (32.515)</b>	<b>\$ 31.800</b>	<b>\$ 31.813</b>	<b>12,49</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	5	\$ 33	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	3	13	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	4	13	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	4	23	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	2	7	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	4	26	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	2	8	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	3	9	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	3	15	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	3	10	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	2	(3)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	10	22	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	52	109	0,04



## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	10	\$ 12	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1	0	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	14	(28)	(0,01)
				\$ 269	0,11

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	5	\$ (2)	\$ (2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	5	(2)	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	1	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	1	(1)	0	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	6	(10)	0	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	7	(14)	(1)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	6	(11)	(1)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	9	(17)	(1)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	9	(19)	(2)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	3	(2)	0	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	6	(11)	(21)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	7	(14)	(26)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	6	(12)	(23)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	9	(18)	(36)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	9	(19)	(40)	(0,02)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	3	(3)	(14)	(0,01)
				\$ (155)	\$ (167)	(0,07)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ 102 0,04

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.06.2028	€ 200	\$ 0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	900	2	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	100	0	0,00
				\$ 2	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500 %	20.09.2033	£ 1.500	\$ 108	0,04
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2026	¥ 330.000	3	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2028	890.000	67	0,03
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	1.690.000	(200)	(0,08)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	330.000	22	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	170.000	39	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.07.2023	\$ 500	7	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	18.07.2023	500	7	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	8.800	121	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	06.09.2023	500	7	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	150	16	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	100	13	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	6.000	(610)	(0,24)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	40	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	8.800	(145)	(0,06)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,350	20.01.2027	200	20	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	15.02.2027	550	54	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	500	(52)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,418	20.01.2027	250	(24)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,420	24.02.2027	400	38	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	500	(47)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,443	18.01.2027	500	(50)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	500	47	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	50	9	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	800	(104)	(0,04)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	12.01.2029	110	14	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518 %	20.01.2029	\$ 150	\$ (19)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	200	(32)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,550	20.01.2027	700	(63)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,570	11.01.2027	200	(18)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,570	12.01.2027	100	(9)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,573	28.02.2027	300	(29)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	300	(26)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	2.700	99	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	15.02.2027	2.200	(181)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,618	09.02.2029	200	(24)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,620	18.04.2027	300	(27)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	150	(18)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	24.02.2027	1.300	(110)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	08.02.2032	250	(38)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,655	24.01.2032	150	(23)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	06.03.2024	500	(12)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	2.100	(174)	(0,07)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	12.01.2029	400	(45)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	150	(22)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,735	12.01.2032	150	(23)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	300	(42)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,770	14.02.2032	150	(21)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	400	(34)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	50	16	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	500	(42)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,815	24.01.2052	50	(15)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	150	(20)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,867	26.01.2052	50	(14)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,872	06.04.2032	150	(20)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	22.03.2029	200	(21)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	300	(25)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	2.820	70	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	2.600	56	0,02
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	18.02.2032	200	(25)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	9.850	(316)	(0,12)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	200	(62)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	17.06.2027	400	(25)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	2.000	73	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	3.500	82	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,370	21.06.2027	400	(24)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,430	30.09.2027	460	36	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	6.800	161	0,06
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	460	35	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,605	28.06.2027	400	(20)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	3.200	159	0,06
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,850	30.08.2027	1.000	(52)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,880	30.09.2027	1.300	(64)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	1.300	(63)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,955	04.10.2027	300	(14)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	1.570	23	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	40	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	600	(26)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	600	(26)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	500	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	600	(24)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	4.810	(142)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	200	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	400	(10)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	100	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,420	24.05.2033	300	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	500	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	400	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	600	(5)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.05.2033	21.620	(62)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	400	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	200	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	200	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	12.640	(31)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	10.300	199	0,08
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	13.12.2027	400	7	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,040	20.06.2024	1.500	(11)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,060	20.06.2024	6.000	(44)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,140	22.06.2024	2.500	(16)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	47.760	(202)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	27.590	(13)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,100	22.05.2024	92.690	(101)	(0,04)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,400 %	06.06.2024	\$ 53.540	\$ 47	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.07.2023	500	(7)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	18.07.2023	500	(7)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	8.800	(121)	(0,05)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	06.09.2023	500	(7)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023	150	2	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.09.2023	100	1	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.09.2023	6.000	(66)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023	40	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,350	20.07.2023	200	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	15.08.2023	550	4	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,418	20.07.2023	250	(2)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,420	24.08.2023	400	3	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,425	18.07.2023	500	(3)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	16.07.2023	50	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	17.08.2023	500	3	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	12.07.2023	110	1	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023	800	(8)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023	150	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	15.07.2023	200	(2)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,550	20.07.2023	700	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	11.07.2023	200	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	12.07.2023	100	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	16.08.2023	300	(2)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,600	15.08.2023	2.200	(12)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.07.2023	150	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,650	24.08.2023	1.300	(7)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,655	24.07.2023	150	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	12.07.2023	400	(2)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	17.08.2023	2.100	(11)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,735	12.07.2023	150	(1)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2023	50	0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,815	24.07.2023	50	0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,867	26.07.2023	50	0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	18.08.2023	200	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.09.2023	200	(2)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	€ 700	(66)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	400	(37)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	400	(6)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	800	(13)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	500	(8)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	400	(6)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	400	(6)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	300	(7)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	400	(9)	0,00
Erhalt <sup>(2)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	13.500	72	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	6.300	(56)	(0,02)
					\$ (2.561)	(1,00)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (2.559)</b>	<b>(1,00)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110 %	26.07.2032	200	\$ 32	\$ 24	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	300	49	60	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,053	20.07.2023	2.600	16	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,053	20.07.2023	2.600	16	57	0,02
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	2.600	19	4	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	2.600	20	40	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	200	26	17	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	200	26	33	0,01
							\$ 204	\$ 235	0,09

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	400	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	400	(1)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	100	(1)	0	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	100	0	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	100	(1)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	100	0	0	0,00
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	100	(1)	(2)	0,00
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	300	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	300	(2)	(7)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	200	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	200	(2)	(4)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,765	25.07.2023	1.100	(7)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,765	25.07.2023	1.100	(7)	(26)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,468	25.07.2023	200	(5)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,468	25.07.2023	200	(5)	(13)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	200	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	200	(2)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	200	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	200	(2)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	400	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	400	(2)	(5)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	400	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	400	(2)	(6)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	400	(1)	(5)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	500	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	500	(4)	(9)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	200	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	200	(2)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	100	0	0	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	300	(1)	(1)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,052	20.07.2023	1.100	(7)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,052	20.07.2023	1.100	(7)	(24)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,675	20.07.2023	200	(5)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,675	20.07.2023	200	(5)	(11)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,537	20.07.2023	100	(7)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,537	20.07.2023	100	(7)	(12)	(0,01)
							\$ (134)	\$ (183)	(0,07)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

### ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,030 %	24.07.2024	2.600	\$ (19)	\$ (57)	(0,02)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	2.600	(19)	(1)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	2.600	(23)	(42)	(0,02)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	2.600	(23)	(6)	0,00
						\$ (84)	\$ (106)	(0,04)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

<sup>(2)</sup> Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 1.000	\$ (44)	\$ 9	\$ (35)	(0,02)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	CMBX.NA.AAA.14 Index	0,500 %	16.12.2072	\$ 1.600	\$ (39)	\$ 6	\$ (33)	(0,01)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	08.2023	€	184	\$ 202	\$ 1	\$ 1	0,00	
	08.2023	£	566	704	0	(16)	(0,01)	
	08.2023	\$	3.667	AUD 5.425	0	(52)	(0,02)	
	08.2023		911	NZD 1.436	0	(31)	(0,01)	
BPS	09.2023		555	KRW 702.848	0	(19)	(0,01)	
	08.2023	€	215	198	2	2	0,00	
	08.2023	1.685	MXN 29.340	12	0	12	0,00	
	08.2023	28	ZAR 519	0	(1)	(1)	0,00	
BRC	10.2023		189	3.508	0	(5)	0,00	
	08.2023	£	1.897	\$ 2.380	0	(31)	(0,01)	
	08.2023	\$	246	€ 225	0	0	0,00	
	08.2023		1.339	£ 1.052	0	(1)	(1)	0,00
CBK	08.2023	1.377	¥ 182.175	0	(108)	(108)	(0,04)	
	08.2023	34	ZAR 628	0	(1)	(1)	0,00	
	07.2023	934	CLP 756.223	7	0	7	0,00	
	07.2023	617	MXN 11.866	74	0	74	0,03	
GLM	08.2023	€	168	\$ 181	0	(3)	0,00	
	08.2023	£	21	26	0	(1)	0,00	
	08.2023	\$	596	CAD 795	5	0	5	0,00
	08.2023	262	CLP 214.438	3	0	3	0,00	
JPM	08.2023	290	€ 266	1	0	1	0,00	
	08.2023	360	¥ 49.600	0	(14)	(14)	(0,01)	
	08.2023	433	NOK 4.521	0	(11)	(11)	0,00	
	09.2023	KRW 6.890	\$ 5	0	0	0	0,00	
MBC	08.2023	\$	542	NOK 5.747	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	334	ZAR 6.198	0	(7)	(7)	0,00	
	10.2023	537	10.073	0	(9)	(9)	0,00	
	07.2023	221	MXN 3.894	5	0	5	0,00	
MYI	08.2023	£	6.680	\$ 8.461	0	(34)	(34)	(0,01)
	08.2023	\$	977	CAD 1.306	11	0	11	0,00
	08.2023	225	¥ 29.939	0	(17)	(17)	(0,01)	
	08.2023	200	NOK 2.119	0	(2)	(2)	0,00	
MYI	09.2023	IDR 1.304	\$ 0	0	0	0	0,00	
	10.2023	MXN 93	5	0	0	0	0,00	
	08.2023	€	21.061	23.240	216	0	216	0,08
	09.2023	\$	1.022	KRW 1.302.876	0	(29)	(29)	(0,01)
MYI	07.2023	€	243	\$ 264	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR 11.190	1	0	0	0	0,00	
	07.2023	\$	53	€ 49	0	0	0	0,00
	07.2023	1	£ 1	0	0	0	0,00	
MYI	07.2023	1	IDR 11.190	0	0	0	0,00	
	08.2023	€	295	\$ 319	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	\$	2.946	¥ 391.468	0	(221)	(221)	(0,09)



Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
	09.2023	KRW	\$	3.450.069	\$	2.642	\$	12	\$	0	\$	12	0,01
	09.2023	\$	IDR	1	\$	11.200	\$	0	\$	0	\$	0	0,00
	09.2023		KRW	1.144	\$	1.464.222	\$	0	\$	(28)	\$	(28)	(0,01)
SCX	08.2023	NZD	\$	1.947	\$	1.183	\$	0	\$	(9)	\$	(9)	0,00
	08.2023	\$	AUD	475	\$	713	\$	0	\$	0	\$	0	0,00
	08.2023		NZD	318	\$	510	\$	0	\$	(6)	\$	(6)	0,00
	09.2023	IDR	\$	1.290.990	\$	87	\$	1	\$	0	\$	1	0,00
SSB	07.2023	CLP	\$	757.307	\$	943	\$	0	\$	0	\$	0	0,00
	08.2023	\$	CLP	943	\$	759.494	\$	0	\$	0	\$	0	0,00
UAG	08.2023	£	\$	5.851	\$	7.396	\$	0	\$	(45)	\$	(45)	(0,02)
								\$	\$	(358)	\$	(358)	(0,14)
								\$	\$	(708)	\$	(708)	(0,14)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und R Class AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
AZD	07.2023	AUD	\$	5.523	\$	3.665	\$	0	\$	(11)	\$	(11)	(0,01)
	07.2023	\$	AUD	7.045	\$	10.764	\$	121	\$	0	\$	121	0,05
	08.2023			3.668		5.523		11		0		11	0,00
BOA	07.2023			21.626		33.284		529		0		529	0,21
BPS	07.2023	AUD	\$	30.669	\$	20.313	\$	4	\$	(106)	\$	(102)	(0,04)
	07.2023	\$	AUD	902	\$	1.390	\$	24	\$	0	\$	24	0,01
	08.2023			18.996		28.656		94		0		94	0,04
CBK	07.2023			4.489		6.880		91		0		91	0,04
JPM	07.2023			6.834		10.453		124		0		124	0,05
SCX	07.2023	AUD	\$	9.743	\$	6.468	\$	0	\$	(18)	\$	(18)	(0,01)
	07.2023	\$	AUD	5.471	\$	8.373	\$	102	\$	0	\$	102	0,04
	08.2023			6.473		9.743		18		0		18	0,01
SOG	07.2023			10.804		16.514		188		0		188	0,07
UAG	07.2023	AUD	\$	32.947	\$	21.876	\$	42	\$	(97)	\$	(55)	(0,02)
	07.2023	\$	AUD	8.383	\$	12.805	\$	141	\$	0	\$	141	0,05
	08.2023			21.893		32.947		97		(42)		55	0,02
								\$	\$	(274)	\$	(274)	0,51
								\$	\$	(274)	\$	(274)	0,51

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
BPS	07.2023	CHF	\$	759	\$	849	\$	0	\$	0	\$	0	0,00
	07.2023	\$	CHF	1.141	\$	1.033	\$	13	\$	0	\$	13	0,01
	08.2023			849		757		0		0		0	0,00
MYI	07.2023	CHF	\$	37	\$	40	\$	0	\$	(1)	\$	(1)	0,00
SCX	07.2023	\$	CHF	815	\$	733	\$	4	\$	0	\$	4	0,00
UAG	07.2023	CHF	\$	783	\$	873	\$	0	\$	(2)	\$	(2)	0,00
	07.2023	\$	CHF	735	\$	660	\$	3	\$	0	\$	3	0,00
	08.2023			873		781		2		0		2	0,00
								\$	\$	(3)	\$	(3)	0,01
								\$	\$	(3)	\$	(3)	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
BOA	07.2023	€	\$	3.145	\$	3.437	\$	6	\$	0	\$	6	0,00
	07.2023	\$	€	35.959	\$	33.459	\$	544	\$	0	\$	544	0,21
BPS	07.2023	€	\$	32.814	\$	35.952	\$	153	\$	0	\$	153	0,06
	07.2023	\$	€	36.016	\$	33.502	\$	534	\$	0	\$	534	0,21
	08.2023			35.440		32.300		0		(152)		(152)	(0,06)
CBK	07.2023	€	\$	33.469	\$	36.376	\$	0	\$	(138)	\$	(138)	(0,05)
	08.2023	\$	€	35.306	\$	32.428	\$	122	\$	0	\$	122	0,05
MBC	07.2023	€	\$	477	\$	512	\$	0	\$	(9)	\$	(9)	0,00
	07.2023	\$	€	163	\$	151	\$	2	\$	0	\$	2	0,00
SCX	07.2023			1.479		1.382		29		0		29	0,01
SOG	07.2023			35.969		33.437		510		0		510	0,20
								\$	\$	(299)	\$	(299)	0,63
								\$	\$	(299)	\$	(299)	0,63

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	\$ 167	£ 135	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,01
BRC	07.2023	23	19	1	0	1	0,00
CBK	07.2023	7	5	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	167	135	4	0	4	0,00
MYI	07.2023	166	134	4	0	4	0,00
RYL	07.2023	£ 27	\$ 34	0	0	0	0,00
				\$ 13	\$ 0	\$ 13	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 2.838	NOK 31.475	\$ 100	\$ (1)	\$ 99	0,04
CBK	07.2023	NOK 194	\$ 18	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 1.505	NOK 16.919	75	0	75	0,03
GLM	07.2023	NOK 24.766	\$ 2.298	0	(14)	(14)	(0,01)
	07.2023	\$ 663	NOK 7.114	1	0	1	0,00
	08.2023	2.298	24.742	14	0	14	0,01
RYL	07.2023	2.689	28.856	20	(16)	4	0,00
SCX	07.2023	544	5.938	10	0	10	0,00
				\$ 220	\$ (32)	\$ 188	0,07

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK 82.108	\$ 7.607	\$ 7	\$ (1)	\$ 6	0,00
	07.2023	\$ 114	SEK 1.226	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	7.321	78.907	0	(6)	(6)	0,00
CBK	07.2023	5.146	56.206	58	0	58	0,02
GLM	07.2023	SEK 47	\$ 4	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 7	SEK 78	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	SEK 30	\$ 3	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 4.948	SEK 53.287	0	(15)	(15)	(0,01)
MYI	07.2023	SEK 79.039	\$ 7.321	3	0	3	0,00
	07.2023	\$ 7.091	SEK 76.120	0	(44)	(44)	(0,01)
	08.2023	7.321	78.941	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2023	SEK 13	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 4.943	SEK 53.471	7	0	7	0,00
				\$ 75	\$ (70)	\$ 5	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$ 93	SGD 126	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	07.2023	SGD 5	\$ 4	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	\$ 85	SGD 115	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD 120	\$ 89	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 89	SGD 120	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	14	19	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	92	124	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

Summe Freiverkehrsfinauzderivate

\$ 2.658 1,04

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2053	\$ 500	\$ (441)	(0,17)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (441)	(0,17)
Summe Anlagen		\$ 348.282	136,75
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (93.590)	(36,75)
Nettovermögen		\$ 254.692	100,00



**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.  
 (b) Nullkuponwertpapier.  
 (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
 (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
 (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
 (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,38 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
Citigroup, Inc.	5,746 %	25.01.2026	19.07.2022	\$ 488	\$ 498	0,20
Deutsche Bank AG	3,035	28.05.2032	25.08.2021 - 02.09.2021	359	276	0,11
Standard Chartered PLC	3,603	12.01.2033	05.01.2022	200	160	0,06
				<b>\$ 1.047</b>	<b>\$ 934</b>	<b>0,37</b>

(h) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 81 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von 183 USD (31. Dezember 2022: 810 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.324 USD (31. Dezember 2022: 1.927 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 316.722	\$ 0	\$ 316.722
Pensionsgeschäfte	0	31.800	0	31.800
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(3)	204	0	201
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(441)	0	(441)
<b>Summen</b>	<b>\$ (3)</b>	<b>\$ 348.285</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 348.282</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 254.108	\$ 0	\$ 254.108
Pensionsgeschäfte	0	44.400	0	44.400
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(9)	1.287	0	1.278
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(2.630)	0	(2.630)
<b>Summen</b>	<b>\$ (9)</b>	<b>\$ 297.165</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 297.156</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 121	\$ (300)	\$ (179)	\$ 4	\$ 0	\$ 4
BOA	1.050	(810)	240	43	0	43
BPS	576	(710)	(134)	(571)	550	(21)
BRC	(141)	134	(7)	59	0	59
CBK	266	(280)	(14)	1.021	(950)	71
DUB	(11)	0	(11)	(9)	0	(9)
GLM	(41)	0	(41)	3	260	263
JPM	86	(280)	(194)	187	0	187
MBC	169	(300)	(131)	660	(350)	310
MYC	(75)	0	(75)	(69)	0	(69)
MYI	(281)	130	(151)	263	(20)	243
RYL	4	0	4	88	0	88
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(6)	0	(6)
SCX	138	(290)	(152)	799	(780)	19
SOG	698	(700)	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	99	(270)	(171)	164	0	164

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	73,15	36,58
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	51,20	69,50
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,71
Pensionsgeschäfte	12,49	18,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,00)	(0,62)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,04	1,11
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,17)	(1,11)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,29	0,52
Unternehmensanleihen und Wechsel	37,49	34,38
US-Regierungsbehörden	41,61	29,05
US-Schatzobligationen	7,90	5,52
Non-Agency-MBS	13,76	12,90
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,69	6,03
Staatsemissionen	1,11	1,19
Kurzfristige Instrumente	15,50	17,20
Pensionsgeschäfte	12,49	18,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,11	0,05
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,07)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen —		
Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Zinsswaps	(1,00)	(0,61)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,09	0,08
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,07)	(0,10)
Zinsscaps	(0,04)	(0,04)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen —		
Schutzverkauf	(0,02)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,01)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,14)	(0,10)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,23	1,30
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,17)	(1,11)
Sonstige Aktiva und Passiva	(36,75)	(24,88)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS								
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>																			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>																			
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % fällig am 22.06.2026	\$ 214	€ 197	0,01	HSBC Holdings PLC 6,500 % fällig am 20.05.2024	£ 1.800	€ 2.097	0,12	Toronto-Dominion Bank 1,707 % fällig am 28.07.2025 3,879 % fällig am 13.03.2026	€ 5.100	€ 5.700	0,28 0,32								
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>																			
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>																			
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	€ 3.493	3.491	0,20	ING Groep NV 3,875 % fällig am 16.05.2027 (e)(g)	\$ 200	131	0,01	UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.04.2025 3,250 % fällig am 02.04.2026 4,194 % fällig am 01.04.2031	1.600 6.000 \$ 2.500	1.549 5.785 2.041	0,09 0,33 0,12								
Banco BPM SpA 3,750 % fällig am 27.06.2028	5.700	5.679	0,32	Intesa Sanpaolo SpA 5,500 % fällig am 01.03.2028 (e)(g)	€ 250	210	0,01	UniCredit SpA 1,625 % fällig am 03.07.2025 3,127 % fällig am 03.06.2032 3,375 % fällig am 31.01.2027 7,830 % fällig am 04.12.2023	€ 7.700 € 4.400 € 6.000 \$ 3.400	7.478 3.184 5.921 3.135	0,43 0,18 0,34 0,18								
Banco Santander S.A. 4,375 % fällig am 14.01.2026 (e)(g)	4.000	3.362	0,19	Jyske Realkredit A/S 0,375 % fällig am 01.07.2024 1,000 % fällig am 01.10.2050 1,500 % fällig am 01.10.2037 1,500 % fällig am 01.07.2050 1,500 % fällig am 01.10.2050 2,000 % fällig am 01.10.2047 2,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 15 0 0 22 0 0	772 1 0 2 0 0	0,04 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00	Vonovia Finance BV 5,000 % fällig am 02.10.2023	500	456	0,03								
Bank of America Corp. 4,412 % fällig am 24.08.2025	2.950	2.962	0,17	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028 (b) 0,000 % fällig am 15.09.2031 (b) 2,000 % fällig am 15.11.2029 2,875 % fällig am 29.05.2026 5,000 % fällig am 19.03.2024	€ 6.500 15.500 17.100 5.200 AUD 200	5.558 12.222 16.129 5.135 122	0,32 0,70 0,92 0,29 0,01	Summe		325.890	18,60								
Barclays PLC 3,125 % fällig am 17.01.2024 4,375 % fällig am 15.03.2028 (e)(g)	£ 7.700	8.810	0,50	Landesbank Baden-Wuerttemberg 2,000 % fällig am 24.02.2025	\$ 3.300	2.853	0,16	<b>INDUSTRIEWERTE</b>											
6,125 % fällig am 15.12.2025 (e)(g)	\$ 200	125	0,01	LeasePlan Corp. NV 1,375 % fällig am 07.03.2024	€ 6.100	5.979	0,34	BMW Finance NV 3,609 % fällig am 09.12.2024	€ 10.400	10.410	0,59								
7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(g)	1.500	1.351	0,08	Liberty Mutual Group, Inc. 3,625 % fällig am 23.05.2059	9.700	9.238	0,53	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	6.000	5.844	0,33								
BNP Paribas S.A. 4,500 % fällig am 25.02.2030 (e)(g)	200	130	0,01	Lloyds Bank PLC 4,875 % fällig am 30.03.2027	£ 4.000	4.502	0,26	GN Store Nord A/S 0,875 % fällig am 25.11.2024	3.300	3.079	0,18								
BPER Banca 0,625 % fällig am 28.10.2029	€ 6.600	5.637	0,32	Lloyds Banking Group PLC 7,500 % fällig am 27.09.2025 (e)(g)	\$ 1.700	1.461	0,08	Informa PLC 1,500 % fällig am 05.07.2023	1.476	1.476	0,09								
CaixaBank S.A. 3,625 % fällig am 14.09.2028 (e)(g)	200	137	0,01	MUFG Bank Ltd. 3,750 % fällig am 10.03.2024	1.700	1.537	0,09	Market Bideo Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	4.600	3.715	0,21								
6,750 % fällig am 13.06.2024 (e)(g)	2.000	1.941	0,11	National Bank of Canada 3,500 % fällig am 25.04.2028	€ 1.800	1.791	0,10	Molnycke Holding AB 1,750 % fällig am 28.02.2024 1,875 % fällig am 28.02.2025	400 400	393 384	0,02 0,02								
Cooperatieve Rabobank UA 3,250 % fällig am 29.12.2026 (e)(g)	1.400	1.165	0,07	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050 1,000 % fällig am 01.10.2053 1,500 % fällig am 01.10.2050 2,000 % fällig am 01.10.2047 2,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 10.642 867 0 0 8.275	967 77 0 0 876	0,05 0,00 0,00 0,00 0,05	Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	10.150	8.679	0,50								
4,625 % fällig am 29.12.2025 (e)(g)	3.800	3.461	0,20	Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 5.200	5.030	0,29	Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	4.400	4.381	0,25								
CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	6.500	3.544	0,20	Nova Ljubljanska Banka d.d. 10,750 % fällig am 28.11.2032	5.700	6.101	0,35	Teleperformance 1,875 % fällig am 02.07.2025	200	190	0,01								
Credit Mutuel Home Loan SFH S.A. 3,125 % fällig am 22.06.2027 3,250 % fällig am 20.04.2029	3.100 3.800	3.055 3.762	0,17 0,21	Nykredit Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2043 1,000 % fällig am 01.10.2050 1,000 % fällig am 01.10.2053 1,500 % fällig am 01.10.2037 1,500 % fällig am 01.10.2047 1,500 % fällig am 01.10.2050 1,500 % fällig am 01.10.2053 2,000 % fällig am 01.10.2047 2,000 % fällig am 01.10.2050 2,000 % fällig am 01.10.2053 2,500 % fällig am 01.10.2036 2,500 % fällig am 01.10.2047 3,000 % fällig am 01.10.2053 3,500 % fällig am 01.10.2053 5,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 10.642 867 11 24 0 4 0 37.491 0 57.314 5.646 350 27 4.603 24.933 23.987	967 77 0 0 0 0 3.614 0 6.067 591 44 3 543 3.059 3.173	0,05 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,21 0,00 0,35 0,03 0,00 0,00 0,03 0,17 0,18	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel	12.800	10.948	0,62	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>							
Credit Suisse AG 4,713 % fällig am 31.05.2024 6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	6.800 \$ 2.600	6.780 2.374	0,39 0,13	Realkredit Danmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2047 1,500 % fällig am 01.10.2053 2,000 % fällig am 01.10.2047 2,000 % fällig am 01.10.2050 2,500 % fällig am 01.04.2036 Royal Bank of Canada 3,607 % fällig am 17.01.2025 4,784 % fällig am 12.12.2025	€ 9.500	9.500	0,02	Fannie Mae 5,036 % fällig am 25.07.2037 5,550 % fällig am 25.06.2036	\$ 5 30	4 27	0,00 0,00	<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>							
Credit Suisse AG AT1 Claim ^ Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025	€ 9.500 € 7.700	349 7.540	0,02 0,43	Societe Generale S.A. 1,250 % fällig am 15.02.2024	€ 7.300	7.179	0,41	Freddie Mac 0,000 % fällig am 15.01.2038 (a) 3,500 % fällig am 01.10.2047 4,348 % fällig am 15.01.2038 4,442 % fällig am 01.09.2037			4 0,00 0,13 0,02 0,05	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)</b>							
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	3.200	2.853	0,16	Societe Generale SFH S.A. 3,125 % fällig am 24.02.2026	2.100	2.071	0,12	4,000 % fällig am 01.10.2029 - 01.08.2041	569	515	0,03	0,125 % fällig am 15.07.2024 0,125 % fällig am 15.02.2051 0,500 % fällig am 15.04.2024 0,500 % fällig am 15.01.2028 0,625 % fällig am 15.01.2024 1,000 % fällig am 15.02.2048 1,625 % fällig am 15.10.2027	7.409 6.524 7.336 9.468 7.280 3.936 30.615	6.588 3.995 6.562 8.120 6.560 3.107 27.657	0,38 0,23 0,37 0,46 0,37 0,18 1,58	<b>Summe</b>			
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 03.09.2026 2,222 % fällig am 18.09.2024	7.400 \$ 1.900	6.803 1.720	0,39 0,10																
Dexia Credit Local S.A. 0,000 % fällig am 21.01.2028 (b) 0,010 % fällig am 22.01.2027	€ 4.300 6.700	3.695 5.928	0,21 0,34																
DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	6.500	4.937	0,28																
Eurofima Europäische Gesellschaft für die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0,010 % fällig am 23.06.2028	10.500	8.897	0,51																
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2029 (b) 0,450 % fällig am 04.07.2041 0,450 % fällig am 02.05.2046 0,750 % fällig am 04.01.2047 1,625 % fällig am 04.12.2029 2,625 % fällig am 04.02.2048	1.000 8.600 930 1.600 3.000 4.700	835 5.361 527 973 2.751 4.248	0,05 0,31 0,03 0,05 0,16 0,24																
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 2,875 % fällig am 28.11.2024 3,400 % fällig am 18.04.2028	3.400 3.400	3.346 3.342	0,19 0,19																
Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % fällig am 19.07.2024 2,748 % fällig am 14.06.2024	€ 3.500 € 6.500	3.388 7.249	0,19 0,41																
General Motors Financial Co., Inc. 1,000 % fällig am 24.02.2025	€ 3.400	3.218	0,18																
Goldman Sachs Group, Inc. 4,281 % fällig am 07.02.2025 6,481 % fällig am 15.03.2024	7.300 \$ 1.700	7.331 1.565	0,42 0,09																
Hamburg Commercial Bank AG 4,875 % fällig am 17.03.2025	€ 3.050	3.040	0,17																

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>NON-AGENCY-MBS</b>											
Adjustable Rate Mortgage Trust				GSR Mortgage Loan Trust	\$ 4	€ 3	0,00	Tower Bridge Funding PLC	€ 4.968	€ 5.758	0,33
3,285 % fällig am 25.01.2036 ^	5	4	0,00	3,935 % fällig am 25.01.2036 ^				5,527 % fällig am 20.11.2063			
Alba PLC	€ 244	277	0,02	HarborView Mortgage Loan Trust	3	2	0,00	Trinity Square PLC	6.436	7.489	0,43
5,075 % fällig am 25.11.2042				4,424 % fällig am 19.05.2033				5,316 % fällig am 15.07.2059			
5,171 % fällig am 15.12.2038	3.112	3.471	0,20	Harbour	€ 4.399	5.106	0,29	Tudor Rose Mortgages	2.614	3.029	0,17
American Home Mortgage Investment Trust				5,358 % fällig am 28.01.2054				5,509 % fällig am 20.06.2048			
6,500 % fällig am 25.03.2047	\$ 406	277	0,02	Hops Hill PLC	5.200	6.036	0,34	Twin Bridges PLC	3.340	3.848	0,22
Atlas Funding PLC	€ 1.683	1.963	0,11	0,000 % fällig am 21.12.2055	3.198	3.751	0,21	5,525 % fällig am 12.09.2055	3.810	4.424	0,25
5,937 % fällig am 20.01.2061				6,204 % fällig am 27.11.2054				5,715 % fällig am 12.03.2055	5.572	6.506	0,37
Avon Finance PLC	4.132	4.814	0,27	IndyMac Mortgage Loan Trust	\$ 75	60	0,00	6,115 % fällig am 12.12.2054			
5,809 % fällig am 20.09.2048				3,510 % fällig am 25.11.2035 ^	558	443	0,03	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	\$ 666	541	0,03
Banc of America Funding Trust	\$ 60	49	0,00	5,530 % fällig am 25.09.2046				3,974 % fällig am 25.05.2037 ^	2.558	2.058	0,12
5,757 % fällig am 20.05.2047				Jubilee Place BV	€ 1.773	1.773	0,10	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
Barley Hill PLC	€ 1.421	1.646	0,09	4,177 % fällig am 17.10.2057				4,726 % fällig am 25.02.2047 ^			
5,824 % fällig am 27.08.2058				Kentmere PLC	€ 1.179	1.370	0,08	Wells Fargo Alternative Loan Trust	24	19	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust	\$ 226	146	0,01	5,357 % fällig am 28.01.2042				5,134 % fällig am 25.07.2037 ^			
3,993 % fällig am 25.07.2036	3	3	0,00	Lanebrook Mortgage Transaction PLC	2.420	2.824	0,16			243.911	13,91
4,635 % fällig am 25.07.2033	24	21	0,00	5,965 % fällig am 12.06.2057				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
5,230 % fällig am 25.10.2035				Mansard Mortgages PLC	877	1.001	0,06	Accunia European CLO DAC	€ 5.180	5.115	0,29
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust	\$ 63	44	0,00	5,651 % fällig am 15.12.2049				4,127 % fällig am 15.07.2030			
3,484 % fällig am 26.12.2046 ^				MASTR Asset Securitization Trust	\$ 95	58	0,00	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust	\$ 532	181	0,01
Canada Square Funding PLC	€ 4.582	5.309	0,30	6,000 % fällig am 25.06.2036 ^				5,450 % fällig am 25.07.2036			
5,316 % fällig am 17.01.2059				Miravet SARL	€ 4.917	4.841	0,28	Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates	228	208	0,01
Charter Mortgage Funding PLC	1.559	1.815	0,10	4,265 % fällig am 26.05.2065				5,855 % fällig am 25.01.2036			
5,327 % fällig am 16.01.2057				Newgate Funding PLC	€ 230	257	0,01	Aqueduct European CLO DAC	€ 4.378	4.321	0,25
Chase Mortgage Finance Trust	\$ 2.054	1.657	0,09	6,005 % fällig am 15.12.2050				3,840 % fällig am 20.07.2030			
3,948 % fällig am 25.01.2036	90	40	0,00	Oak No. 4 PLC	3.850	4.493	0,26	Ares European CLO DAC	3.197	3.135	0,18
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^				0,000 % fällig am 26.02.2065				3,837 % fällig am 15.10.2030	4.670	4.583	0,26
Citigroup Mortgage Loan Trust	1	1	0,00	Paragon Mortgages PLC	610	711	0,04	4,325 % fällig am 21.10.2033	4.000	3.934	0,22
4,321 % fällig am 25.03.2034	14	12	0,00	5,752 % fällig am 15.05.2045				Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-One BV	2.400	2.409	0,14
6,470 % fällig am 25.11.2035				Pierpont BTL PLC	4.800	5.580	0,32	4,072 % fällig am 21.09.2031			
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.	237	202	0,01	0,000 % fällig am 21.09.2054				Asset-Backed Funding Certificates Trust	\$ 72	51	0,00
5,014 % fällig am 25.08.2035 ^				Polaris PLC	2.870	3.330	0,19	6,150 % fällig am 25.06.2037			
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates	475	378	0,02	5,631 % fällig am 23.12.2058	5.697	6.593	0,38	Aurium CLO DAC	€ 6.047	5.939	0,34
3,626 % fällig am 25.09.2035 ^				5,640 % fällig am 23.10.2059	3.675	4.286	0,24	3,847 % fällig am 16.04.2030	€ 4.593	4.505	0,26
Countrywide Alternative Loan Trust	35	28	0,00	6,154 % fällig am 27.05.2057				3,907 % fällig am 16.01.2031	5.881	5.899	0,34
3,994 % fällig am 25.06.2037 ^	267	227	0,01	Precise Mortgage Funding PLC	4.023	4.703	0,27	Auto ABS French Leases FCT	5.881	5.899	0,34
4,048 % fällig am 20.11.2035	3	3	0,00	6,065 % fällig am 12.12.2055				4,111 % fällig am 25.06.2033			
4,976 % fällig am 25.12.2035	4	3	0,00	Primrose Residential DAC	€ 8.969	8.907	0,51	Autonorica FCT	3.200	3.204	0,18
5,250 % fällig am 25.06.2035 ^	1.411	794	0,05	4,439 % fällig am 24.10.2061	5.358	5.308	0,30	3,883 % fällig am 26.01.2043	4.772	4.667	0,27
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	118	96	0,01	Residential Accredited Loans, Inc. Trust	\$ 322	72	0,00	Bain Capital Euro CLO DAC			
5,570 % fällig am 25.07.2046	190	80	0,00	4,165 % fällig am 25.06.2046	1.016	839	0,05	3,940 % fällig am 20.01.2032			
6,000 % fällig am 25.03.2036 ^	292	140	0,01	5,470 % fällig am 25.03.2047	1.215	467	0,03	Bavarian Sky S.A.	301	302	0,02
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^				6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	329	235	0,01	4,055 % fällig am 20.05.2027			
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust	87	63	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2037 ^				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust	\$ 591	526	0,03
3,514 % fällig am 25.04.2035	46	39	0,00	Residential Asset Securitization Trust	1.289	911	0,05	6,950 % fällig am 25.07.2035			
3,573 % fällig am 20.05.2036 ^	107	91	0,01	5,750 % fällig am 25.02.2036				BlueMountain Fuji EUR CLO DAC	€ 99	92	0,01
5,730 % fällig am 25.04.2035	146	111	0,01	Residential Mortgage Securities PLC	€ 4.157	4.860	0,28	1,050 % fällig am 15.01.2031			
5,790 % fällig am 25.03.2035	145	115	0,01	6,159 % fällig am 20.06.2070				3,827 % fällig am 15.07.2030	2.221	2.182	0,12
5,890 % fällig am 25.02.2035				Resloc UK PLC	€ 751	717	0,04	3,897 % fällig am 15.01.2031	4.573	4.481	0,25
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust	3.092	2.321	0,13	3,686 % fällig am 15.12.2043				4,087 % fällig am 15.01.2033	2.000	1.950	0,11
5,530 % fällig am 25.08.2047				Ripon Mortgages PLC	€ 6.578	7.639	0,44	BNPP AM Euro CLO DAC	1.035	1.011	0,06
Diosk RMBS DAC	€ 3.300	3.299	0,19	5,491 % fällig am 28.08.2056				Bridgepoint CLO DAC	€ 1.814	2.114	0,12
4,133 % fällig am 20.02.2060	4.791	4.779	0,27	RMAC Securities PLC	58	65	0,00	4,387 % fällig am 15.01.2034			
4,272 % fällig am 20.12.2060				5,134 % fällig am 12.06.2044	1.029	1.148	0,07	Bumper UK Finance PLC	€ 1.814	2.114	0,12
Dutch Property Finance BV	1.186	1.186	0,07	5,154 % fällig am 12.06.2044				Cairn CLO DAC	€ 4.687	4.615	0,26
3,872 % fällig am 28.04.2051	2.394	2.391	0,14	Shamrock Residential DAC	€ 1.728	1.711	0,10	3,971 % fällig am 25.04.2032	1.399	1.371	0,08
3,892 % fällig am 28.07.2058	3.695	3.677	0,21	4,289 % fällig am 24.12.2059				4,051 % fällig am 25.07.2029	1.014	1.013	0,06
3,942 % fällig am 28.04.2059	4.239	4.223	0,24	Stanlington PLC	€ 3.593	4.170	0,24	4,212 % fällig am 20.10.2028	24	24	0,00
3,992 % fällig am 28.10.2059	2.442	2.404	0,14	5,815 % fällig am 12.06.2045				Carlyle Euro CLO DAC	6.746	6.595	0,38
4,492 % fällig am 28.04.2050				Stratton Mortgage Funding PLC	13.928	16.232	0,93	3,953 % fällig am 15.08.2030			
EMF-UK PLC	€ 4.186	4.832	0,28	5,391 % fällig am 20.07.2060	5.279	6.130	0,35	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC	4.993	4.888	0,28
5,970 % fällig am 13.03.2046				5,765 % fällig am 12.03.2052	3.283	3.817	0,22	3,991 % fällig am 25.01.2032			
European Loan Conduit DAC	€ 5.065	4.959	0,28	5,792 % fällig am 25.09.2051				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.	4.600	4.513	0,26
4,358 % fällig am 17.02.2030				Structured Asset Mortgage Investments Trust	\$ 182	145	0,01	4,073 % fällig am 15.11.2031			
Euroail PLC	655	647	0,04	3,907 % fällig am 25.02.2036 ^	48	42	0,00	Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC	1.967	1.971	0,11
3,619 % fällig am 13.03.2045	31	18	0,00	5,530 % fällig am 25.06.2036	3	3	0,00				
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust	\$ 31	18	0,00	5,646 % fällig am 19.07.2035	57	47	0,00				
4,386 % fällig am 25.03.2035				5,846 % fällig am 19.12.2034	66	56	0,00				
Glenbeigh Issuer DAC	€ 1.152	1.148	0,07	5,846 % fällig am 19.02.2035							
4,350 % fällig am 24.03.2046	2.788	2.774	0,16	Towd Point Mortgage Funding PLC	€ 500	577	0,03				
4,350 % fällig am 24.06.2050				5,161 % fällig am 20.10.2051	6.852	7.996	0,46				
Great Hall Mortgages PLC	€ 140	138	0,01	5,635 % fällig am 20.10.2051	6.552	7.615	0,43				
3,677 % fällig am 18.03.2039	34	40	0,00	5,841 % fällig am 20.07.2045	7.112	8.264	0,47				
5,172 % fällig am 18.06.2038	\$ 38	35	0,00	6,097 % fällig am 20.05.2045	1.905	2.221	0,13				
5,644 % fällig am 18.06.2039				6,546 % fällig am 20.02.2054							

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Compartment VCL				Silver Arrow S.A.				3,150 % fällig am 30.04.2033	1.2		
4,072 % fällig am 21.01.2028	€ 1.883	€ 1.888	0,11	3,768 % fällig am 15.02.2030	€ 2.389	€ 2.391	0,14	€ 54	€ 1.230	0,07	
Cotego CLO BV				4,028 % fällig am 15.02.2027	224	224	0,01	3,450 % fällig am 30.07.2043	9.100	8.650	0,49
3,947 % fällig am 15.10.2030	3.745	3.687	0,21	SLC Student Loan Trust				3,450 % fällig am 30.07.2066	9.400	8.572	0,49
Cotego CLO DAC				6,271 % fällig am 25.11.2042	\$ 560	509	0,03	3,550 % fällig am 31.10.2033	870	878	0,05
3,851 % fällig am 23.01.2030	4.588	4.497	0,26	SLM Student Loan Trust				3,900 % fällig am 30.07.2039	1.600	1.636	0,09
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				3,661 % fällig am 25.10.2039	€ 426	398	0,02	Svensk Exportkredit AB			
4,473 % fällig am 25.07.2036	\$ 58	48	0,00	Soundview Home Loan Trust				3,250 % fällig am 13.04.2026	5.300	5.245	0,30
5,290 % fällig am 25.06.2035	4.136	3.303	0,19	5,650 % fällig am 25.10.2036	\$ 4.886	4.181	0,24				
5,370 % fällig am 25.06.2047	3.080	2.682	0,15	Tikehau CLO DAC							
5,410 % fällig am 25.11.2037	1.934	1.587	0,09	4,144 % fällig am 04.08.2034	€ 4.000	3.909	0,22				
5,990 % fällig am 25.10.2047	1.112	969	0,05	Toro European CLO DAC							
CVC Cordatus Loan Fund DAC				3,995 % fällig am 12.01.2032	3.900	3.825	0,22				
3,827 % fällig am 15.10.2031	€ 3.400	3.336	0,19	Turbo Finance PLC							
4,103 % fällig am 15.08.2032	3.282	3.221	0,18	5,617 % fällig am 20.08.2028	£ 844	984	0,06				
Ellington Loan Acquisition Trust				Voya Euro CLO DAC							
6,200 % fällig am 25.05.2037	\$ 2.678	2.308	0,13	3,927 % fällig am 15.10.2030	€ 3.067	3.028	0,17				
FCT Pulse France											
4,163 % fällig am 25.01.2035	€ 2.900	2.910	0,17								
First Franklin Mortgage Loan Trust											
5,310 % fällig am 25.11.2036	\$ 131	118	0,01								
Ginkgo Sales Finance											
4,113 % fällig am 25.11.2049	€ 4.842	4.844	0,28								
Harvest CLO DAC											
3,817 % fällig am 15.10.2031	5.600	5.467	0,31								
3,880 % fällig am 20.10.2031	4.300	4.213	0,24								
3,907 % fällig am 15.10.2030	5.676	5.592	0,32								
3,937 % fällig am 15.07.2031	5.400	5.270	0,30								
4,027 % fällig am 15.01.2032	8.300	8.122	0,46								
Invesco Euro CLO DAC											
3,827 % fällig am 15.07.2031	1.550	1.513	0,09								
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust											
5,420 % fällig am 25.07.2036	\$ 75	58	0,00								
Jubilee CLO DAC											
4,326 % fällig am 15.12.2029	€ 2.777	2.746	0,16								
Laurelin DAC											
3,920 % fällig am 20.10.2031	6.000	5.892	0,34								
Lehman XS Trust											
6,500 % fällig am 25.06.2046	\$ 2.333	1.805	0,10								
Long Beach Mortgage Loan Trust											
5,450 % fällig am 25.05.2036	2.054	1.095	0,06								
5,450 % fällig am 25.06.2036	4.742	2.087	0,12								
Man GLG Euro CLO DAC											
3,857 % fällig am 15.10.2030	€ 2.271	2.230	0,13								
3,987 % fällig am 15.10.2032	4.295	4.184	0,24								
4,047 % fällig am 15.01.2030	5.012	4.951	0,28								
MASTR Asset-Backed Securities Trust											
5,300 % fällig am 25.10.2036	\$ 3.016	907	0,05								
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust											
5,400 % fällig am 25.07.2036	346	273	0,01								
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust											
5,290 % fällig am 25.12.2036	2.758	1.228	0,07								
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust											
5,300 % fällig am 25.07.2036	516	427	0,02								
5,765 % fällig am 25.02.2036	1	1	0,00								
NovaStar Mortgage Funding Trust											
5,350 % fällig am 25.09.2037	465	413	0,02								
5,855 % fällig am 25.01.2036	102	92	0,01								
OCP Euro CLO DAC											
3,997 % fällig am 15.01.2032	€ 4.096	4.043	0,23								
4,091 % fällig am 22.09.2034	5.600	5.454	0,31								
Palmer Square European Loan Funding DAC											
3,897 % fällig am 15.10.2031	7.036	6.896	0,39								
PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment											
4,139 % fällig am 26.11.2030	2.412	2.417	0,14								
Red & Black Auto Lease France											
4,093 % fällig am 27.06.2035	5.400	5.401	0,31								
Revocar UG											
4,032 % fällig am 21.04.2036	4.012	4.024	0,23								
SCF Rahoituspalvelut DAC											
4,020 % fällig am 25.06.2033	5.300	5.304	0,30								
Sculptor European CLO DAC											
3,916 % fällig am 14.01.2032	4.600	4.519	0,26								
Silver Arrow Athlon NL BV											
4,139 % fällig am 26.04.2031	2.895	2.900	0,16								
Silver Arrow Merfina SRL											
4,055 % fällig am 20.07.2033	2.956	2.962	0,17								



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Bond Fund (Forts.)

### PENSIONS GESCHÄFTE

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
COM	3,250 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 101.800	State of North Rhine-Westphalia 2,350 % fällig am 13.12.2029 State of Saarland 0,010 % fällig am 11.05.2027	€ (100.000) (8.561)	€ 101.800	€ 101.828	5,80
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	\$ 2.666	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(2.493)	2.444	2.444	0,14
Summe Pensionsgeschäfte						€ (111.054)	€ 104.244	€ 104.272	5,94

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	2.917	€ (4.344)	(0,25)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	791	612	0,04
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	2.615	2.697	0,15
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	546	984	0,06
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1.485	(145)	(0,01)
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	1.472	(975)	(0,06)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	24	(78)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	444	374	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	1.727	2.784	0,16
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.115	(2.036)	(0,12)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	764	718	0,04
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	117	29	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	433	(775)	(0,04)
				€ (155)	(0,01)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 113,000	21.07.2023	320	€ (210)	€ (327)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					€ (482)	(0,03)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000 %	16.06.2029	¥ 7.571.000	€ (557)	(0,03)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	2.729.000	(123)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	\$ 11.900	(3.063)	(0,17)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	29.200	577	0,03
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	65.700	(1.075)	(0,06)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	127.600	703	0,04
Zahlung	3-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 124.100	(2.894)	(0,17)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.07.2023	\$ 11.900	(43)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 5.200	(212)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,700	15.03.2073	4.900	561	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	46.800	(1.127)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042	21.400	(783)	(0,05)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	80.600	(887)	(0,05)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	196.600	292	0,02
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	462.100	3.190	0,18
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	104.900	(73)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	28.500	(5.877)	(0,34)
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	2.800	98	0,01
Zahlung	CPTFEMU	2,421	15.05.2052	990	(149)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	2.300	102	0,01

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung		CPTFEMU	2,488 %	15.05.2037	€ 6.880	€ (481)	(0,03)
Erhalt		CPTFEMU	2,600	15.05.2032	4.500	193	0,01
Erhalt		CPTFEMU	2,720	15.06.2032	6.600	156	0,01
Erhalt		CPTFEMU	2,975	15.08.2027	6.700	58	0,00
Erhalt		CPTFEMU	3,340	15.08.2027	25.900	(144)	(0,01)
Erhalt		CPURNSA	3,479	18.07.2023	\$ 26.800	189	0,01
						€ (11.369)	(0,65)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						€ (11.369)	(0,65)

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variable Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420 %	21.09.2023	123.100	€ (646)	€ (483)	(0,03)
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	12.09.2023	123.100	€ (327)	€ (130)	(0,01)
							€ (973)	€ (613)	(0,04)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens	
GST	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	\$ 200	€ (8)	€ 8	€ 0	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	16.800	(655)	657	€ 2	0,00	
						€ (663)	€ 665	€ 2	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEWISENTERMINIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2023	DKK	€ 60.704	€ 8.152	€ 0	€ 0	0,00	
	07.2023	€	€ 6.636	\$ 7.138	0	(93)	(0,01)	
	08.2023	AUD	€ 220	€ 135	1	1	0,00	
BPS	09.2023	KRW	\$ 34.796	\$ 27	1	1	0,00	
	07.2023	€	€ 4.908	DKK 36.575	4	4	0,00	
	07.2023		197.949	\$ 216.893	853	853	0,05	
	08.2023	CNH	€ 19.021	€ 2.770	134	0	134	0,01
	08.2023	€	€ 2.587	£ 2.212	0	(14)	(14)	0,00
	08.2023	£	€ 4.009	€ 4.660	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	\$	€ 1.187	CNH 8.204	0	(51)	(51)	0,00
	08.2023	€	€ 217.198	€ 197.949	0	(860)	(860)	(0,05)
	09.2023	IDR	€ 921.895	\$ 61	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	€	€ 25.363	DKK 188.854	1	1	0,00	
	08.2023	DKK	€ 188.803	€ 25.363	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	€	€ 1.341	¥ 196.700	0	(88)	(88)	(0,01)
CBK	07.2023	\$	€ 3.724	€ 3.452	39	39	0,00	
	09.2023	€	€ 95.160	¥ 14.878.000	0	(107)	(107)	(0,01)
JPM	07.2023	DKK	€ 203.313	€ 27.300	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	€	€ 5.182	DKK 38.590	1	1	0,00	
	08.2023	DKK	€ 38.580	€ 5.182	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	£	€ 71.890	€ 82.559	0	(1.052)	(1.052)	(0,06)
	08.2023	¥	€ 5.700.000	€ 38.193	1.913	0	1.913	0,11
	08.2023	\$	€ 953	CNH 6.586	0	(41)	(41)	0,00
	09.2023	IDR	€ 1.887.579	\$ 127	1	0	1	0,00
	10.2023	MXN	€ 322	€ 18	0	0	0	0,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2023	¥ 6.280.000	€ 44.360	€ 4.477	€ 0	€ 4.477	0,25
	07.2023	\$ 2.152	€ 2.012	40	0	40	0,00
	08.2023	€ 15.127	¥ 2.203.529	0	(1.091)	(1.091)	(0,06)
	08.2023	¥ 7.240.000	€ 48.744	2.566	0	2.566	0,15
	09.2023	5.750.000	€ 37.112	327	0	327	0,02
MYI	09.2023	KRW 64.503	\$ 51	1	0	1	0,00
	07.2023	€ 1.472	€ 1.590	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	IDR 16.379	€ 1	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 5.303	€ 4.962	101	0	101	0,01
	07.2023	€ 1	IDR 16.379	0	0	0	0,00
	08.2023	€ 3.504	£ 3.003	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	£ 9.427	€ 10.894	0	(70)	(70)	(0,01)
	09.2023	IDR 507.220	\$ 34	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW 72.491	\$ 57	1	0	1	0,00
	09.2023	\$ 1	IDR 16.394	0	0	0	0,00
RBC	08.2023	€ 2.073	¥ 306.600	0	(120)	(120)	(0,01)
	08.2023	\$ 543	MXN 9.405	1	0	1	0,00
RYL	08.2023	£ 3.591	€ 4.122	0	(54)	(54)	0,00
	09.2023	¥ 9.128.000	€ 61.631	3.363	0	3.363	0,20
SCX	08.2023	€ 1.198	£ 1.031	2	0	2	0,00
	08.2023	£ 92.347	€ 105.756	0	(1.649)	(1.649)	(0,09)
	08.2023	\$ 454	CNH 3.121	0	(21)	(21)	0,00
SOG	09.2023	IDR 1.566.231	\$ 105	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 210.448	€ 195.631	2.736	0	2.736	0,16
UAG	07.2023	¥ 2.121.000	€ 14.576	1.086	0	1.086	0,06
	09.2023	5.560.000	€ 37.393	1.878	0	1.878	0,11
				€ 19.527	€ (5.347)	€ 14.180	0,82

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 106.043	CHF 102.615	€ 0	€ (906)	€ (906)	(0,05)
BRC	07.2023	48.625	CHF 47.213	0	(251)	(251)	(0,01)
MYI	07.2023	CHF 2.464	€ 2.543	19	0	19	0,00
	07.2023	€ 63.959	CHF 62.089	0	(344)	(344)	(0,02)
RBC	07.2023	CHF 2.317	€ 2.358	0	(16)	(16)	0,00
UAG	07.2023	99.885	CHF 102.053	0	(287)	(287)	(0,02)
	07.2023	€ 105.868	CHF 102.385	0	(967)	(967)	(0,06)
	08.2023	102.053	CHF 99.741	300	0	300	0,02
				€ 319	€ (2.771)	€ (2.452)	(0,14)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ 11.117 0,64

Summe Anlagen

€ 1.836.603 104,74

Sonstige Aktiva und Passiva

€ (83.042) (4,74)

Nettovermögen

€ 1.753.561 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 2.273 EUR (31. Dezember 2022: 4.360 EUR) und Barmittel in Höhe von 1.500 EUR (31. Dezember 2022: 5.628 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 48.591 EUR (31. Dezember 2022: 53.376 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.600.242	€ 248	€ 1.600.490
Investmentfonds	15.515	117.088	0	132.603
Pensionsgeschäfte	0	104.244	0	104.244
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.249)	515	0	(734)
<b>Summen</b>	<b>€ 14.266</b>	<b>€ 1.822.089</b>	<b>€ 248</b>	<b>€ 1.836.603</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.747.790	€ 0	€ 1.747.790
Investmentfonds	180.784	870	0	181.654
Pensionsgeschäfte	0	11.515	0	11.515
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(33.951)	(39.063)	0	(73.014)
<b>Summen</b>	<b>€ 146.833</b>	<b>€ 1.721.112</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 1.867.945</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (1.480)	€ 1.790	€ 310	€ (136)	€ 0	€ (136)
BPS	(66)	0	(66)	(3.776)	1.243	(2.533)
BRC	(340)	580	240	(672)	250	(422)
CBK	(68)	0	(68)	(250)	0	(250)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(662)	553	(109)
GST	2	11	13	(1.966)	1.883	(83)
JPM	816	(1.331)	(515)	(3.086)	3.064	(22)
MBC	6.320	(6.180)	140	(236)	(390)	(626)
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(26)	70	44
MYI	(319)	424	105	(46)	37	(9)
RBC	(135)	0	(135)	(30)	0	(30)
RYL	3.309	(3.300)	9	(198)	30	(168)
SCX	(1.668)	968	(700)	(313)	373	60
SOG	2.736	(3.010)	(274)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	2.746	(1.770)	976
UAG	2.010	(1.450)	560	(962)	(4.040)	(5.002)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	70,93	71,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	20,33	19,58
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,02	0,23
Investmentfonds	7,56	9,49
Pensionsgeschäfte	5,94	0,60
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	(1,69)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,65)	(1,62)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,64	(0,50)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,01	0,01
Unternehmensanleihen und Wechsel	21,42	26,04
US-Regierungsbehörden	8,31	5,29
US-Schatzobligationen	3,57	2,26
Non-Agency-MBS	13,91	12,23
Forderungsbesicherte Wertpapiere	13,95	12,40
Staatsemissionen	19,92	20,18
Vorzugswertpapiere	0,01	0,07
Kurzfristige Instrumente	10,18	12,87
Investmentfonds	7,56	9,49
Pensionsgeschäfte	5,94	0,60
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	(1,69)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,02)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen		
— Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,13)
Zinsswaps	(0,65)	(1,49)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,51
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,04)	(1,04)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen		
— Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,82	0,07
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,14)	(0,04)
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,74)	2,37
Nettovermögen	100,00	100,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
Danone S.A. 3,470 % fällig am 22.05.2031	€ 2.900	€ 2.887	0,47		TenneT Holding BV 4,750 % fällig am 28.10.2042	€ 1.100	€ 1.227	0,20		Newgate Funding PLC 4,126 % fällig am 15.12.2050	€ 173	€ 167	0,03	
Deutsche Bahn Finance GmbH 3,250 % fällig am 19.05.2033	500	493	0,08		Thames Water Utilities Finance PLC 0,875 % fällig am 31.01.2028 4,375 % fällig am 18.01.2031	1.800 2.200	1.436 1.963	0,24 0,32		Primrose Residential DAC 4,439 % fällig am 24.10.2061	2.420	2.397	0,39	
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875 % fällig am 31.03.2028 2,125 % fällig am 09.07.2027	800 2.900	708 2.664	0,12 0,44		Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	1.700	1.307	0,21		RMAC Securities PLC 5,134 % fällig am 12.06.2044	£ 85	95	0,02	
General Mills, Inc. 3,907 % fällig am 13.04.2029	400	401	0,07		Universal Music Group NV 3,750 % fällig am 30.06.2032 4,000 % fällig am 13.06.2031	1.600 1.600	1.569 1.596	0,26 0,26		Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,846 % fällig am 19.12.2034	\$ 58	47	0,01	
Global Payments, Inc. 4,875 % fällig am 17.03.2031	1.100	1.096	0,18		Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % fällig am 26.03.2028	2.200	1.728	0,28		Towd Point Mortgage Funding PLC 5,635 % fällig am 20.10.2051	£ 1.182	1.380	0,23	
GN Store Nord A/S 0,875 % fällig am 25.11.2024	4.600	4.291	0,70		Werfen S.A. 4,625 % fällig am 06.06.2028	4.600	4.543	0,74		Twin Bridges PLC 5,715 % fällig am 12.03.2055	1.966	2.283	0,37	
H Lundbeck A/S 0,875 % fällig am 14.10.2027	2.100	1.824	0,30		Worley U.S. Finance Sub Ltd. 0,875 % fällig am 09.06.2026	2.500	2.235	0,37				19.430	3,18	
Heineken NV 4,125 % fällig am 23.03.2035	900	930	0,15				98.457	16,14						
Holdings d'Infrastructures de Transport SASU 1,625 % fällig am 18.09.2029 4,250 % fällig am 18.03.2030	100 2.300	86 2.278	0,01 0,37		<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>					<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
IMCD NV 2,125 % fällig am 31.03.2027	100	90	0,01		AT&T, Inc. 3,950 % fällig am 30.04.2031	1.200	1.191	0,20		Ares European CLO DAC 3,787 % fällig am 15.04.2030	€ 492	482	0,08	
InterContinental Hotels Group PLC 3,375 % fällig am 08.10.2028	£ 2.400	2.375	0,39		Cadent Finance PLC 4,250 % fällig am 05.07.2029 (a)	800	796	0,13		Aurium CLO DAC 4,618 % fällig am 23.03.2032	1.300	1.280	0,21	
International Flavors & Fragrances, Inc. 1,800 % fällig am 25.09.2026	€ 850	765	0,13		E.ON SE 3,875 % fällig am 12.01.2035	1.800	1.790	0,29		Bastille Euro CLO DAC 4,327 % fällig am 15.01.2034	2.700	2.630	0,43	
JDE Peet's NV 0,500 % fällig am 16.01.2029	3.850	3.171	0,52		Electricite de France S.A. 4,250 % fällig am 25.01.2032	2.700	2.674	0,44		BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 3,827 % fällig am 15.07.2030	327	321	0,05	
John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034	£ 1.050	763	0,12		EnBW International Finance BV 4,000 % fällig am 24.01.2035	1.900	1.860	0,30		Bosphorus CLO DAC 4,496 % fällig am 12.12.2032	1.900	1.858	0,31	
Medtronic Global Holdings S.C.A. 2,250 % fällig am 07.03.2039	€ 2.000	1.592	0,26		EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	2.400	1.687	0,28		Cairn CLO DAC 3,971 % fällig am 25.04.2032 4,051 % fällig am 25.07.2029	600 500	588 499	0,10 0,08	
Mitchells & Butlers Finance PLC 5,965 % fällig am 15.12.2025 6,002 % fällig am 15.12.2030 6,013 % fällig am 15.12.2030	£ 5 \$ 388 £ 105	5 328 110	0,00 0,05 0,02		National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC 3,530 % fällig am 20.09.2028	300	292	0,05		Carlyle Euro CLO DAC 3,953 % fällig am 15.08.2030	634	620	0,10	
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0,625 % fällig am 09.09.2032	€ 2.100	1.604	0,26		National Grid PLC 3,875 % fällig am 16.01.2029	2.700	2.679	0,44		Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 4,137 % fällig am 16.01.2033	1.600	1.551	0,25	
Motability Operations Group PLC 3,500 % fällig am 17.07.2031	2.000	1.960	0,32		RTE Reseau de Transport d'Electricite SADI 3,750 % fällig am 04.07.2035 (a)	1.400	1.396	0,23		Contego CLO BV 3,947 % fällig am 15.10.2030	699	688	0,11	
Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	2.800	2.394	0,39		TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028 5,618 % fällig am 06.02.2030	1.700 1.800	1.671 1.768	0,27 0,29		CVC Cordatus Loan Fund DAC 4,103 % fällig am 15.08.2032 4,447 % fällig am 17.06.2032	995 900	976 880	0,16 0,14	
Netflix, Inc. 3,875 % fällig am 15.11.2029	3.300	3.222	0,53		Verizon Communications, Inc. 4,750 % fällig am 31.10.2034	3.600	3.777	0,62		Dryden Euro CLO DAC 4,027 % fällig am 15.07.2031 4,183 % fällig am 15.05.2034	695 200	686 196	0,11 0,03	
Nokia Oyj 4,375 % fällig am 21.08.2031	1.600	1.578	0,26		Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		399.328	65,46		GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 4,100 % fällig am 20.01.2032	100	98	0,02	
Robert Bosch GmbH 4,375 % fällig am 02.06.2043	1.400	1.437	0,24		<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>					Harvest CLO DAC 4,027 % fällig am 15.01.2032	200	196	0,03	
Sage Group PLC 3,820 % fällig am 15.02.2028	900	889	0,15		Ginnie Mae, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	\$ 4.000	3.541	0,58		Invesco Euro CLO DAC 3,827 % fällig am 15.07.2031	500	488	0,08	
SEB S.A. 1,500 % fällig am 31.05.2024	3.100	3.030	0,50		Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2053 5,000 % fällig am 01.09.2053	1.300 8.200	1.050 7.370	0,17 1,21		Jubilee CLO DAC 3,777 % fällig am 15.04.2030 4,326 % fällig am 15.12.2029	1.000 633	977 626	0,16 0,10	
Siemens Energy Finance BV 4,250 % fällig am 05.04.2029	1.100	1.071	0,18		Non-AGENCY-MBS					Madison Park Euro Funding DAC 3,977 % fällig am 15.07.2032	600	585	0,10	
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3,625 % fällig am 24.02.2043	2.600	2.559	0,42		Canada Square Funding PLC 5,852 % fällig am 17.06.2058	£ 944	1.094	0,18		Man GLG Euro CLO DAC 3,987 % fällig am 15.10.2032	2.797	2.724	0,45	
Sika Capital BV 3,750 % fällig am 03.05.2030	1.000	997	0,16		Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 4,249 % fällig am 25.08.2034 ^	\$ 21	17	0,00		OCP Euro CLO DAC 3,997 % fällig am 15.01.2032	365	360	0,06	
Silfin NV 2,875 % fällig am 11.04.2027	900	810	0,13		Domi BV 4,156 % fällig am 15.06.2053	€ 945	941	0,15		Palmer Square European Loan Funding DAC 3,897 % fällig am 15.10.2031 4,227 % fällig am 15.10.2031	2.580 847	2.529 834	0,42 0,14	
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % fällig am 09.10.2025	2.100	1.998	0,33		Dutch Property Finance BV 3,892 % fällig am 28.07.2058 3,992 % fällig am 28.10.2059	2.104 3.410	2.101 3.397	0,34 0,56		Renaissance Home Equity Loan Trust 5,340 % fällig am 25.01.2037	\$ 1.291	416	0,07	
Suez SACA 2,375 % fällig am 24.05.2030 4,625 % fällig am 03.11.2028 5,000 % fällig am 03.11.2032	1.700 1.500 1.700	1.532 1.535 1.807	0,25 0,25 0,30		Great Hall Mortgages PLC 5,644 % fällig am 18.06.2039	\$ 169	153	0,02		Segovia European CLO DAC 4,080 % fällig am 20.07.2032	€ 500	487	0,08	
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 4,375 % fällig am 03.05.2033	600	598	0,10		Jubilee Place BV 4,027 % fällig am 17.01.2059 4,177 % fällig am 17.10.2057	€ 2.172 443	2.167 443	0,36 0,07		Toro European CLO DAC 3,995 % fällig am 12.01.2032 4,133 % fällig am 15.02.2034	200 500	196 487	0,03 0,08	
Syngenta Finance NV 4,892 % fällig am 24.04.2025	\$ 3.751	3.367	0,55		Landmark Mortgage Securities PLC 4,865 % fällig am 17.04.2044	£ 804	907	0,15		Voya Euro CLO DAC 3,927 % fällig am 15.10.2030	192	189	0,03	
T-Mobile USA, Inc. 4,800 % fällig am 15.07.2028 5,050 % fällig am 15.07.2033 5,750 % fällig am 15.01.2054	3.500 600 500	3.143 540 474	0,52 0,09 0,08		Miravet SARL 4,265 % fällig am 26.05.2065	€ 1.870	1.841	0,30				24.447	4,01	
Teleperformance 3,750 % fällig am 24.06.2029	€ 1.300	1.250	0,20							<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
										Adif Alta Velocidad 3,500 % fällig am 30.07.2028 (a)	3.000	2.984	0,49	
										BNG Bank NV 3,000 % fällig am 11.01.2033	6.000	5.942	0,97	

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Caisse Francaise de Financement Local 3,125 % fällig am 16.11.2027	€ 200	€ 197	0,03	Romania Government International Bond 6,625 % fällig am 27.09.2029	€ 3.400	€ 3.539	0,58	<b>FRANCE TREASURY BILLS</b>			
CPIIB Capital, Inc. 0,050 % fällig am 24.02.2031	3.800	2.959	0,49			55.357	9,08	2,672 % fällig am 05.07.2023 (b)(c)	200	200	0,03
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 3,000 % fällig am 15.12.2028	11.000	10.923	1,79	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				3,057 % fällig am 19.07.2023 (b)(c)	9.000	8.989	1,48
Europäische Union 1,500 % fällig am 04.10.2035	7.400	6.202	1,02	<b>SCHATZTITEL DES EUROPÄISCHEN STABILITÄTSMECHANISMUS</b>				3,116 % fällig am 19.07.2023 (b)(c)	800	799	0,13
Korea Housing Finance Corp. 3,714 % fällig am 11.04.2027	3.100	3.071	0,50	<b>SCHATZTITEL DER EUROPÄISCHEN UNION</b>						9.988	1,64
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035	\$ 2.200	2.125	0,35	3,168 % fällig am 04.09.2023 (b)(c)	350	349	0,06	<b>GERMANY TREASURY BILLS</b>			
Poland Government International Bond 3,875 % fällig am 14.02.2033	€ 2.800	2.781	0,46	3,172 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	150	150	0,03	3,143 % fällig am 19.07.2023 (b)(c)	€ 6.000	€ 5.992	0,98
Province of Ontario 0,010 % fällig am 25.11.2030	3.800	2.978	0,49	3,173 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	700	698	0,11	Summe kurzfristige Instrumente		18.172	2,98
Province of Quebec 3,000 % fällig am 24.01.2033	4.200	4.068	0,67	3,174 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	250	249	0,04	Summe Übertragbare Wertpapiere	€	528.695	86,67
Region of Ile de France 3,050 % fällig am 03.02.2033	7.200	7.079	1,16	3,179 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	250	249	0,04	<b>AKTIEN</b>			
3,700 % fällig am 14.06.2038	500	509	0,08	3,326 % fällig am 08.09.2023 (b)(c)	200	199	0,03	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
						1.894	0,31	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
								PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)	532.500	51.452	8,44
								Summe Investmentfonds	€	51.452	8,44

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
COM	3,250 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 27.600	State of North Rhine-Westphalia 3,400 % fällig am 07.03.2073	€ (28.356)	€ 27.600	€ 27.607	4,53
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	1.066	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(997)	977	977	0,16
Summe Pensionsgeschäfte						€ (29.353)	€ 28.577	€ 28.584	4,69

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	271	€ (411)	(0,07)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	68	(12)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	177	(8)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	134	273	0,05
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	963	(852)	(0,14)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	164	312	0,05
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	150	147	0,02
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	27	59	0,01
				€ (492)	(0,08)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (492)	(0,08)

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 5.000	€ (44)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	1.300	9	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	€ 1.100	(7)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	3.300	(11)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	1.600	6	0,00
Electricite de France S.A.	1,000	20.12.2026	1.300	(12)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	100	0	0,00
				€ (59)	(0,01)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Credit Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	€ 32.200	€ 195	0,03
iTraxx Europe Main 39 10-Year Index	1,000	20.06.2033	200	1	0,00
				€ 196	0,03

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	20.09.2028	£ 5.900	€ 344	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	¥ 1.860.000	(29)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	\$ 42.700	(558)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	27.600	2.452	0,40
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	15.100	2.014	0,33
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	23.000	(200)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	3.400	265	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	42.700	562	0,09
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	09.02.2024	€ 52.200	(1.040)	(0,17)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	8.100	(44)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	35.700	(99)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	30.200	219	0,04
					€ 3.886	0,64
					€ 4.023	0,66

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 869	\$ 952	€ 4	€ 0	€ 4	0,00
BPS	07.2023	65.701	71.983	279	0	279	0,04
	08.2023	CNH 404	59	3	0	3	0,00
	08.2023	\$ 68.407	€ 62.345	0	(271)	(271)	(0,04)
BRC	08.2023	£ 120	139	0	(1)	(1)	0,00
CBK	08.2023	CNH 53	\$ 8	0	0	0	0,00
JPM	08.2023	£ 4.138	€ 4.750	0	(63)	(63)	(0,01)
MBC	08.2023	¥ 45.461	312	22	0	22	0,00
MYI	07.2023	\$ 3.269	3.047	51	(1)	50	0,01
	08.2023	€ 1.790	£ 1.534	0	(6)	(6)	0,00
RBC	08.2023	\$ 58	MXN 1.002	0	0	0	0,00
SCX	08.2023	£ 6.562	€ 7.514	0	(117)	(117)	(0,02)
SOG	07.2023	\$ 68.334	63.523	889	0	889	0,15
				€ 1.248	€ (459)	€ 789	0,13

Summe Freiverkehrsfanzderivate

€ 789 0,13

Summe Anlagen

€ 613.044 100,51

Sonstige Aktiva und Passiva

€ (3.105) (0,51)

Nettovermögen

€ 609.939 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.



- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
 (d) Mit dem Fonds verbunden.  
 (e) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,08 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	2,129 %	24.11.2026	17.11.2020	€ 337	€ 326	0,05

- (f) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 539 EUR (31. Dezember 2022: 262 EUR) und Barmittel in Höhe von null EUR (31. Dezember 2022: 1.150 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 10.762 EUR (31. Dezember 2022: 25.216 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 528.648	€ 47	€ 528.695
Investmentfonds	0	51.452	0	51.452
Pensionsgeschäfte	0	28.577	0	28.577
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.010)	5.330	0	4.320
<b>Summen</b>	<b>€ (1.010)</b>	<b>€ 614.007</b>	<b>€ 47</b>	<b>€ 613.044</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 491.678	€ 0	€ 491.678
Investmentfonds	50.689	0	0	50.689
Pensionsgeschäfte	0	44.621	0	44.621
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(2.892)	(1.106)	0	(3.998)
<b>Summen</b>	<b>€ 47.797</b>	<b>€ 535.193</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 582.990</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
MYI	1,500 %	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (547)	€ (549)	(0,09)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>€ (549)</b>	<b>(0,09)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ 4	€ 0	€ 4	€ (60)	€ 0	€ (60)
BPS	11	0	11	40	0	40
BRC	(1)	0	(1)	15	0	15
CBK	0	0	0	(4)	0	(4)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(1.545)	1.412	(133)
JPM	(63)	0	(63)	26	0	26
MBC	22	0	22	2.095	(1.900)	195
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
MYI	44	0	44	(139)	(50)	(189)
RBC	0	0	0	(30)	0	(30)
SCX	(117)	0	(117)	18	0	18
SOG	889	(1.010)	(121)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	292	0	292
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	11	0	11

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	81,20	72,82
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	5,47	7,71
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,07
Investmentfonds	8,44	8,31
Pensionsgeschäfte	4,69	7,31
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,08)	(0,47)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,66	(0,30)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,13	0,12
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,09)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	k. A.	1,36
Unternehmensanleihen und Wechsel	65,46	62,43
US-Regierungsbehörden	1,96	2,01
Non-Agency-MBS	3,18	4,11
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,01	5,19
Staatsemissionen	9,08	0,03
Kurzfristige Instrumente	2,98	5,47
Investmentfonds	8,44	8,31
Pensionsgeschäfte	4,69	7,31
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,08)	(0,47)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,19)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes—Schutzverkauf	0,03	0,02
Zinsswaps	0,64	(0,13)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,24)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,13	0,36
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,51)	4,43
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
Charter Communications Operating LLC				3,035 % fällig am 28.05.2032				UniCredit SpA			
6,795 % - 6,834 % fällig am 01.02.2027	\$ 2.721	€ 2.482	0,19	(f)	\$ 200	€ 144	0,01	1,982 % fällig am 03.06.2027	\$ 500	€ 404	0,03
SCUR-Alpha 1503 GmbH	€ 1.200	1.147	0,09	3,547 % fällig am 18.09.2031	1.100	838	0,07	3,127 % fällig am 03.06.2032	6.000	4.342	0,34
9,087 % fällig am 29.03.2030				Digital Euro Finco LLC	€ 1.300	1.074	0,09	Yango Justice International Ltd.	12.600	173	0,01
10,602 % fällig am 28.03.2030	\$ 2.494	2.169	0,17	1,125 % fällig am 09.04.2028				7,875 % fällig am 04.09.2024 ^		276.054	21,87
Sigma Bidco BV	€ 1.300	1.275	0,10	Digital Intrepid Holding BV	€ 800	557	0,04				
6,239 % fällig am 02.07.2025				0,625 % fällig am 15.07.2031	7.500	5.377	0,43	<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
Windstream Services LLC	\$ 2.907	2.494	0,20	1,375 % fällig am 18.07.2032	6.400	4.861	0,39	Altice Financing S.A.	6.000	4.266	0,34
11,452 % fällig am 21.09.2027				DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH	€ 6.400	4.861	0,39	5,750 % fällig am 15.08.2029	€ 5.000	3.662	0,29
Wm Morrison Supermarkets Ltd.	€ 4.500	3.873	0,31	EQT AB	1.300	1.147	0,09	Altice France S.A.	€ 5.000	3.662	0,29
8,073 % fällig am 04.11.2027				G City Europe Ltd.	6.400	5.600	0,44	DISH DBS Corp.	\$ 473	348	0,03
		13.440	1,06	4,250 % fällig am 11.09.2025	6.400	5.600	0,44	5,250 % fällig am 01.12.2026	€ 10.100	6.969	0,55
				Globalworth Real Estate Investments Ltd.	6.600	5.462	0,43	Fortune Star BVI Ltd.	€ 3.950	2.826	0,22
				3,000 % fällig am 29.03.2025				3,950 % fällig am 02.10.2026			
				HSBC Holdings PLC	\$ 600	509	0,04	Las Vegas Sands Corp.	€ 1.600	1.379	0,11
				2,099 % fällig am 04.06.2026	1.800	1.483	0,12	2,900 % fällig am 25.06.2025	\$ 1.600	1.379	0,11
				3,973 % fällig am 22.05.2030	12.000	10.760	0,85	Lendlease Europe Finance PLC	€ 164	125	0,01
				5,402 % fällig am 11.08.2033				3,500 % fällig am 02.12.2033	€ 164	125	0,01
				Intesa Sanpaolo SpA	14.275	13.752	1,09	Mitchells & Butlers Finance PLC	\$ 427	462	0,04
				8,248 % fällig am 21.11.2033				5,451 % fällig am 15.12.2030	€ 738	623	0,05
				Jyske Realkredit A/S	DKK 0	0	0,00	6,002 % fällig am 15.12.2030			
				0,500 % fällig am 01.10.2043	0	0	0,00	Nissan Motor Co. Ltd.	1.200	1.001	0,08
				1,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	4,345 % fällig am 17.09.2027			
				1,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	Q-Park Holding BV	€ 7.800	7.302	0,58
				1,500 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00	3,500 % fällig am 01.02.2025			
				1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	Roadster Finance DAC	200	183	0,01
				Kaisa Group Holdings Ltd.	\$ 5.400	315	0,03	1,625 % fällig am 09.12.2029	400	330	0,02
				10,875 % fällig am 23.07.2023 ^	3.500	215	0,02	2,375 % fällig am 08.12.2032			
				11,500 % fällig am 30.01.2023 ^	4.000	245	0,02	Syngenta Finance NV	\$ 6.564	5.893	0,47
				11,650 % fällig am 01.06.2026 ^	2.000	1.822	0,14	4,892 % fällig am 24.04.2025	€ 8.600	6.610	0,52
				KBC Group NV	€ 5.800	5.147	0,41	Ubisoft Entertainment S.A.	€ 1.800	1.371	0,11
				5,796 % fällig am 19.01.2029				7,750 % fällig am 15.08.2028		40.524	3,21
				Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.	€ 2.600	2.247	0,18				
				3,250 % fällig am 12.11.2025	3.600	2.668	0,21	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
				Logicor Financing SARRL	2.600	2.247	0,18	Pacific Gas & Electric Co.	5.000	4.513	0,36
				1,500 % fällig am 13.07.2026	3.600	2.668	0,21	6,100 % fällig am 15.01.2029	5.000	4.561	0,36
				1,625 % fällig am 17.01.2030	\$ 12.200	11.250	0,89	6,400 % fällig am 15.06.2033	3.000	2.717	0,22
				NatWest Group PLC	DKK 0	0	0,00	6,750 % fällig am 15.01.2053		11.791	0,94
				6,016 % fällig am 02.03.2034	0	0	0,00				
				Nordea Kredit Realkreditaktieselskab	0	0	0,00	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		328.369	26,02
				0,500 % fällig am 01.10.2043	0	0	0,00				
				1,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>			
				1,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	Corestate Capital Holding S.A.	€ 7.800	1.135	0,09
				1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	1,375 % fällig am 31.07.2023 ^			
				1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00				
				Nykredit Realkredit A/S	0	0	0,00	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
				0,500 % fällig am 01.10.2043	0	0	0,00	Ginnie Mae, TBA	\$ 3.100	2.792	0,22
				1,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	5,000 % fällig am 01.07.2053			
				1,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security	1.295	1.047	0,08
				1,500 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00	3,000 % fällig am 01.05.2052			
				1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA	23.900	19.311	1,53
				2,500 % fällig am 01.10.2036	0	0	0,00	3,000 % fällig am 01.08.2053	29.100	26.144	2,07
				Realkredit Danmark A/S	0	0	0,00	5,000 % fällig am 01.08.2053	92.300	84.185	6,67
				2,500 % fällig am 01.04.2036	€ 7.082	5.977	0,47	6,000 % fällig am 01.08.2053	268.100	247.869	19,64
				Sagax AB	332	325	0,03	6,500 % fällig am 01.07.2053	55.400	51.826	4,11
				1,125 % fällig am 30.01.2027	5.100	4.819	0,38			433.174	34,32
				2,000 % fällig am 17.01.2024				<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
				2,250 % fällig am 13.03.2025	€ 7.082	5.977	0,47	Alba PLC	£ 1.519	1.638	0,13
				Sagax Euro MTN NL BV	1.400	1.062	0,08	5,261 % fällig am 15.12.2038			
				0,750 % fällig am 26.01.2028	1.700	1.212	0,10	American Home Mortgage Assets Trust	\$ 446	126	0,01
				1,000 % fällig am 17.05.2029				4,896 % fällig am 25.11.2046	1.355	1.038	0,08
				Santander UK Group Holdings PLC	\$ 13.185	9.781	0,78	5,360 % fällig am 25.12.2046			
				2,896 % fällig am 15.03.2032				Atlas Funding PLC	£ 701	816	0,07
				Sirius Real Estate Ltd.	€ 3.700	3.059	0,24	5,432 % fällig am 25.07.2058			
				1,125 % fällig am 22.06.2026	3.500	2.500	0,20	Atrium Hotel Portfolio Trust	\$ 9.700	8.482	0,67
				1,750 % fällig am 24.11.2028				7,093 % fällig am 15.06.2035			
				Societe Generale S.A.	\$ 10.800	8.777	0,70				
				2,797 % fällig am 19.01.2028	7.700	7.076	0,56				
				6,446 % fällig am 10.01.2029	300	280	0,02				
				6,691 % fällig am 10.01.2034							
				Sunac China Holdings Ltd.	2.200	303	0,02				
				5,950 % fällig am 26.04.2024 ^	4.200	582	0,05				
				6,500 % fällig am 26.01.2026 ^							
				UBS Group AG	1.550	1.361	0,11				
				3,750 % fällig am 26.03.2025	€ 6.400	7.098	0,56				
				7,750 % fällig am 01.03.2029							



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
3,765 % fällig am 25.12.2035	\$ 10	€	0,00	Centex Home Equity Loan Trust				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
3,974 % fällig am 25.05.2037 ^	43		0,00	6,200 % fällig am 25.10.2035	\$ 4.024	€	3.527	5,260 % fällig am 25.02.2037	\$ 477	€	140
5,930 % fällig am 25.10.2044	56		0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust			0,28	5,280 % fällig am 25.01.2037	98		41
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				6,851 % fällig am 25.05.2036 ^	129		0,00	5,290 % fällig am 25.10.2036	107		43
4,746 % fällig am 25.04.2047	355		0,02	Contego CLO BV				5,330 % fällig am 25.03.2037	321		130
6,000 % fällig am 25.07.2036 ^	95		0,01	3,947 % fällig am 15.10.2030	€ 1.298		1,278	5,350 % fällig am 25.09.2036	55		19
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	25		0,00	Contego CLO DAC				5,350 % fällig am 25.02.2037	109		48
Wells Fargo Alternative Loan Trust				3,851 % fällig am 23.01.2030	5.535		5,425	5,400 % fällig am 25.03.2037	321		130
6,250 % fällig am 25.11.2037 ^	29		0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				5,450 % fällig am 25.09.2036	328		113
		235.717	18,68	5,430 % fällig am 25.12.2046	\$ 3.298		2,772	6,125 % fällig am 25.02.2035	2.379		1.557
				5,690 % fällig am 25.03.2036	1.050		831	6,200 % fällig am 25.06.2033	4		4
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>											
Accunia European CLO DAC				Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
4,127 % fällig am 15.07.2030	€ 568		560	3,156 % fällig am 25.01.2037 ^	2.093		600	5,320 % fällig am 25.04.2037	260		125
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				CVC Cordatus Loan Fund DAC				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
5,370 % fällig am 25.10.2036	\$ 1.881		657	3,855 % fällig am 21.07.2030	€ 10.744		10.567	5,680 % fällig am 25.04.2037	2.307		774
5,370 % fällig am 25.12.2036	411		101	4,103 % fällig am 15.08.2032	199		195	5,690 % fällig am 25.04.2037	2.307		774
5,430 % fällig am 25.07.2036	105		74	4,305 % fällig am 26.08.2032	500		489	6,465 % fällig am 25.09.2046 ^	285		89
5,430 % fällig am 25.02.2037	2.800		1.113	4,447 % fällig am 17.06.2032	1.300		1.271	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
5,450 % fällig am 25.01.2037	6.947		3.469	Dryden Euro CLO DAC				6,532 % fällig am 25.10.2036 ^	154		34
6,125 % fällig am 25.11.2033	719		632	4,073 % fällig am 15.05.2032	579		564	NovaStar Mortgage Funding Trust			
ALME Loan Funding DAC				4,183 % fällig am 15.05.2034	300		294	5,450 % fällig am 25.06.2036	82		53
3,927 % fällig am 15.01.2032	€ 291		286	Fieldstone Mortgage Investment Trust				5,450 % fällig am 25.09.2036	149		59
Amerquest Mortgage Securities Trust				5,930 % fällig am 25.12.2035	\$ 5.000		3.880	5,470 % fällig am 25.05.2036	283		254
5,390 % fällig am 25.10.2036	\$ 3.163		879	First NLC Trust				Oak Hill European Credit Partners DAC			
Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				5,290 % fällig am 25.08.2037	139		65	3,930 % fällig am 20.01.2032	€ 2.940		2.875
3,425 % fällig am 25.04.2034	1.412		1.271	5,430 % fällig am 25.08.2037	46		22	Oak Hill European Credit Partners Ltd.			
5,870 % fällig am 25.07.2035	1.599		1.451	Fremont Home Loan Trust				4,100 % fällig am 22.07.2030	1.267		1.262
Aqueduct European CLO DAC				5,270 % fällig am 25.01.2037	10.377		4.399	OCF Euro CLO DAC			
3,840 % fällig am 20.07.2030	€ 2.765		2.729	5,300 % fällig am 25.01.2037	214		91	3,997 % fällig am 15.01.2032	4.688		4.628
4,253 % fällig am 15.08.2034	1.000		974	5,470 % fällig am 25.08.2036	185		57	Option One Mortgage Loan Trust			
Ares European CLO DAC				5,490 % fällig am 25.02.2037	650		205	5,250 % fällig am 25.07.2036	\$ 10.557		4.349
3,837 % fällig am 15.10.2030	696		683	6,020 % fällig am 25.11.2034	1.297		1.031	5,330 % fällig am 25.04.2037	13.384		6.928
4,050 % fällig am 20.04.2032	2.100		2.061	6,080 % fällig am 25.04.2035	3.128		2.739	5,370 % fällig am 25.01.2037	256		135
4,325 % fällig am 21.10.2033	8.500		8.360	Griffith Park CLO DAC				5,480 % fällig am 25.04.2037	99		45
Argent Securities Trust				4,103 % fällig am 21.11.2031	€ 3.300		3.238	Palmer Square European Loan Funding DAC			
5,300 % fällig am 25.09.2036	\$ 855		258	GSA Home Equity Trust				3,897 % fällig am 15.10.2031	€ 5.535		5.425
5,350 % fällig am 25.06.2036	463		119	5,772 % fällig am 25.11.2036 ^	\$ 124		35	Palmerston Park CLO DAC			
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				GSAMP Trust				3,825 % fällig am 18.04.2030	1.259		1.242
5,790 % fällig am 25.01.2036	474		384	5,250 % fällig am 25.12.2046	185		85	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
Asset-Backed Funding Certificates Trust				5,290 % fällig am 25.12.2036	843		418	5,885 % fällig am 25.02.2035	\$ 399		351
6,150 % fällig am 25.06.2037	72		51	5,300 % fällig am 25.12.2046	508		203	Purple Finance CLO DAC			
6,200 % fällig am 25.03.2034 ^	113		97	5,350 % fällig am 25.11.2036	190		84	4,200 % fällig am 20.04.2032	€ 1.200		1.177
Aurium CLO DAC				5,380 % fällig am 25.12.2046	92		43	Renaissance Home Equity Loan Trust			
3,847 % fällig am 16.04.2030	€ 2.082		2.044	5,450 % fällig am 25.09.2036	355		118	5,879 % fällig am 25.06.2037 ^	\$ 3.494		962
Bain Capital Euro CLO DAC				Harvest CLO DAC				6,950 % fällig am 25.09.2037	144		110
4,311 % fällig am 24.01.2033	400		392	3,817 % fällig am 15.10.2031	€ 1.400		1.367	7,238 % fällig am 25.09.2037 ^	212		85
Bastille Euro CLO DAC				3,907 % fällig am 15.01.2031	931		915	Residential Asset Mortgage Products Trust			
4,327 % fällig am 15.01.2034	8.200		7.989	4,150 % fällig am 20.10.2032	2.000		1.948	6,095 % fällig am 25.10.2035	3.000		2.240
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				4,252 % fällig am 18.11.2030	2.217		2.176	Residential Asset Securities Corp. Trust			
3,945 % fällig am 25.10.2036	\$ 33		14	HSI Asset Securitization Corp. Trust				5,410 % fällig am 25.11.2036	687		579
6,050 % fällig am 25.08.2034	899		793	5,370 % fällig am 25.12.2036	\$ 198		49	6,110 % fällig am 25.01.2036	3.300		2.703
Blackrock European CLO DAC				5,490 % fällig am 25.12.2036	953		235	Rockford Tower Europe CLO DAC			
4,426 % fällig am 15.12.2032	€ 600		584	5,525 % fällig am 25.05.2037	4.600		4.043	4,577 % fällig am 20.12.2031	€ 559		549
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				5,590 % fällig am 25.12.2036	552		137	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
3,827 % fällig am 15.07.2030	2.352		2.310	JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				5,330 % fällig am 25.07.2036	\$ 192		62
4,087 % fällig am 15.01.2033	2.300		2.242	6,080 % fällig am 25.06.2035	4.968		4.091	5,470 % fällig am 25.07.2036	188		60
BNPP AM Euro CLO DAC				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				5,630 % fällig am 25.07.2036	161		52
3,827 % fällig am 15.10.2031	1.133		1.108	6,337 % fällig am 25.08.2036 ^	90		49	5,650 % fällig am 25.03.2036	3.048		1.752
BNPP IP Euro CLO DAC				Jubilee CLO DAC				5,650 % fällig am 25.05.2036	661		326
3,967 % fällig am 15.10.2030	1.000		982	3,787 % fällig am 15.04.2030	€ 700		686	Segovia European CLO DAC			
Bosphorus CLO DAC				4,326 % fällig am 15.12.2029	949		938	3,945 % fällig am 18.01.2031	€ 264		259
4,346 % fällig am 15.12.2030	882		868	Lehman XS Trust				4,080 % fällig am 20.07.2032	2.000		1.949
Cairn CLO DAC				5,320 % fällig am 25.02.2037 ^	\$ 977		673	Soundview Home Loan Trust			
3,912 % fällig am 31.01.2030	4.176		4.112	Mackay Shields Euro CLO DAC				3,904 % fällig am 25.04.2035	\$ 1.588		1.423
4,051 % fällig am 25.07.2029	1.514		1.512	4,130 % fällig am 20.10.2032	€ 1.300		1.267	5,260 % fällig am 25.02.2037	263		69
4,212 % fällig am 20.10.2028	32		32	Man GLG Euro CLO DAC				5,330 % fällig am 25.02.2037	388		102
Carlyle Euro CLO DAC				3,857 % fällig am 15.10.2030	513		504	5,430 % fällig am 25.06.2037	138		85
3,953 % fällig am 15.08.2030	5.795		5.666	4,047 % fällig am 15.01.2030	3.078		3.040	5,825 % fällig am 25.06.2035	2.718		2.405
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				Marlay Park CLO DAC				6,150 % fällig am 25.09.2037	7.798		4.858
3,927 % fällig am 15.07.2030	1.227		1.210	3,917 % fällig am 15.10.2030	1.301		1.282	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
Carrington Mortgage Loan Trust				MASTR Asset-Backed Securities Trust				5,450 % fällig am 25.09.2037	65		41
5,410 % fällig am 25.02.2037	\$ 143		119	5,250 % fällig am 25.11.2036	\$ 136		41	St. Paul's CLO DAC			
				5,450 % fällig am 25.08.2036	236		85	3,937 % fällig am 17.07.2030	€ 1.494		1.470
				5,630 % fällig am 25.06.2036	128		45	Structured Asset Investment Loan Trust			
				5,630 % fällig am 25.08.2036	141		51	5,300 % fällig am 25.09.2036	\$ 25		22
				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust							
				5,450 % fällig am 25.11.2037	610		197				
				5,690 % fällig am 25.04.2047	1.539		588				



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Income Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust	\$ 1.879	€	1.704	0,14	3,424 % fällig am 14.09.2023 (b)(c)	€	10.180	€	10.111	0,80	GERMANY TREASURY BILLS			
Toro European CLO DAC					3,425 % fällig am 14.09.2023 (b)(c)		1.250		1.242	0,10	3,322 % fällig am 18.10.2023 (b)(c)	€	23.400	€ 23.167 1,84
3,917 % fällig am 15.10.2030	€	1.103	1.082	0,09	3,426 % fällig am 14.09.2023 (b)(c)		1.850		1.838	0,14	JAPAN TREASURY BILLS			
3,995 % fällig am 12.01.2032		9.200	9.023	0,72	3,427 % fällig am 14.09.2023 (b)(c)		9.030		8.969	0,71	(0,248) % fällig am 03.07.2023 (b)(c)	¥	7.182.400	45.549 3,61
4,097 % fällig am 15.07.2030		1.515	1.504	0,12					37.963	3,01	(0,229) % fällig am 03.07.2023 (b)(c)		2.697.600	17.107 1,35
Voya Euro CLO DAC														62.656 4,96
3,927 % fällig am 15.10.2030	4.121		4.069	0,32										174.531 13,83
			199.546	15,81										
<b>STAATSEMISSIONEN</b>														
Russia Government International Bond					EUROPEAN STABILITY MECHANISM TREASURY BILLS									
2,875 % fällig am 04.12.2025 ^	4.000		2.330	0,18	3,337 % fällig am 07.09.2023 (b)(c)		2.180		2.166	0,17	Summe kurzfristige Instrumente			
Ukraine Government International Bond					3,347 % fällig am 07.09.2023 (b)(c)		1.520		1.511	0,12	Summe Übertragbare Wertpapiere	€	1.389.763	110,11
7,750 % fällig am 01.09.2025 ^	\$ 6.500		1.521	0,12					3.677	0,29				
			3.851	0,30										
<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>														
<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>														
Corestate Capital Holding S.A.					EUROPEAN UNION TREASURY BILLS									
15,000 % fällig am 31.07.2023 (f)	€	700	707	0,06	3,168 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)		900		898	0,07	INVESTMENTFONDS			
					3,172 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)		1.800		1.795	0,14	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
					3,173 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)		4.650		4.637	0,37	PIMCO Funds: Global Investors			
					3,174 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)		650		648	0,05	Series plc - PIMCO European			
					3,179 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)		2.900		2.892	0,23	High Yield Bond Fund (d)	1.494.064		15.508 1,23
					3,326 % fällig am 08.09.2023 (b)(c)		2.260		2.246	0,18	BÖRSENGEHADELTE FONDS			
					3,638 % fällig am 08.12.2023 (b)(c)		680		669	0,05	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro			
					3,654 % fällig am 08.12.2023 (b)(c)		2.690		2.648	0,21	Short Maturity UCITS ETF (d)	1.123.300		108.537 8,60
					3,655 % fällig am 08.12.2023 (b)(c)		760		748	0,06	Summe Investmentfonds		€124.045	9,83
					3,658 % fällig am 08.12.2023 (b)(c)		1.560		1.536	0,12				
					3,663 % fällig am 08.12.2023 (b)(c)		3.850		3.790	0,30				
									22.507	1,78				
					FRANCE TREASURY BILLS									
					3,350 % fällig am 30.08.2023 (b)(c)		16.470		16.384	1,30				
					3,387 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)		7.520		7.470	0,59				
									23.854	1,89				

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
COM	3,250 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 122.400	Brandenburg 0,010 % fällig am 02.06.2025	€ (100.000)	€ 122.400	€ 122.433	9,70
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	\$ 299	Nordrhein-Westfalen 0,250 % fällig am 13.03.2026	(32.863)	274	274	0,02
					U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(280)			
Summe Pensionsgeschäfte						€ (133.143)	€ 122.674	€ 122.707	9,72

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHADELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	201	€ (255)	(0,02)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	3.522	2.964	0,23
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.092	(757)	(0,06)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	802	(901)	(0,07)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	19	19	0,00
				€ 1.070	0,08

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHADELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	81	€ (33)	€ (28)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	81	(26)	(3)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	15	(5)	(2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	15	(7)	(3)	0,00
				€ (71)	€ (36)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					€ 1.034	0,08

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 13.000	€ (99)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.400	(22)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	1.100	8	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	200	5	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	8.700	26	0,00
				€ (82)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000 %	20.12.2027	\$ 16.335	€ 671	0,05
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	120.900	3.114	0,25
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	3.400	22	0,00
				€ 3.807	0,30

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 2.600	€ (213)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	25.900	1.510	0,12
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 8.530.000	688	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	\$ 220.700	2.789	0,22
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	220.700	(3.966)	(0,31)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,868	05.05.2032	15.100	(1.757)	(0,14)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,040	25.05.2032	7.800	(797)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,068	11.05.2032	15.400	(1.572)	(0,12)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,153	18.05.2032	15.400	(1.456)	(0,12)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	39.900	1.875	0,15
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	3.085	(92)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	2.600	(56)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	14.06.2033	9.700	(157)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,420	24.05.2033	7.600	(65)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	40.200	(471)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	5.000	(49)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	12.200	(100)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	8.100	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	1.800	(23)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	74.000	(1.249)	(0,10)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	15.03.2030	46.000	1.233	0,10
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	5.000	(38)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	220.700	(2.775)	(0,22)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	09.02.2024	€ 115.000	(2.290)	(0,18)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	26.700	1.184	0,09
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,520	07.07.2027	9.600	(617)	(0,05)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	41.200	(121)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	133.900	340	0,03
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,150	30.01.2025	667.700	(4.904)	(0,39)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	11.000	88	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,500	15.01.2025	68.100	492	0,04
					€ (12.574)	(0,99)
					€ (8.849)	(0,70)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Income Bond Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSOPTIENEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	2.700	€ (9)	€ (12)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	2.700	(9)	(7)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	2.800	(17)	(7)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	2.800	(17)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	1.000	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	1.000	(7)	(2)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	2.300	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	2.300	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	1.700	(11)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	1.700	(11)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	1.100	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	1.100	(3)	(5)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	1.300	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	1.300	(3)	(4)	0,00
FAR	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	2.000	(13)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	2.000	(13)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,100	31.08.2023	8.500	(58)	(11)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	31.08.2023	8.500	(58)	(79)	(0,02)
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	2.300	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	2.300	(7)	(10)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	1.300	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	1.300	(3)	(4)	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	2.000	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	2.000	(7)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	2.900	(9)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	2.900	(9)	(11)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	2.300	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	2.300	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	2.000	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	2.000	(6)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	2.200	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	2.200	(7)	(9)	0,00
							€ (348)	€ (193)	(0,02)

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	\$ 93,281	06.07.2023	1.800	€ (7)	€ (2)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprä-mien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	ADLER Real Estate AG	5,000 %	20.12.2026	€ 1.200	€ (6)	€ (265)	€ (271)	(0,02)
JPM	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	5,000	20.12.2023	4.600	0	36	36	0,00
					€ (6)	€ (229)	€ (235)	(0,02)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 5.623	\$ 6.138	€ 8	€ (5)	€ 3	0,00
	07.2023	KRW 240.525	184	1	0	1	0,00
	08.2023	€ 13.124	AUD 21.374	0	(95)	(95)	(0,01)
	09.2023	TWD 1.183	\$ 39	1	0	1	0,00
	09.2023	\$ 3.319	IDR 49.689.442	0	(17)	(17)	0,00
	09.2023	1.493	KRW 1.891.572	0	(47)	(47)	0,00
BPS	07.2023	€ 284.621	\$ 311.765	1.184	(44)	1.140	0,09
	07.2023	KRW 36.599	28	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH 729	106	5	0	5	0,00
	08.2023	£ 488	€ 567	0	0	0	0,00
	08.2023	KRW 2.395.712	\$ 1.827	6	0	6	0,00
	08.2023	TWD 592	19	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 299.733	€ 273.170	0	(1.187)	(1.187)	(0,09)
	08.2023	1.496	INR 122.911	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	¥ 9.880.000	€ 70.570	7.915	0	7.915	0,64
	07.2023	KRW 243.065	\$ 186	1	0	1	0,00
	08.2023	€ 966	£ 835	5	0	5	0,00
	08.2023	¥ 88.300	€ 602	39	0	39	0,00
CBK	07.2023	€ 4.861	\$ 5.271	0	(30)	(30)	0,00
	08.2023	CNH 216	31	1	0	1	0,00
	08.2023	£ 1.340	€ 1.532	0	(27)	(27)	0,00
	08.2023	TWD 570	\$ 19	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW 242.283	187	3	0	3	0,00
DUB	07.2023	€ 5.342	5.733	0	(87)	(87)	(0,01)
	07.2023	\$ 11.784	BRL 63.851	1.328	0	1.328	0,11
	08.2023	€ 3.246	NZD 5.650	0	(81)	(81)	(0,01)
	10.2023	\$ 119	ZAR 2.174	0	(5)	(5)	0,00
GLM	07.2023	BRL 64.053	\$ 13.266	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	KRW 95.417	73	0	0	0	0,00
	08.2023	€ 6.209	NOK 71.805	0	(70)	(70)	(0,01)
	08.2023	KRW 1.145.553	\$ 871	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 2.306	INR 189.439	0	0	0	0,00
	09.2023	13.266	BRL 64.763	7	0	7	0,00
JPM	07.2023	DKK 997	€ 134	0	0	0	0,00
	07.2023	€ 134	DKK 996	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 15.387	€ 14.269	165	0	165	0,01
	08.2023	DKK 996	134	0	0	0	0,00
	08.2023	€ 2.760	£ 2.368	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	1.928	¥ 281.099	0	(138)	(138)	(0,01)
	08.2023	£ 33.377	€ 38.309	0	(510)	(510)	(0,04)
	08.2023	KRW 201.838	\$ 153	0	0	0	0,00
	09.2023	INR 10.511	128	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW 672.307	517	4	0	4	0,00
	09.2023	\$ 1.384	IDR 20.816.293	0	(1)	(1)	0,00
	10.2023	MXN 19.151	\$ 1.091	0	(4)	(4)	0,00
	12.2023	\$ 1.571	INR 129.643	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	€ 2.676	\$ 2.930	10	0	10	0,00
	08.2023	2.583	£ 2.222	1	0	1	0,00
	08.2023	10.885	¥ 1.585.563	0	(784)	(784)	(0,06)
	09.2023	\$ 2.749	KRW 3.506.427	0	(70)	(70)	(0,01)
MYI	07.2023	€ 4.383	\$ 4.796	13	0	13	0,00
	07.2023	IDR 13.098.728	876	2	0	2	0,00
	07.2023	\$ 11.788	€ 11.030	225	0	225	0,02
	07.2023	872	IDR 13.098.728	2	0	2	0,00
	08.2023	£ 1.180	€ 1.352	0	(21)	(21)	0,00
	08.2023	TWD 637	\$ 21	1	0	1	0,00
	09.2023	INR 2.270	28	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW 1.301.348	1.002	9	0	9	0,00
	09.2023	\$ 876	IDR 13.110.114	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023	3.079	KRW 3.940.658	0	(69)	(69)	(0,01)
RBC	07.2023	7.500	MXN 144.318	822	0	822	0,06
	08.2023	1.216	21.068	2	0	2	0,00
SCX	08.2023	£ 52.923	€ 60.607	0	(945)	(945)	(0,07)
	08.2023	NZD 871	484	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	INR 6.574	\$ 80	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW 239.131	185	3	0	3	0,00
	09.2023	TWD 988	32	1	0	1	0,00
	09.2023	\$ 2.050	IDR 30.486.750	0	(23)	(23)	0,00
SOG	07.2023	299.994	€ 278.873	3.901	0	3.901	0,31
SSB	07.2023	KRW 177.793	\$ 136	1	0	1	0,00
	09.2023	\$ 8.202	BRL 41.580	293	0	293	0,02
	12.2023	160	INR 13.206	0	0	0	0,00
UAG	08.2023	NZD 4.599	€ 2.556	0	(21)	(21)	0,00
				€ 15.959	€ (4.306)	€ 11.653	0,93
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ 11.223	0,89
Summe Anlagen						€ 1.639.890	129,93
Sonstige Aktiva und Passiva						€ (377.720)	(29,93)
Nettovermögen						€ 1.262.170	100,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Income Bond Fund (Forts.)

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.  
 (b) Nullkuponwertpapier.  
 (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
 (d) Mit dem Fonds verbunden.  
 (e) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,06 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Corestate Capital Holding S.A.	15,000 %	31.07.2023	06.12.2022	€ 700	€ 707	0,06
Deutsche Bank AG	2,129	24.11.2026	11.01.2023	2.350	2.285	0,18
Deutsche Bank AG	3,035	28.05.2032	29.07.2021	173	144	0,01
				€ 3.223	€ 3.136	0,25

(g) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 9.079 EUR (31. Dezember 2022: null EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von 247 EUR (31. Dezember 2022: null EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte geliefert.

Barmittel in Höhe von 44.941 EUR (31. Dezember 2022: 41.642 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.241 EUR (31. Dezember 2022: 5.462 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.388.755	€ 1.008	€ 1.389.763
Investmentfonds	15.508	108.537	0	124.045
Pensionsgeschäfte	0	122.674	0	122.674
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2.728	680	0	3.408
Summen	€ 18.236	€ 1.620.646	€ 1.008	€ 1.639.890

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.098.581	€ 1.860	€ 1.100.441
Investmentfonds	134.815	0	0	134.815
Pensionsgeschäfte	0	120.458	0	120.458
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	3.623	(5.077)	0	(1.454)
Summen	€ 138.438	€ 1.213.962	€ 1.860	€ 1.354.260

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
MYI	1,500 %	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (3.636)	€ (3.643)	(0,29)
	1,500	13.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(5.209)	(5.213)	(0,41)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					€ (8.856)	(0,70)

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (188)	€ 247	€ 59	€ 149	€ (272)	€ (123)
BPS	(38)	60	22	275	(290)	(15)
BRC	7.947	(7.727)	220	175	0	175
CBK	(53)	0	(53)	(16)	0	(16)
DUB	1.155	(1.237)	(82)	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(90)	0	(90)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(92)	18	(74)	(3.563)	3.382	(181)
GST	(271)	321	50	(289)	328	39
JPM	(474)	321	(153)	(2.314)	1.752	(562)
MBC	(843)	742	(101)	3.869	(3.429)	440
MYC	(17)	0	(17)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	157	(247)	(90)	(128)	0	(128)
RBC	824	(910)	(86)	(168)	0	(168)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	83	0	83
SCX	(968)	532	(436)	(42)	0	(42)
SOG	3.901	(2.878)	1.023	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	294	(257)	37	428	(272)	156
UAG	(21)	(238)	(259)	65	0	65

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	80,93	60,94
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	29,18	19,96
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,44
Investmentfonds	9,83	9,96
Pensionsgeschäfte	9,72	8,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,08	0,20
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,70)	(0,20)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,89	(0,11)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,70)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,06	2,26
Unternehmensanleihen und Wechsel	26,02	43,78
Wandelanleihen & Wechsel	0,09	0,11
US-Regierungsbehörden	34,32	6,78
Non-Agency-MBS	18,68	3,46
Forderungsbesicherte Wertpapiere	15,81	11,18
Staatsemissionen	0,30	1,15
Kurzfristige Instrumente	13,83	12,62
Investmentfonds	9,83	9,96
Pensionsgeschäfte	9,72	8,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,08	0,20
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,30	0,16
Zinsswaps	(0,99)	(0,34)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,24)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	(0,02)
Devisenterminkontrakte	0,93	0,15
Sonstige Aktiva und Passiva	(29,93)	(0,09)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Long Average Duration Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>								<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>								<b>BANKEN UND FINANZEN</b>			
AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % fällig am 06.02.2027	€ 400	€ 398	0,09	SK Hynix, Inc. 1,000 % fällig am 19.01.2024	\$ 200	€ 178	0,04	Pierpont BTL PLC 0,000 % fällig am 21.09.2054	£ 300	€ 349	0,08
AXA Bank Europe SCF 3,000 % fällig am 03.11.2026	900	881	0,20			277	0,06	Precise Mortgage Funding PLC 6,065 % fällig am 12.12.2055	168	196	0,04
Banco BPM SpA 3,750 % fällig am 27.06.2028	300	299	0,07	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		14.360	3,19	Primrose Residential DAC 4,189 % fällig am 24.03.2061	€ 317	€ 315	0,07
Bank of Montreal 1,000 % fällig am 05.04.2026	800	740	0,16	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				4,439 % fällig am 24.10.2061	519	514	0,11
Barclays PLC 3,125 % fällig am 17.01.2024	€ 1.000	1.144	0,25	Fannie Mae 4,560 % fällig am 01.08.2036	1	1	0,00	Ripon Mortgages PLC 5,491 % fällig am 28.08.2056	£ 0	0	0,00
Coventry Building Society 2,625 % fällig am 07.12.2026	€ 100	96	0,02	5,036 % fällig am 25.07.2037	5	4	0,00	RMAC Securities PLC 5,134 % fällig am 12.06.2044	190	212	0,05
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025	1.100	1.077	0,24	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.07.2048	469	397	0,09	Shamrock Residential DAC 4,289 % fällig am 24.12.2059	€ 144	€ 143	0,03
Europäische Union 0,700 % fällig am 06.07.2051	1.000	557	0,12	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2053	18.150	15.627	3,47	Stratton Mortgage Funding PLC 5,765 % fällig am 12.03.2052	£ 189	219	0,05
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 2,000 % fällig am 31.08.2026	900	852	0,19	4,500 % fällig am 01.08.2053	16.100	14.195	3,15	5,792 % fällig am 25.09.2051	274	318	0,07
3,250 % fällig am 18.04.2028	1.600	1.573	0,35	5,000 % fällig am 01.08.2053	7.400	6.651	1,48	Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,646 % fällig am 19.07.2035	\$ 11	10	0,00
Hamburg Commercial Bank AG 4,875 % fällig am 17.03.2025	150	150	0,03			36.875	8,19	Thornburg Mortgage Securities Trust 5,790 % fällig am 25.09.2043	18	15	0,00
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 12	1	0,00	<b>US-SCHATZOBBLIGATIONEN</b>				Towd Point Mortgage Funding PLC 6,097 % fällig am 20.05.2045	£ 711	826	0,18
1,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,125 % fällig am 15.07.2024	5.110	4.544	1,01	Tower Bridge Funding PLC 5,629 % fällig am 20.12.2063	174	201	0,05
1,500 % fällig am 01.10.2050	3	0	0,00	0,125 % fällig am 15.01.2032	2.517	2.032	0,45	Tudor Rose Mortgages 5,509 % fällig am 20.06.2048	209	242	0,05
2,000 % fällig am 01.10.2050	16	2	0,00	0,500 % fällig am 15.04.2024	722	646	0,14	Twin Bridges PLC 5,635 % fällig am 01.12.2055	640	739	0,17
Liberty Mutual Group, Inc. 3,625 % fällig am 23.05.2059	€ 1.400	1.333	0,30	0,500 % fällig am 15.01.2028	1.599	1.371	0,31			15.984	3,55
National Bank of Canada 3,500 % fällig am 25.04.2028	100	100	0,02	0,625 % fällig am 15.01.2024	8.711	7.849	1,74	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 0	0	0,00	1,625 % fällig am 15.10.2027	11.879	10.731	2,39	Accunia European CLO DAC 4,107 % fällig am 15.10.2030	€ 102	101	0,02
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00			27.173	6,04	4,127 % fällig am 15.07.2030	497	490	0,11
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Ares European CLO DAC 3,837 % fällig am 15.10.2030	199	195	0,04
2,000 % fällig am 01.10.2050	19	2	0,00	Alba PLC 3,686 % fällig am 15.12.2038	€ 195	186	0,04	Bain Capital Euro CLO DAC 3,940 % fällig am 20.01.2032	199	194	0,04
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	Atlas Funding PLC 5,937 % fällig am 20.01.2061	£ 792	924	0,21	BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	53	51	0,01
1,000 % fällig am 01.10.2053	10	1	0,00	Avon Finance PLC 5,809 % fällig am 20.09.2048	479	558	0,12	Black Diamond CLO DAC 4,060 % fällig am 20.01.2032	418	413	0,09
1,500 % fällig am 01.10.2047	1	0	0,00	Barley Hill PLC 5,824 % fällig am 27.08.2058	101	118	0,03	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 1,050 % fällig am 15.01.2031	99	92	0,02
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 4,633 % fällig am 25.07.2033	\$ 3	3	0,00	4,087 % fällig am 15.01.2033	400	390	0,09
1,500 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	Brants Bridge PLC 0,000 % fällig am 14.06.2066 (a)	£ 2.000	2.319	0,52	BNPP AM Euro CLO DAC 3,827 % fällig am 15.10.2031	246	241	0,05
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	Canada Square Funding PLC 5,316 % fällig am 17.01.2059	1.954	2.264	0,50	Bumper BE NV/S.A. 4,139 % fällig am 23.10.2031	699	701	0,16
2,000 % fällig am 01.10.2050	22	2	0,00	5,682 % fällig am 17.06.2058	234	271	0,06	Cairn CLO DAC 3,957 % fällig am 15.10.2031	600	588	0,13
2,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	Charter Mortgage Funding PLC 5,327 % fällig am 16.01.2057	65	76	0,02	4,051 % fällig am 25.07.2029	157	157	0,03
2,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates 4,260 % fällig am 25.07.2033	\$ 5	4	0,00	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,073 % fällig am 15.11.2031	300	294	0,07
3,500 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	Dilosk RMBS DAC 4,070 % fällig am 20.07.2061	€ 400	400	0,09	Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC 4,148 % fällig am 15.12.2029	830	831	0,18
5,000 % fällig am 01.10.2053	10	1	0,00	4,133 % fällig am 20.02.2060	0	0	0,00	Ginkgo Sales Finance 4,113 % fällig am 25.11.2049	272	272	0,06
Permanent TSB Group Holdings PLC 5,250 % fällig am 30.06.2025	€ 100	99	0,02	Domi BV 4,027 % fällig am 15.04.2054	810	807	0,18	Harvest CLO DAC 3,937 % fällig am 15.07.2031	300	293	0,07
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 0	0	0,00	4,203 % fällig am 15.11.2052	823	823	0,18	Jubilee CLO DAC 4,047 % fällig am 15.01.2030	1.196	1.186	0,26
1,500 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	Dutch Property Finance BV 4,168 % fällig am 28.04.2064	197	198	0,04	Laurelin DAC 3,920 % fällig am 20.10.2031	400	393	0,09
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	4,492 % fällig am 28.04.2050	184	181	0,04	Madison Park Euro Funding DAC 3,927 % fällig am 15.01.2032	400	392	0,09
3,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	Eurohome UK Mortgages PLC 5,137 % fällig am 15.06.2044	£ 121	136	0,03	Man GLG Euro CLO DAC 3,857 % fällig am 15.10.2030	293	288	0,06
SLM Student Loan Trust 4,076 % fällig am 15.12.2033	€ 435	402	0,09	Great Hall Mortgages PLC 3,677 % fällig am 18.03.2039	€ 36	36	0,01	4,047 % fällig am 15.01.2030	440	434	0,10
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,267 % fällig am 18.06.2026	900	805	0,18	5,644 % fällig am 18.06.2039	\$ 15	14	0,00	NovaStar Mortgage Funding Trust 5,855 % fällig am 25.01.2036	\$ 255	231	0,05
3,602 % fällig am 16.02.2026	100	99	0,02	Jubilee Place BV 4,177 % fällig am 17.10.2057	€ 89	89	0,02	Oak Hill European Credit Partners DAC 3,930 % fällig am 20.01.2032	€ 2.909	2.859	0,64
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % fällig am 06.04.2026	1.800	1.778	0,40	Landmark Mortgage Securities PLC 5,222 % fällig am 17.06.2039	£ 171	192	0,04	Palmer Square European Loan Funding DAC 5,025 % fällig am 12.04.2032	286	288	0,06
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	1.200	1.198	0,27	London Wall Mortgage Capital PLC 5,452 % fällig am 15.05.2051	669	775	0,17				
UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S 3,625 % fällig am 15.02.2026	100	98	0,02	Ludgate Funding PLC 4,590 % fällig am 01.01.2061	75	83	0,02				
UniCredit SpA 3,375 % fällig am 31.01.2027	400	395	0,09	5,068 % fällig am 01.12.2060	192	213	0,05				
		14.083	3,13	Newgate Funding PLC 4,126 % fällig am 15.12.2050	€ 675	650	0,15				
<b>INDUSTRIEWERTE</b>											
Nokia Oyj 4,375 % fällig am 21.08.2031	100	99	0,02								

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Revocar UG 4,032 % fällig am 21.04.2036	€ 294	€ 294	0,07	France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.05.2072	€ 8.950	€ 3.526	0,78	2.500 % fällig am 15.08.2046	€ 4.400	€ 4.486	1,00
Silver Arrow Athlon NL BV 4,139 % fällig am 26.04.2031	810	812	0,18	0,750 % fällig am 25.05.2052	28.100	15.324	3,41	4,750 % fällig am 04.07.2040	8.900	11.656	2,59
SLM Student Loan Trust 4,076 % fällig am 15.12.2033	129	119	0,03	0,750 % fällig am 25.05.2053	12.100	6.447	1,43	Slovenia Government International Bond 0,000 % fällig am 12.02.2031	3.500	2.744	0,61
Tikehau CLO DAC 4,144 % fällig am 04.08.2034	400	391	0,09	1,250 % fällig am 25.05.2038	7.700	5.979	1,33	(b)	1.500	7.676	1,71
Toro European CLO DAC 4,133 % fällig am 15.02.2034	400	389	0,09	1,500 % fällig am 25.05.2050	11.300	7.856	1,75	1,500 % fällig am 25.03.2035	9.500	104	0,02
Voya Euro CLO DAC 3,927 % fällig am 15.10.2030	383	379	0,08	1,750 % fällig am 25.05.2066	7.670	5.252	1,17	3,625 % fällig am 11.03.2033	100		
		13.758	3,06	2,000 % fällig am 25.05.2048	8.200	6.486	1,44	Societe Du Grand Paris EPIC 3,500 % fällig am 25.05.2043	1.800	1.754	0,39
				2,500 % fällig am 25.05.2043	20.100	17.896	3,98			332.513	73,90
				3,000 % fällig am 25.05.2054	18.900	17.876	3,97				
				3,250 % fällig am 25.05.2045	24.500	24.585	5,46				
				4,000 % fällig am 25.10.2038	34.500	38.063	8,46				
				4,000 % fällig am 25.04.2055	9.700	11.104	2,47				
				4,000 % fällig am 25.04.2060	20.850	24.218	5,38				
				4,500 % fällig am 25.04.2041	50.150	58.976	13,11				
				Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030							
				(d)	1.186	1.085	0,24				
				1,300 % fällig am 15.05.2028	4.405	4.322	0,96				
				(d)							
				Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2038	13.800	9.273	2,06				
				(b)							
				0,000 % fällig am 15.01.2052	19.500	9.512	2,11				
				(b)							
				2,750 % fällig am 15.01.2047	17.350	17.700	3,93				
				4,000 % fällig am 15.01.2037	4.800	5.456	1,21				
				Region Wallonne Belgium 3,500 % fällig am 15.03.2043	1.400	1.358	0,30				
				Bundesrepublik Deutschland 1,250 % fällig am 15.08.2048	3.500	2.782	0,62				
				2,500 % fällig am 04.07.2044	1.500	1.514	0,34				

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
COM	3,250 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 6.700	Land Berlin 6,250 % fällig am 28.02.2028	€ (6.030)	€ 6.700	€ 6.702	1,49
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	\$ 691	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(646)	633	633	0,14
Summe Pensionsgeschäfte						€ (6.676)	€ 7.333	€ 7.335	1,63

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	113	€ 54	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	23	2	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	64	(33)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	846	488	0,11
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	85	30	0,01
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	201	71	0,02
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	118	61	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	440	271	0,06
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	241	(161)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	8	(2)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	80	(12)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	48	(43)	(0,01)
				€ 726	0,16

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 113,000	21.07.2023	18	€ (12)	€ (18)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					€ 708	0,16

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.12.2028	€ 100	€ 1	0,00

#### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 110	€ 8	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	130	(3)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 147.000	(10)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	1.320.000	(57)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	103.000	(5)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	\$ 800	(206)	(0,05)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	1.000	6	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	1.100	(11)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	2.600	(9)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	3.300	(8)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.07.2023	800	(3)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 21.300	(65)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.09.2043	8.300	101	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	100	0	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	4.800	(11)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2038	34.500	77	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	34.800	139	0,03
Erhalt	CPTFEMU	3,340	15.08.2027	4.500	(12)	0,00
					€ (69)	(0,02)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>€ (68)</b>	<b>(0,02)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420 %	21.09.2023	7.000	€ (37)	€ (27)	(0,01)
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	12.09.2023	7.100	(19)	(8)	0,00
							€ (56)	€ (35)	(0,01)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.



## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens		
BOA	07.2023	€ 1.522	DKK 11.333	€ 0	€ 0	€ 0	0,00		
	08.2023	£ 100	€ 114	0	(2)	(2)	0,00		
BPS	08.2023	\$ 20	CNY 140	0	(1)	(1)	0,00		
	08.2023	CNH 1.127	\$ 164	8	0	8	0,00		
BRC	08.2023	€ 144	£ 123	0	(1)	(1)	0,00		
	08.2023	€ 230	\$ 248	0	(4)	(4)	0,00		
CBK	08.2023	£ 2.417	€ 2.810	0	(1)	(1)	0,00		
	08.2023	\$ 18	CNH 127	0	(1)	(1)	0,00		
JPM	08.2023	24	CNY 165	0	(1)	(1)	0,00		
	08.2023	399	€ 364	0	(1)	(1)	0,00		
MBC	08.2023	¥ 13.200	€ 90	6	0	6	0,00		
	08.2023	\$ 1.219	€ 1.122	7	0	7	0,00		
MYI	09.2023	ILS 52	\$ 15	0	0	0	0,00		
	08.2023	\$ 984	€ 899	0	(1)	(1)	0,00		
RYL	07.2023	DKK 11.425	€ 1.534	0	0	0	0,00		
	08.2023	€ 1.252	£ 1.091	16	0	16	0,00		
SCX	08.2023	1.167	¥ 180.078	0	(20)	(20)	(0,01)		
	08.2023	794	\$ 865	1	(4)	(3)	0,00		
UAG	08.2023	£ 1.549	€ 1.777	0	(24)	(24)	(0,01)		
	08.2023	\$ 15	CNH 102	0	(1)	(1)	0,00		
BRC	08.2023	25	CNY 174	0	(1)	(1)	0,00		
	08.2023	10.655	€ 9.734	1	(13)	(12)	0,00		
MBC	09.2023	ILS 50	\$ 14	1	0	1	0,00		
	08.2023	€ 1.502	¥ 218.734	0	(109)	(109)	(0,02)		
MYI	08.2023	\$ 7.231	€ 6.553	0	(61)	(61)	(0,01)		
	08.2023	€ 943	¥ 148.200	1	0	1	0,00		
RYL	08.2023	£ 86	€ 99	0	(2)	(2)	0,00		
	08.2023	\$ 3.830	€ 3.487	0	(16)	(16)	0,00		
SCX	08.2023	£ 296	€ 340	0	(4)	(4)	0,00		
	08.2023	¥ 88.100	€ 596	36	0	36	0,01		
UAG	08.2023	\$ 600	€ 546	0	(2)	(2)	0,00		
	08.2023	€ 122	£ 105	0	0	0	0,00		
BRC	08.2023	£ 3.391	€ 3.898	0	(46)	(46)	(0,01)		
	08.2023	\$ 68	CNY 463	0	(3)	(3)	0,00		
UAG	08.2023	\$ 68	CNY 463	0	(3)	(3)	0,00		
	09.2023	ILS 43	\$ 12	0	0	0	0,00		
						€ 77	€ (319)	€ (242)	(0,05)
Summe Freiverkehrsfina n zderivate						€	(277)	(0,06)	
Summe Anlagen						€	460.799	102,41	
Sonstige Aktiva und Passiva						€	(10.834)	(2,41)	
Nettovermogen						€	449.965	100,00	

## ERLA UTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Wertpapier per Emissionstermin.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
- Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Hoh e von 6.017 EUR (31. Dezember 2022: 4.192 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfand et.

Barmittel in Hoh e von null EUR (31. Dezember 2022: 190 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gema  den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit fur Finanzderivate verpfand et.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 441.939	€ 4	€ 441.943
Investmentfonds	97	11.063	0	11.160
Pensionsgeschafte	0	7.333	0	7.333
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	612	(249)	0	363
Summen	€ 709	€ 460.086	€ 4	€ 460.799

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 103.959	€ 0	€ 103.959
Investmentfonds	4.940	0	0	4.940
Pensionsgeschäfte	0	1.500	0	1.500
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(7.079)	(7.962)	0	(15.041)
<b>Summen</b>	<b>€ (2.139)</b>	<b>€ 97.497</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 95.358</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (30)	€ 0	€ (30)	€ (20)	€ 0	€ (20)
BPS	(9)	0	(9)	(57)	190	133
BRC	13	0	13	(84)	0	(84)
CBK	(1)	0	(1)	(44)	0	(44)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(46)	0	(46)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(68)	0	(68)
JPM	(44)	0	(44)	(85)	0	(85)
MBC	(170)	0	(170)	3	0	3
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
MYI	(17)	0	(17)	33	0	33
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	27	0	27
RYL	30	0	30	(3)	0	(3)
SCX	(49)	0	(49)	(8)	0	(8)
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	167	0	167
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	5	0	5

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	91,35	87,44
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	6,87	7,03
Investmentfonds	2,48	4,49
Pensionsgeschäfte	1,63	1,36
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,16	(6,40)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,02)	(7,11)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,06)	(0,16)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	3,19	7,89
US-Regierungsbehörden	8,19	5,28
US-Schatzobligationen	6,04	3,51
Non-Agency-MBS	3,55	12,44
Forderungsbesicherte Wertpapiere	3,06	10,28
Staatsemissionen	73,90	53,89
Kurzfristige Instrumente	0,29	1,18
Investmentfonds	2,48	4,49
Pensionsgeschäfte	1,63	1,36
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,16	(6,40)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,09)
Zinsswaps	(0,02)	(7,02)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,33

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	k. A.	(0,04)
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,74)
Devisenterminkontrakte	(0,05)	0,29
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,41)	13,35
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Short-Term Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	€ 1.630	€ 1.629	0,76	Landesbank Baden-Wuerttemberg 2,000 % fällig am 24.02.2025	\$ 1.200	1.038	0,49	SEB S.A. 1,500 % fällig am 31.05.2024	2.000	1.955	0,92
American Tower Corp. 1,375 % fällig am 04.04.2025	1.100	1.043	0,49	LeasePlan Corp. NV 0,125 % fällig am 13.09.2023	€ 600	596	0,28	Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,875 % fällig am 29.05.2026	1.200	1.096	0,51
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 2,500 % fällig am 17.03.2025	1.500	1.410	0,66	Liberty Mutual Finance Europe DAC 1,750 % fällig am 27.03.2024	2.100	2.056	0,96	Thames Water Utilities Finance PLC 4,000 % fällig am 19.06.2025	€ 1.000	1.046	0,49
4,675 % fällig am 15.06.2026	\$ 500	453	0,21	Lloyds Banking Group PLC 2,250 % fällig am 16.10.2024	€ 800	883	0,41			16.876	7,91
AyT Cedula Cajas Fondo de Titulizacion de Activos 3,750 % fällig am 30.06.2025	€ 1.100	1.090	0,51	3,500 % fällig am 01.04.2026	€ 700	685	0,32	<b>VERSORGUNGUNTERNEHMEN</b>			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,875 % fällig am 16.07.2024	2.500	2.459	1,15	Mitsubishi HC Capital UK PLC 0,250 % fällig am 03.02.2025	1.000	938	0,44	CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 0,375 % fällig am 17.10.2023	€ 1.900	1.880	0,88
Banco de Sabadell S.A. 1,625 % fällig am 07.03.2024	1.300	1.278	0,60	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,264 % fällig am 14.06.2025	1.000	980	0,46	National Grid Electricity Distribution PLC 3,625 % fällig am 06.11.2023	€ 1.400	1.617	0,76
Banco Santander S.A. 4,133 % fällig am 21.11.2024	200	200	0,09	3,273 % fällig am 19.09.2025	1.100	1.084	0,51	Wintershall Dea Finance BV 0,452 % fällig am 25.09.2023	€ 1.600	1.586	0,74
Bank of America Corp. 4,412 % fällig am 24.08.2025	2.100	2.108	0,99	National Australia Bank Ltd. 5,507 % fällig am 17.06.2026	€ 600	700	0,33			5.083	2,38
Bank of Ireland Group PLC 0,750 % fällig am 08.07.2024	900	900	0,42	NatWest Group PLC 0,750 % fällig am 15.11.2025	€ 800	758	0,36	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			
Bank of Nova Scotia 3,704 % fällig am 02.05.2025	900	901	0,42	2,000 % fällig am 04.03.2025	700	687	0,32			98.893	46,34
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 5,041 % fällig am 26.01.2025	€ 1.600	1.854	0,87	Nomura Holdings, Inc. 2,648 % fällig am 16.01.2025	\$ 1.500	1.302	0,61	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Barclays PLC 3,125 % fällig am 17.01.2024	500	572	0,27	Realcredit Danmark A/S 2,860 % fällig am 01.07.2023	DKK 5.200	698	0,33	Freddie Mac			
BNG Bank NV 0,050 % fällig am 11.07.2023	€ 1.000	999	0,47	Royal Bank of Canada 3,607 % fällig am 17.01.2025	€ 1.000	1.002	0,47	0,650 % fällig am 27.10.2025			
BNP Paribas S.A. 0,500 % fällig am 15.07.2025	1.200	1.152	0,54	Societe Generale S.A. 1,125 % fällig am 23.01.2025	400	381	0,18	0,800 % fällig am 28.10.2026			
BNZ International Funding Ltd. 0,625 % fällig am 03.07.2025	3.400	3.178	1,48	Standard Chartered PLC 1,214 % fällig am 23.03.2025	\$ 1.500	1.322	0,62	(c)			
CaixaBank S.A. 0,375 % fällig am 03.02.2025	1.500	1.410	0,66	(d)	\$ 1.500	1.322	0,62	<b>US-SCHATZOBBLIGATIONEN</b>			
4,625 % fällig am 16.05.2027	700	694	0,33	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 3,602 % fällig am 16.02.2026	€ 690	681	0,32	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025			
Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos 3,875 % fällig am 23.05.2025	2.800	2.785	1,31	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 2,550 % fällig am 10.03.2025	\$ 200	173	0,08	11.639			
Citigroup, Inc. 6,462 % fällig am 24.05.2025	\$ 1.700	1.565	0,73	3,629 % fällig am 06.04.2026	€ 800	790	0,37	10.211			
Commerzbank AG 3,375 % fällig am 12.12.2025	€ 700	694	0,33	4,800 % fällig am 15.09.2025	\$ 400	360	0,17	4,79			
Commonwealth Bank of Australia 4,928 % fällig am 09.12.2026	\$ 2.600	2.367	1,11	Toronto-Dominion Bank 1,707 % fällig am 28.07.2025	€ 1.600	1.530	0,72	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Credit Suisse AG 4,713 % fällig am 31.05.2024	€ 2.100	2.094	0,98	UBS Group AG 1,000 % fällig am 21.03.2025	1.000	970	0,45	Atlas Funding PLC 5,432 % fällig am 25.07.2025			
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025	700	686	0,32	Van Lanschot Kempen NV 3,500 % fällig am 31.05.2026	300	297	0,14	€ 1.168			
Dell Bank International DAC 1,625 % fällig am 24.06.2024	1.500	1.461	0,69	Wells Fargo & Co. 1,338 % fällig am 04.05.2025	2.170	2.110	0,99	1.360			
Deutsche Bank AG 2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 1.100	1.193	0,56	Westpac Banking Corp. 3,457 % fällig am 04.04.2025	1.000	991	0,46	3.744			
Deutsche Pfandbriefbank AG 5,541 % fällig am 26.04.2024	1.500	1.753	0,82	Yorkshire Building Society 0,125 % fällig am 08.05.2024	2.600	2.515	1,18	3.698			
5,958 % fällig am 29.09.2023	1.000	1.167	0,55			76.934	36,05	1,73			
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 2,875 % fällig am 28.11.2024	€ 1.200	1.181	0,55	<b>INDUSTRIEWERTE</b>							
General Motors Financial Co., Inc. 6,290 % fällig am 17.11.2023	\$ 600	550	0,26	American Medical Systems Europe BV 0,750 % fällig am 08.03.2025	300	284	0,13	Harbour 5,358 % fällig am 28.01.2024			
Hamburg Commercial Bank AG 1,375 % fällig am 27.05.2025	€ 1.500	1.427	0,67	BMW Finance NV 3,609 % fällig am 09.12.2024	700	701	0,33	Hops Hill PLC 5,854 % fällig am 27.05.2024			
6,250 % fällig am 18.11.2024	1.100	1.104	0,52	Burberry Group PLC 1,125 % fällig am 21.09.2025	€ 1.100	1.137	0,53	Kinbane DAC 4,263 % fällig am 25.09.2026			
Hana Bank 3,750 % fällig am 04.05.2026	1.400	1.386	0,65	Bureau Veritas S.A. 1,250 % fällig am 07.09.2023	€ 2.100	2.089	0,98	€ 1.272			
HSBC Holdings PLC 6,500 % fällig am 20.05.2024	€ 300	349	0,16	Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	700	624	0,29	€ 620			
ING Bank Australia Ltd. 4,700 % fällig am 08.12.2025	AUD 2.400	1.448	0,68	Coloplast Finance BV 4,138 % fällig am 19.05.2024	1.800	1.807	0,85	€ 724			
4,728 % fällig am 26.05.2025	1.200	733	0,34	Fortum Oyj 1,625 % fällig am 27.02.2026	1.200	1.123	0,53	€ 549			
ING Groep NV 0,100 % fällig am 03.09.2025	€ 1.200	1.140	0,53	Heathrow Funding Ltd. 1,500 % fällig am 12.10.2027	1.200	1.129	0,53	€ 627			
0,125 % fällig am 29.11.2025	300	282	0,13	InterContinental Hotels Group PLC 1,625 % fällig am 08.10.2024	1.200	1.160	0,54	€ 1.159			
JAB Holdings BV 1,750 % fällig am 25.06.2026	1.200	1.117	0,52	Koninklijke Philips NV 0,500 % fällig am 22.05.2026	700	633	0,30	€ 1.353			
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,875 % fällig am 29.05.2026	€ 600	592	0,28	Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	900	896	0,42	€ 45			
				Ryanair DAC 1,125 % fällig am 15.08.2023	€ 1.200	1.196	0,56	€ 70			

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Stratton Mortgage Funding PLC	£ 2.636	€ 3.072	1,44	CVC Cordatus Loan Fund DAC	€ 556	€ 547	0,26	Development Bank of Japan, Inc.	€ 2.600	€ 2.470	1,16
5,391 % fällig am 20.07.2060	341	396	0,19	3,855 % fällig am 21.07.2030				0,010 % fällig am 15.10.2024	€ 300	€ 339	0,16
5,565 % fällig am 12.12.2043	2.257	2.624	1,23	Euro-Galaxy CLO DAC	591	581	0,27	4,500 % fällig am 06.06.2025	€ 1.500	€ 1.402	0,66
5,792 % fällig am 25.09.2051				3,765 % fällig am 11.04.2031	1.000	974	0,46	Korea Housing Finance Corp.	€ 2.000	€ 1.884	0,88
Towd Point Mortgage Funding PLC				3,831 % fällig am 24.04.2034				0,010 % fällig am 05.02.2025	500	500	0,23
5,161 % fällig am 20.10.2051	1.700	1.961	0,92	Ginkgo Auto Loans	500	502	0,24	0,723 % fällig am 22.03.2025			
5,635 % fällig am 20.10.2051	1.128	1.316	0,62	4,113 % fällig am 25.07.2043	726	726	0,34	Luxembourg Government International Bond			
5,841 % fällig am 20.07.2045	646	754	0,35	Ginkgo Sales Finance	4,113 % fällig am 25.11.2049			2,125 % fällig am 10.07.2023			
6,097 % fällig am 20.05.2045	427	496	0,23	Harvest CLO DAC	931	915	0,43	Poland Government International Bond			
6,216 % fällig am 20.02.2045	2.391	2.781	1,30	3,907 % fällig am 15.01.2031	1.418	1.389	0,65	0,000 % fällig am 07.07.2023			
6,546 % fällig am 20.02.2054	1.629	1.899	0,89	4,250 % fällig am 26.06.2030				(a)	1.300	1.299	0,61
Tudor Rose Mortgages				Jubilee CLO DAC	100	98	0,05	South Korea Government International Bond	900	885	0,42
5,509 % fällig am 20.06.2048	1.621	1.878	0,88	3,787 % fällig am 15.04.2030				Svensk Exportkredit AB			
		39.331	18,43	Man GLG Euro CLO DAC	769	755	0,35	3,250 % fällig am 13.04.2026	650	643	0,30
				3,857 % fällig am 15.10.2030	176	174	0,08	Tokyo Metropolitan Government	200	181	0,08
				4,047 % fällig am 15.01.2030				4,625 % fällig am 01.06.2026	\$	10.327	4,84
				Oak Hill European Credit Partners Ltd.	115	115	0,05				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				OCP Euro CLO DAC	790	779	0,37				
Accunia European CLO DAC				3,997 % fällig am 15.01.2032				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
4,070 % fällig am 20.01.2031	€ 3.092	3.032	1,42	OZLME DAC	1.559	1.529	0,72	<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
4,107 % fällig am 15.10.2030	255	253	0,12	4,162 % fällig am 24.08.2030				SGS Nederland Holding BV	€ 700	699	0,33
Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-One BV				Palmer Square European Loan Funding DAC	563	552	0,26	3,660 % fällig am 10.07.2023			
4,072 % fällig am 21.09.2031	600	602	0,28	3,897 % fällig am 15.10.2031	788	769	0,36	Universal Music Group NV	500	499	0,23
Autonoria FCT				3,907 % fällig am 15.07.2031	244	239	0,11	3,691 % fällig am 24.07.2023			
3,883 % fällig am 26.01.2043	800	801	0,38	3,957 % fällig am 15.04.2031						1.198	0,56
Avoca CLO DAC				Revocar UG	783	785	0,37				
3,885 % fällig am 12.01.2031	1.860	1.827	0,86	4,032 % fällig am 21.04.2036				<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
4,067 % fällig am 15.04.2033	1.730	1.689	0,79	Silver Arrow S.A.	643	644	0,30	(0,197) % fällig am			
Bavarian Sky S.A.				3,768 % fällig am 15.02.2030	460	451	0,21	31.07.2023 (a)(b)	¥ 635.000	4.027	1,89
3,765 % fällig am 20.03.2030	732	733	0,34	Toro European CLO DAC	1.048	1.033	0,48	(0,183) % fällig am			
Bavarian Sky UK PLC				3,917 % fällig am 15.10.2030				10.07.2023 (a)(b)	740.000	4.693	2,20
5,407 % fällig am 20.04.2031	£ 700	818	0,38	Willow Park CLO DAC		26.183	12,27	(0,178) % fällig am	265.000	1.681	0,79
Black Diamond CLO DAC				4,017 % fällig am 15.01.2031				31.07.2023 (a)(b)		10.401	4,88
4,060 % fällig am 20.01.2032	€ 167	165	0,08							11.599	5,44
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC								Summe kurzfristige Instrumente			
3,827 % fällig am 15.07.2030	653	642	0,30							€ 199.083	93,30
BNPP AM Euro CLO DAC								Summe Übertragbare Wertpapiere			
3,777 % fällig am 15.04.2031	200	196	0,09								
Cairn CLO DAC											
3,842 % fällig am 30.04.2031	986	966	0,45								
Cars Alliance Auto Loans Germany											
3,860 % fällig am 18.03.2035	900	902	0,42								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
COM	3,250 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 9.400	Brandenburg 0,010 % fällig am 27.04.2027	€ (9.724)	€ 9.400	€ 9.403	4,41
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	\$ 143	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(134)	131	131	0,06
Summe Pensionsgeschäfte						€ (9.858)	€ 9.531	€ 9.534	4,47

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM REGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	521	€ 869	0,41
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	496	409	0,19
				€ 1.278	0,60
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 1.278	0,60

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Short-Term Fund (Forts.)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 1.000	€ 4	0,00

#### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		3,000 %	20.09.2028	€ 40.200	€ 60	0,03
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		3,500	20.09.2025	25.000	20	0,01
						€ 80	0,04
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						€ 84	0,04

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### DEWISENTERMINIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2023	€ 242	\$ 264	€ 0	€ 0	€ 0	0,00		
	07.2023	\$ 105	€ 97	1	0	1	0,00		
	08.2023	AUD 3.582	2.199	16	0	16	0,01		
BPS	07.2023	€ 26.418	\$ 28.934	110	(7)	103	0,05		
	07.2023	\$ 489	€ 453	5	0	5	0,00		
	08.2023	27.887	25.416	0	(110)	(110)	(0,05)		
BRC	07.2023	€ 1.864	£ 1.603	5	(1)	4	0,00		
	07.2023	£ 6.407	€ 7.419	0	(47)	(47)	(0,02)		
	08.2023	¥ 8.000	55	4	0	4	0,00		
CBK	09.2023	ILS 21	\$ 6	0	0	0	0,00		
	07.2023	€ 1.766	£ 1.511	0	(5)	(5)	0,00		
	07.2023	305	261	0	(1)	(1)	0,00		
JPM	07.2023	1.210	\$ 1.299	0	(20)	(20)	(0,01)		
	08.2023	178	¥ 25.915	0	(13)	(13)	(0,01)		
	09.2023	ILS 20	\$ 6	0	0	0	0,00		
MBC	07.2023	€ 45.426	£ 39.222	278	0	278	0,13		
	07.2023	£ 20.146	€ 23.249	0	(226)	(226)	(0,11)		
	07.2023	¥ 1.200.000	8.247	614	0	614	0,30		
MYI	08.2023	€ 1.004	¥ 146.175	0	(72)	(72)	(0,03)		
	08.2023	£ 38.910	€ 45.010	0	(274)	(274)	(0,13)		
	07.2023	€ 383	\$ 419	1	0	1	0,00		
RYL	07.2023	\$ 491	€ 459	9	0	9	0,00		
	07.2023	DKK 5.200	698	0	(1)	(1)	0,00		
	07.2023	\$ 29.307	27.244	381	0	381	0,18		
UAG	07.2023	€ 2.039	¥ 300.000	0	(131)	(131)	(0,06)		
	07.2023	£ 16.260	€ 18.694	0	(254)	(254)	(0,12)		
	07.2023	¥ 740.000	5.192	496	0	496	0,23		
						€ 1.920	€ (1.162)	€ 758	0,36
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ 758	0,36		
Summe Anlagen						€ 210.734	98,77		
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 2.625	1,23		
Nettovermögen						€ 213.359	100,00		

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Nullkuponwertpapier.  
 (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
 (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
 (d) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,48 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Standard Chartered PLC	1,214 %	23.03.2025	21.10.2022 - 24.10.2022	\$ 1.434	\$ 1.322	0,62

Barmittel in Höhe von 4.603 EUR (31. Dezember 2022: 6.376 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 10 EUR (31. Dezember 2022: 20 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 199.083	€ 0	€ 199.083
Pensionsgeschäfte	0	9.531	0	9.531
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.278	842	0	2.120
Summen	€ 1.278	€ 209.456	€ 0	€ 210.734

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 330.698	€ 0	€ 330.698
Pensionsgeschäfte	0	14.100	0	14.100
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2.474	623	0	3.097
Summen	€ 2.474	€ 345.421	€ 0	€ 347.895

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ 17	€ 0	€ 17	€ 57	€ 0	€ 57
BPS	(2)	0	(2)	(9)	0	(9)
BRC	(39)	0	(39)	(9)	0	(9)
CBK	(5)	0	(5)	77	0	77
JPM	(34)	10	(24)	31	0	31
MBC	320	(510)	(190)	371	(230)	141
MYI	10	0	10	(25)	0	(25)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(190)	20	(170)
RYL	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	1.972	(1.890)	82
SOG	381	(430)	(49)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	111	0	111	(51)	0	(51)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,45	82,88
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	5,85	10,78
Pensionsgeschäfte	4,47	3,99
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,60	0,70
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,04	(0,45)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,36	0,63



Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	46,34	56,35
US-Regierungsbehörden	1,19	1,90
US-Schatzobligationen	4,79	k. A.
Non-Agency-MBS	18,43	14,24
Forderungsbesicherte Wertpapiere	12,27	6,88
Staatsemissionen	4,84	3,88
Kurzfristige Instrumente	5,44	10,41
Pensionsgeschäfte	4,47	3,99
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,60	0,70
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen –		
Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,04	(0,45)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	0,36	0,63
Sonstige Aktiva und Passiva	1,23	1,47
Nettovermögen	100,00	100,00



# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO European High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>SCHWEDEN</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>			
Summer BC Holdco SARL 5,750 % fällig am 31.10.2026	€ 1.850	€ 1.650	0,73	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£ 4.000	€ 3.679	1,64
Telecom Italia Capital S.A. 6,375 % fällig am 15.11.2033	\$ 500	389	0,17	Akelius Residential Property AB 2,245 % fällig am 17.05.2081	€ 1.200	€ 990	0,44	Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % fällig am 31.01.2031	€ 700	577	0,26
Trafigura Funding S.A. 3,875 % fällig am 02.02.2026	€ 700	660	0,29	Dometic Group AB 2,000 % fällig am 29.09.2028	900	729	0,33	4,000 % fällig am 31.01.2029	£ 1.400	1.300	0,58
		15.665	6,97	3,000 % fällig am 08.05.2026	500	469	0,21	4,250 % fällig am 31.01.2031	\$ 200	148	0,07
Summe Luxemburg		15.694	6,99	Intrum AB 4,875 % fällig am 15.08.2025	900	748	0,33	Zenith Finco PLC 6,500 % fällig am 30.06.2027	£ 800	712	0,32
				9,250 % fällig am 15.03.2028 (h)	1.200	1.018	0,45			34.976	15,57
<b>MULTINATIONAL</b>				Verisure Holding AB 3,250 % fällig am 15.02.2027	1.500	1.336	0,60	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,875 % fällig am 15.07.2026	200	188	0,08	Lorca Holdco Ltd. 7,522 % fällig am 17.09.2027	€ 2.300	2.229	0,99
Clarios Global LP 4,375 % fällig am 15.05.2026	900	861	0,38	Verisure Midholding AB 5,250 % fällig am 15.02.2029	600	522	0,23	Summe Großbritannien		37.205	16,56
<b>NIEDERLANDE</b>				Volvo Car AB 4,250 % fällig am 31.05.2028	700	674	0,30	<b>USA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Schweden		6.674	2,97	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	1.400	1.248	0,56	<b>SCHWEIZ</b>				American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % fällig am 01.11.2028	\$ 871	716	0,32
Dufry One BV 2,000 % fällig am 15.02.2027	1.200	1.050	0,47	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,700 % fällig am 01.04.2028	1.762	1.454	0,65
3,625 % fällig am 15.04.2026	CHF 1.500	1.478	0,66	UBS Group AG 6,442 % fällig am 11.08.2028	\$ 650	598	0,27	Avantor Funding, Inc. 3,875 % fällig am 15.07.2028	€ 900	827	0,37
Energizer Gamma Acquisition BV 3,500 % fällig am 30.06.2029	€ 900	728	0,32	9,016 % fällig am 15.11.2033	600	660	0,29	Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % fällig am 01.07.2031	\$ 300	274	0,12
IPD 3 BV 8,000 % fällig am 15.06.2028	1.100	1.125	0,50	Summe Schweiz		1.258	0,56	Chemours Co. 4,000 % fällig am 15.05.2026	€ 1.400	1.303	0,58
OI European Group BV 6,250 % fällig am 15.05.2028	1.000	1.024	0,46	<b>GROSSBRITANNIEN</b>				Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026	2.100	2.041	0,91
Q-Park Holding BV 3,500 % fällig am 01.02.2025	1.100	1.030	0,46	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Credit Suisse AG AT1 Claim ^	\$ 800	29	0,01
Sigma Holdco BV 5,750 % fällig am 15.05.2026	500	435	0,19	BGP Modular Services Finance PLC 4,750 % fällig am 30.11.2028	€ 1.800	1.539	0,68	Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % fällig am 17.06.2031	3.400	2.558	1,14
Summer BidCo BV (9,000 % bar oder 9,750 % PIK) 9,000 % fällig am 15.11.2025 (b)	242	216	0,10	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	€ 2.800	2.739	1,22	Gap, Inc. 3,875 % fällig am 01.10.2031	800	503	0,22
Telefonica Europe BV 7,125 % fällig am 23.08.2028 (e)	400	410	0,18	Burford Capital PLC 5,000 % fällig am 01.12.2026	1.300	1.383	0,61	Graphic Packaging International LLC 6,250 % fällig am 01.02.2029	€ 200	176	0,08
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % fällig am 31.03.2027	4.100	3.500	1,56	Gatwick Airport Finance PLC 4,375 % fällig am 07.04.2026	1.800	1.913	0,85	IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.03.2029	800	685	0,30
3,750 % fällig am 09.05.2027	100	91	0,04	Harbour Energy PLC 5,500 % fällig am 15.10.2026	\$ 1.000	844	0,38	Kronos International, Inc. 3,750 % fällig am 15.09.2025	1.400	1.281	0,57
7,375 % fällig am 15.09.2029	1.100	1.123	0,50	Heathrow Finance PLC 3,875 % fällig am 01.03.2027	€ 400	399	0,18	Olympus Water U.S. Holding Corp. 3,875 % fällig am 01.10.2028	1.700	1.346	0,60
United Group BV 3,625 % fällig am 15.02.2028	800	637	0,28	4,125 % fällig am 01.09.2029	1.114	1.054	0,47	Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028	1.800	1.567	0,70
4,000 % fällig am 15.11.2027	1.100	905	0,40	Iceland Bondco PLC 4,375 % fällig am 15.05.2028	100	92	0,04	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	\$ 1.372	1.265	0,56
ZF Europe Finance BV 2,000 % fällig am 23.02.2026	500	456	0,20	INEOS Finance PLC 2,125 % fällig am 15.11.2025	€ 500	470	0,21	SCIL LLC 9,500 % fällig am 15.07.2028 (a)	€ 600	600	0,27
		15.456	6,88	2,875 % fällig am 01.05.2026	500	460	0,20	Spectrum Brands, Inc. 4,000 % fällig am 01.10.2026	2.400	2.310	1,03
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				INEOS Quattro Finance PLC 2,500 % fällig am 15.01.2026	2.400	2.156	0,96	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	2.700	2.405	1,07
Nouryon Finance BV 6,478 % fällig am 03.04.2028	944	929	0,41	Jaguar Land Rover Automotive PLC 4,500 % fällig am 15.01.2026	900	855	0,38	Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	\$ 900	839	0,37
Summe Niederlande		16.385	7,29	4,500 % fällig am 15.07.2028	300	263	0,12	8,375 % fällig am 01.06.2031	900	833	0,37
<b>PANAMA</b>				6,875 % fällig am 15.11.2026	500	498	0,22	WMG Acquisition Corp. 2,250 % fällig am 15.08.2031	€ 1.400	1.115	0,50
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034	€ 240	174	0,08	Summe USA		24.127	10,74
Carnival Corp. 10,125 % fällig am 01.02.2026	1.800	1.895	0,84	6,125 % fällig am 21.01.2025	300	337	0,15	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
<b>SPANIEN</b>				Lloyds Banking Group PLC 7,500 % fällig am 27.09.2025 (e)(g)	\$ 600	516	0,23	<b>EUROPEAN STABILITY MECHANISM TREASURY BILLS</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 1.200	969	0,43	3,052 % fällig am 18.08.2023 (c)(d)	680	677	0,30
Aedas Homes Opco SLU 4,000 % fällig am 15.08.2026	700	653	0,29	5,500 % fällig am 04.11.2027	€ 800	728	0,32	3,070 % fällig am 18.08.2023 (c)(d)	1.810	1.803	0,81
Banco Santander S.A. 4,375 % fällig am 14.01.2026 (e)(g)	800	672	0,30	Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	1.300	1.367	0,61	3,337 % fällig am 07.09.2023 (c)(d)	250	249	0,11
Cellnex Finance Co. S.A. 1,500 % fällig am 08.06.2028	700	599	0,27	PEU Fin PLC 7,250 % fällig am 01.07.2028	€ 900	902	0,40			2.729	1,22
2,000 % fällig am 15.09.2032	1.300	1.026	0,46	Pinnacle Bidco PLC 5,500 % fällig am 15.02.2025	500	482	0,21	<b>EUROPEAN UNION TREASURY BILLS</b>			
Cellnex Telecom S.A. 1,750 % fällig am 23.10.2030	200	162	0,07	6,375 % fällig am 15.02.2025	€ 2.800	3.116	1,39	3,172 % fällig am 04.08.2023 (c)(d)	150	150	0,07
Grifols Escrow Issuer S.A. 3,875 % fällig am 15.10.2028	1.400	1.202	0,54	Rolls-Royce PLC 3,375 % fällig am 18.06.2026	1.580	1.628	0,72	3,173 % fällig am 04.08.2023 (c)(d)	250	249	0,11
Grifols S.A. 2,250 % fällig am 15.11.2027	300	272	0,12	4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 2.600	2.562	1,14	3,179 % fällig am 04.08.2023 (c)(d)	200	199	0,09
3,200 % fällig am 01.05.2025	1.300	1.268	0,56	Thames Water Kemble Finance PLC 4,625 % fällig am 19.05.2026	€ 800	485	0,22	3,326 % fällig am 08.09.2023 (c)(d)	150	149	0,06
Summe Spanien		5.854	2,61	Travis Perkins PLC 3,750 % fällig am 17.02.2026	600	629	0,28			747	0,33

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERM- ÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERM- ÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERM- ÖGENS	% DES
<b>FRANCE TREASURY BILLS</b>					<b>GERMANY TREASURY BILLS</b>					<b>INVESTMENTFONDS BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>				
3,094 % fällig am 19.07.2023 (c)(d)	€ 5.150	€ 5.142	2,29		3,143 % fällig am 19.07.2023 (c)(d)	€ 4.950	€ 4.942	2,20		PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	120.900	€1.682	5,20	
3,096 % fällig am 19.07.2023 (c)(d)	1.870	1.867	0,83		Summe kurzfristige Instrumente		16.375	7,29		Summe Investmentfonds		€ 11.682	5,20	
3,127 % fällig am 02.08.2023 (c)(d)	500	499	0,22											
3,135 % fällig am 02.08.2023 (c)(d)	450	449	0,20		Summe Übertragbare Wertpapiere		€ 203.864	90,74						
		7.957	3,54											

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettvermögens
BPS	3,100 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 3.200	Europäische Union 3,250 % fällig am 04.07.2034	€ (3.250)	€ 3.200	€ 3.201	1,42
Summe Pensionsgeschäfte						€ (3.250)	€ 3.200	€ 3.201	1,42

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	146	€ (202)	(0,09)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	11	14	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1	(2)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	372	(327)	(0,15)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	58	124	0,06
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	57	93	0,04
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	27	34	0,01
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	6	6	0,00
				€ (260)	(0,12)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (260)	(0,12)

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.12.2027	€ 100	€ 11	0,01
United Group BV	5,000	20.12.2027	700	82	0,03
				€ 93	0,04

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000 %	20.06.2028	€ 25.900	€ 396	0,18

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	20.09.2028	£ 1.500	€ 102	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	\$ 6.800	(89)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2025	3.800	408	0,18
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	3.000	508	0,23
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	800	26	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	6.800	90	0,04
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 200	(4)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	1.500	(30)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	3.300	(19)	(0,01)
					€ 992	0,44
					€ 1.481	0,66

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO European High Yield Bond Fund (Forts.)

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018 %	20.10.2023	1.300	€ (8)	€ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	1.300	(8)	(24)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	1.300	(9)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	1.300	(9)	(23)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	1.300	(8)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	1.300	(8)	(23)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	1.300	(8)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	1.300	(8)	(22)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	1.300	(8)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	1.300	(8)	(25)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	1.300	(9)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	1.300	(8)	(26)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	400	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	400	(3)	(7)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	100	(1)	(2)	0,00
							€ (107)	€ (152)	(0,07)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Deutsche Bank AG	1,000 %	20.06.2027	€ 600	€ (81)	€ 47	€ (34)	(0,01)
GST	EP Infrastructure A/S	5,000	20.06.2028	600	(12)	22	10	0,00
					€ (93)	€ 69	€ (24)	(0,01)

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2023	CHF	1.347	€ 1.392	€ 12	€ 0	12	0,01
	07.2023	€	270	\$ 293	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	£	289	€ 336	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07.2023	\$	146	\$ 133	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	€	17.259	\$ 18.911	74	0	74	0,03
	07.2023	\$	150	€ 140	3	0	3	0,00
BRC	08.2023		18.937	17.259	0	(75)	(75)	(0,03)
	07.2023	£	3.346	3.874	0	(25)	(25)	(0,01)
MBC	07.2023	€	27.636	£ 23.862	170	0	170	0,08
	07.2023	£	11.075	€ 12.781	0	(125)	(125)	(0,06)
MYI	08.2023		23.890	27.636	0	(167)	(167)	(0,07)
	07.2023		318	368	0	(2)	(2)	0,00
SOG	07.2023	\$	570	533	11	0	11	0,00
	07.2023		17.988	16.722	234	0	234	0,10
UAG	07.2023	€	1.392	CHF 1.362	4	0	4	0,00
	07.2023	£	8.939	€ 10.277	0	(140)	(140)	(0,06)
	08.2023	CHF	1.360	1.392	0	(4)	(4)	0,00
					€ 508	€ (541)	€ (33)	(0,01)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ (209)	(0,09)	
Summe Anlagen						€ 219.758	97,81	
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 4.915	2,19	
Nettovermögen						€ 224.673	100,00	

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 786 EUR (31. Dezember 2022: null EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.816 EUR (31. Dezember 2022: 2.986 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 190 EUR (31. Dezember 2022: null EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 203.379	€ 485	€ 203.864
Investmentfonds	0	11.682	0	11.682
Pensionsgeschäfte	0	3.200	0	3.200
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(511)	1.523	0	1.012
<b>Summen</b>	<b>€ (511)</b>	<b>€ 219.784</b>	<b>€ 485</b>	<b>€ 219.758</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 157.222	€ 0	€ 157.222
Investmentfonds	8.700	0	0	8.700
Pensionsgeschäfte	0	3.700	0	3.700
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(769)	1.671	0	902
<b>Summen</b>	<b>€ 7.931</b>	<b>€ 162.593</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 170.524</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
MYI	1,750 %	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (191)	€ (191)	(0,08)
	2,200	31.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(644)	(646)	(0,29)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>€ (837)</b>	<b>(0,37)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ 9	€ 0	€ 9	€ (11)	€ 0	€ (11)
BPS	(32)	50	18	(22)	0	(22)
BRC	(25)	0	(25)	80	0	80
CBK	k. A.	k. A.	k. A.	19	0	19
GLM	(152)	0	(152)	(198)	0	(198)
GST	10	0	10	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	(122)	0	(122)	230	0	230
MYI	9	0	9	(8)	0	(8)
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	207	0	207
SOG	234	(270)	(36)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(140)	140	0	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	83,73	80,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	7,00	8,16
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	1,26
Investmentfonds	5,20	5,00
Pensionsgeschäfte	1,42	2,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,12)	(0,40)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,66	0,74
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,09)	0,17
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,37)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Belgien	0,35	k. A.
Cayman-Inseln	0,01	0,02
China	0,00	0,01
Tschechische Republik	1,07	1,23
Dänemark	k. A.	1,34
Finnland	0,58	k. A.
Frankreich	13,31	12,16
Deutschland	9,53	6,94
Irland	0,78	1,03
Insel Man	k. A.	1,03
Italien	7,42	8,16
Japan	0,71	0,97
Jersey, Kanalinseln	0,75	1,28
Luxemburg	6,99	8,62
Multinational	0,38	0,53
Niederlande	7,29	6,59
Panama	0,84	0,74
Spanien	2,61	2,40
Schweden	2,97	4,04
Schweiz	0,56	0,90
Großbritannien	16,56	12,74
USA	10,74	8,45
Kurzfristige Instrumente	7,29	11,10
Investmentfonds	5,20	5,00
Pensionsgeschäfte	1,42	2,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,12)	(0,40)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,18	0,17
Zinsswaps	0,44	0,57
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,07)	(0,12)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,02)
Devisenterminkontrakte	(0,01)	0,31
Sonstige Aktiva und Passiva	2,19	2,09
Nettovermögen	100,00	100,00





# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Towd Point Mortgage Funding PLC	£ 500	€ 577	0,39	Bumper UK Finance PLC	£ 193	225	0,15	Silver Arrow S.A.			
5,161 % fällig am 20.10.2051				5,281 % fällig am 20.12.2030				4,028 % fällig am 15.02.2027	21	21	0,01
5,841 % fällig am 20.07.2045	294	343	0,23	Carlyle Euro CLO DAC				Tikehau CLO DAC			
6,097 % fällig am 20.05.2045	640	744	0,50	3,877 % fällig am 15.01.2031	€ 398	390	0,26	4,144 % fällig am 04.08.2034	600	586	0,40
6,546 % fällig am 20.02.2054	562	655	0,44	3,953 % fällig am 15.08.2030	453	443	0,30	Toro European CLO DAC			
				4,213 % fällig am 15.08.2032	800	782	0,53	3,995 % fällig am 12.01.2032	1.200	1.177	0,80
Tower Bridge Funding PLC	719	833	0,56	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				4,133 % fällig am 15.02.2034	1.000	973	0,66
5,527 % fällig am 20.11.2063				3,991 % fällig am 25.01.2032	799	782	0,53	Turbo Finance PLC			
Trinity Square PLC	765	890	0,60	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.	1.100	1.079	0,73	5,617 % fällig am 20.08.2028	£ 83	97	0,07
5,316 % fällig am 15.07.2059				4,073 % fällig am 15.11.2031	215	216	0,15	Voya Euro CLO DAC	€ 288	284	0,19
Tudor Rose Mortgages	261	303	0,21	Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC				3,927 % fällig am 15.10.2030			
5,509 % fällig am 20.06.2048				4,148 % fällig am 15.12.2029							
Twin Bridges PLC	471	550	0,37	Compartment VCL	321	322	0,22				
6,115 % fällig am 12.12.2054				4,072 % fällig am 21.01.2028							
		27.933	18,89	Contego CLO DAC	499	489	0,33				
				3,851 % fällig am 23.01.2030							
				CVC Cordatus Loan Fund DAC	1.800	1.766	1,19				
				3,827 % fällig am 15.10.2031	300	294	0,20				
				4,156 % fällig am 15.09.2031							
				Dryden Euro CLO DAC	400	391	0,26				
				3,837 % fällig am 15.04.2033							
				FCT Pulse France	400	401	0,27				
				4,163 % fällig am 25.01.2035							
				Harvest CLO DAC	400	365	0,25				
				1,040 % fällig am 15.07.2031	600	586	0,40				
				3,817 % fällig am 15.10.2031	1.800	1.763	1,19				
				3,880 % fällig am 20.10.2031	700	683	0,46				
				3,937 % fällig am 15.07.2031	1.200	1.174	0,79				
				4,027 % fällig am 15.01.2032	620	608	0,41				
				4,250 % fällig am 26.06.2030							
				Man GLG Euro CLO DAC	293	288	0,19				
				3,857 % fällig am 15.10.2030	599	584	0,39				
				3,987 % fällig am 15.10.2032							
				Palmer Square European Loan Funding DAC	1.032	1.011	0,68				
				3,897 % fällig am 15.10.2031	875	855	0,58				
				3,907 % fällig am 15.07.2031	1.223	1.205	0,82				
				4,227 % fällig am 15.10.2031							
				PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment	366	366	0,25				
				4,139 % fällig am 26.11.2030							
				Red & Black Auto Lease France	400	400	0,27				
				4,093 % fällig am 27.06.2035							
				Sculptor European CLO DAC	700	688	0,47				
				3,916 % fällig am 14.01.2032							
				Segovia European CLO DAC	176	173	0,12				
				3,945 % fällig am 18.01.2031	800	780	0,53				
				4,080 % fällig am 20.07.2032							
				Silver Arrow Merfina SRL	€ 463	€ 464	0,31				
				4,055 % fällig am 20.07.2033							

STAATSEMISSIONEN			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	857	840	0,57
1,300 % fällig am 15.05.2028 (b)	10.425	10.323	6,98
1,400 % fällig am 26.05.2025 (b)			
Bundesrepublik Deutschland	300	369	0,25
4,250 % fällig am 04.07.2039			
Slovenia Government International Bond	1.300	735	0,50
1,175 % fällig am 13.02.2062			
South Korea Government International Bond	500	461	0,31
0,000 % fällig am 16.09.2025 (a)			
Spain Government International Bond	912	832	0,56
2,350 % fällig am 30.07.2033	590	595	0,40
3,550 % fällig am 31.10.2033			
United Kingdom Gilt	£ 1.100	632	0,43
0,875 % fällig am 31.01.2046			
		14.787	10,00

AKTIEN			
VORZUGSWERTPAPIERE			
Nationwide Building Society	3.504	470	0,32
10,250 %			
Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 145.291	98,25	

INVESTMENTFONDS			
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)	122.900	11.875	8,03
Summe Investmentfonds	€ 11.875	8,03	

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 322	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	€ (301)	€ 295	€ 295	0,20
Summe Pensionsgeschäfte						€ (301)	€ 295	€ 295	0,20

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	332	€ (503)	(0,34)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	5	(5)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	167	183	0,12
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	18	(37)	(0,03)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	22	(2)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	196	(114)	(0,08)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	64	(167)	(0,11)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	183	329	0,22
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	151	(243)	(0,16)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	160	€ 178	0,12
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	20	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	3	(1)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	8	8	0,01
				€ (373)	(0,25)

**VERKAUFSOPTIONEN****OPTIONEN AUF BÖRSENGEHADELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 113,000	21.07.2023	26	€ (17)	€ (27)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					€ (400)	(0,27)

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 37 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2027	€ 3.800	€ (238)	(0,16)
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	(1,000)	20.06.2028	16.800	(153)	(0,10)
				€ (391)	(0,26)

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	\$ 1.800	€ 17	0,01

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 900	€ 73	0,05
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 888.000	(65)	(0,04)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	312.000	(14)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	\$ 1.800	(463)	(0,31)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	2.700	57	0,04
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	5.000	(81)	(0,06)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	3.300	(14)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	7.500	(64)	(0,04)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	11.300	62	0,04
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.07.2023	1.800	(6)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 800	(33)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,819	19.12.2034	6.800	(509)	(0,34)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,854	19.12.2039	3.300	(443)	(0,30)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,700	15.03.2073	300	34	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	5.400	(21)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	700	(14)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,804	19.05.2033	2.700	37	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	7.700	(27)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	17.500	(2)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	43.600	(22)	(0,02)
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	700	(130)	(0,09)
Zahlung	CPTFEMU	3,520	15.09.2024	300	(3)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,720	15.09.2024	700	(4)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,850	15.09.2024	500	(3)	0,00
					€ (1.655)	(1,12)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ (2.029)	(1,37)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

- (2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	9.900	€ (26)	€ (11)	(0,01)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420	21.09.2023	9.300	(48)	(36)	(0,02)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,008	17.12.2029	5.500	(342)	(141)	(0,09)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,008	17.12.2029	10.900	(352)	(157)	(0,11)
							€ (768)	€ (345)	(0,23)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	DKK 18.593	€ 2.497	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	07.2023	£ 105	123	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 936	868	10	0	10	0,01
BPS	07.2023	€ 21.116	\$ 23.142	97	(2)	95	0,06
	08.2023	\$ 195	CNH 1.344	0	(8)	(8)	(0,01)
	08.2023	20.621	€ 18.793	0	(82)	(82)	(0,05)
BRC	07.2023	€ 6.035	DKK 44.940	0	0	0	0,00
	07.2023	215	£ 184	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	£ 3.591	€ 4.158	0	(26)	(26)	(0,02)
CBK	08.2023	DKK 44.928	6.035	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	€ 1.797	DKK 13.385	1	0	1	0,00
	07.2023	446	£ 381	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07.2023	948	\$ 1.017	0	(16)	(16)	(0,01)
	07.2023	DKK 62.274	€ 8.362	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	€ 1.233	DKK 9.183	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	303	¥ 45.165	0	(17)	(17)	(0,01)
	08.2023	DKK 9.180	€ 1.233	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 156	CNH 1.079	0	(7)	(7)	0,00
MYI	09.2023	ILS 17	\$ 5	0	0	0	0,00
	07.2023	€ 1.631	DKK 12.150	1	0	1	0,00
	07.2023	27.309	£ 23.580	167	0	167	0,11
RBC	07.2023	1.188	¥ 177.526	0	(62)	(62)	(0,04)
	07.2023	778	\$ 838	0	(9)	(9)	(0,01)
	07.2023	£ 11.326	€ 13.071	0	(127)	(127)	(0,09)
SCX	07.2023	¥ 235.061	1.492	1	0	1	0,00
	08.2023	€ 1.492	¥ 234.398	0	0	0	0,00
	08.2023	£ 23.402	€ 27.071	0	(165)	(165)	(0,11)
SOG	07.2023	€ 163	DKK 1.215	0	0	0	0,00
	07.2023	1.293	\$ 1.403	1	(8)	(7)	0,00
	07.2023	\$ 933	€ 873	18	0	18	0,01
UAG	09.2023	ILS 32	\$ 9	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 300	€ 280	5	0	5	0,00
	08.2023	75	MXN 1.292	0	0	0	0,00
SOG	08.2023	CNH 2.952	\$ 430	21	0	21	0,01
	08.2023	\$ 74	CNH 511	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	23.590	€ 21.929	307	0	307	0,21
UAG	07.2023	£ 9.236	10.618	0	(144)	(144)	(0,10)
				€ 629	€ (682)	€ (53)	(0,04)

Summe Freiverkehrsfinaanzderivate

€ (398) (0,27)

Summe Anlagen

€ 154.634 104,57

Sonstige Aktiva und Passiva

€ (6.756) (4,57)

Nettovermögen

€ 147.878 100,00

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

<sup>^</sup> Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Nullkuponwertpapier.  
 (b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
 (c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
 (d) Mit dem Fonds verbunden.  
 (e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 2.533 EUR (31. Dezember 2022: 3.688 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 9 EUR (31. Dezember 2022: 1.165 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 145.291	€ 0	€ 145.291
Investmentfonds	0	11.875	0	11.875
Pensionsgeschäfte	0	295	0	295
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(470)	(2.357)	0	(2.827)
<b>Summen</b>	<b>€ (470)</b>	<b>€ 155.104</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 154.634</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 193.346	€ 0	€ 193.346
Investmentfonds	18.800	0	0	18.800
Pensionsgeschäfte	0	4.400	0	4.400
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	731	(1.267)	0	(536)
<b>Summen</b>	<b>€ 19.531</b>	<b>€ 196.479</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 216.010</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	€ k. A.	€ k. A.	€ k. A.	€ 3	€ 0	€ 3
BOA	10	0	10	(9)	(440)	(449)
BPS	(6)	0	(6)	(397)	360	(37)
BRC	(28)	0	(28)	(93)	0	(93)
CBK	(17)	0	(17)	(65)	290	225
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
FAR	(36)	0	(36)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	0	(165)	(165)	(80)	(169)	(249)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(312)	253	(59)
JPM	(26)	9	(17)	(326)	262	(64)
MBC	(194)	0	(194)	(27)	0	(27)
MYC	(298)	(247)	(545)	(309)	(253)	(562)
MYI	11	0	11	(18)	0	(18)
RBC	5	0	5	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	6	0	6
SCX	18	0	18	6	0	6
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	391	(328)	63
SOG	307	(412)	(105)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(144)	0	(144)	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,93	78,37
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	10,30	13,20
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,02	k. A.
Investmentfonds	8,03	8,90
Pensionsgeschäfte	0,20	2,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,27)	0,34
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,37)	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,27)	(0,58)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	30,04	39,32
US-Regierungsbehörden	9,05	5,19
US-Schatzobligationen	8,22	2,49
Non-Agency-MBS	18,89	14,49
Forderungsbesicherte Wertpapiere	21,73	15,94
Staatsemissionen	10,00	7,09
Vorzugswertpapiere	0,32	0,30
Kurzfristige Instrumente	k. A.	6,75
Investmentfonds	8,03	8,90
Pensionsgeschäfte	0,20	2,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,25)	0,34
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,02)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,26)	(0,21)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,01
Zinsswaps	(1,12)	0,18
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,48
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,23)	(1,25)
Devisenterminkontrakte	(0,04)	0,19
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,57)	(2,29)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

BESCHREIBUNG ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ARGENTINIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Argentina Government International Bond			
0,500 % fällig am 09.07.2030	\$ 254	\$ 77	0,01
1,000 % fällig am 09.07.2029	3	1	0,00
1,500 % fällig am 09.07.2035	91	26	0,01
Summe Argentinien		104	0,02
<b>AUSTRALIEN</b>			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
RESIMAC Bastille Trust			
6,093 % fällig am 05.09.2057	71	72	0,02
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Australia Government International Bond			
0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD 4.100	2.442	0,59
0,750 % fällig am 21.11.2027	2.512	1.624	0,40
1,000 % fällig am 21.12.2030	700	377	0,09
1,250 % fällig am 21.05.2032	500	265	0,06
1,750 % fällig am 21.06.2051	700	271	0,07
2,500 % fällig am 21.05.2030	500	303	0,07
4,500 % fällig am 21.04.2033	2.100	1.451	0,35
		6.733	1,63
Summe Australien		6.805	1,65
<b>BRASILIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.			
0,000 % fällig am 31.07.2023			
(c)(f)	\$ 254	1	0,00
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL			
9,850 % fällig am 16.07.2032	BRL 14.760	2.822	0,69
Summe Brasilien		2.823	0,69
<b>BULGARIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Bulgaria Government International Bond			
4,500 % fällig am 27.01.2033	€ 2.100	2.274	0,55
<b>KANADA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Air Canada Pass-Through Trust			
3,300 % fällig am 15.07.2031	\$ 385	341	0,08
Fairfax Financial Holdings Ltd.			
2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 500	492	0,12
		833	0,20
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Canadian Government Real Return Bond			
1,500 % fällig am 01.12.2044			
(e)	CAD 2.570	1.943	0,47
Summe Kanada		2.776	0,67
<b>CAYMAN INSELN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
6,350 % fällig am 15.01.2031	\$ 1.014	1.001	0,24
6,410 % fällig am 16.01.2030	975	970	0,24
Babson CLO Ltd.			
6,240 % fällig am 20.01.2031	1.174	1.164	0,28
Bain Capital Credit CLO			
6,233 % fällig am 23.04.2031	1.200	1.192	0,29
CBAM Ltd.			
6,280 % fällig am 17.04.2031	1.300	1.285	0,31
CIFC Funding Ltd.			
6,262 % fällig am 18.04.2031	1.500	1.487	0,36
Dryden CLO Ltd.			
6,280 % fällig am 15.04.2031	1.400	1.388	0,34
Dryden Senior Loan Fund			
6,521 % fällig am 15.08.2030	1.227	1.223	0,30
Gallatin CLO Ltd.			
6,311 % fällig am 21.01.2028	261	261	0,06
LCM LP			
6,290 % fällig am 20.07.2031	1.300	1.287	0,31

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>			
OCP CLO Ltd.			
6,370 % fällig am 20.07.2029	\$ 1.038	1.032	0,25
Octagon Investment Partners Ltd.			
6,220 % fällig am 16.04.2031	1.100	1.089	0,27
Octagon Loan Funding Ltd.			
6,525 % fällig am 18.11.2031	1.300	1.288	0,31
Venture CLO Ltd.			
6,140 % fällig am 15.04.2027	194	194	0,05
6,300 % fällig am 20.07.2030	1.253	1.241	0,30
6,350 % fällig am 20.01.2029	859	853	0,21
Wind River CLO Ltd.			
6,312 % fällig am 18.07.2031	1.295	1.280	0,31
		18.235	4,43
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Gaci First Investment Co.			
4,750 % fällig am 14.02.2030	1.400	1.380	0,34
4,875 % fällig am 14.02.2035	1.500	1.440	0,35
5,125 % fällig am 14.02.2053	700	631	0,15
KSA Sukuk Ltd.			
5,268 % fällig am 25.10.2028	400	409	0,10
QNB Finance Ltd.			
1,375 % fällig am 26.01.2026	400	363	0,09
Sands China Ltd.			
4,300 % fällig am 08.01.2026	200	188	0,05
5,625 % fällig am 08.08.2025	400	390	0,09
		4.801	1,17
Summe Cayman Inseln		23.036	5,60
<b>CHILE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Santander Chile			
2,700 % fällig am 10.01.2025	1.100	1.052	0,26
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos			
4,500 % fällig am 01.03.2026	CLP 1.120.000	1.359	0,33
Summe Chile		2.411	0,59
<b>CHINA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
China Government International Bond			
3,190 % fällig am 15.04.2053	CN 2.000	285	0,07
	Y		
<b>KOLUMBIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Colombia Government International Bond			
7,500 % fällig am 02.02.2034	\$ 1.900	1.863	0,45
Colombian TES			
5,750 % fällig am 03.11.2027	COP 570.000	117	0,03
Summe Kolumbien		1.980	0,48
<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Czech Republic Government International Bond			
0,850 % fällig am 15.05.2030	CZK 12.100	444	0,11
<b>DÄNEMARK</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Jyske Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 18.651	1.923	0,47
1,500 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.07.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	1.155	127	0,03
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
1,000 % fällig am 01.10.2050	44.431	4.414	1,07
1,500 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	385	43	0,01
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>			
Nykredit Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 23.547	\$ 2.426	0,59
1,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	10.576	1.105	0,27
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2036	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
3,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
Realkredit Danmark A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	3.610	380	0,09
1,500 % fällig am 01.10.2053	3.326	356	0,09
2,500 % fällig am 01.04.2036	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2047	0	0	0,00
Summe Dänemark		10.774	2,62
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Dominican Republic Government International Bond			
6,500 % fällig am 15.02.2048	\$ 800	693	0,17
<b>FRANKREICH</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
BNP Paribas S.A.			
3,800 % fällig am 10.01.2024	300	296	0,07
Societe Generale S.A.			
1,488 % fällig am 14.12.2026	3.700	3.258	0,79
6,446 % fällig am 10.01.2029	900	902	0,22
6,691 % fällig am 10.01.2034	1.000	1.019	0,25
		5.475	1,33
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
France Government International Bond			
0,100 % fällig am 25.07.2031			
(e)	€ 1.754	1.861	0,45
0,250 % fällig am 25.07.2024			
(e)	1.867	2.018	0,49
0,500 % fällig am 25.05.2072	100	43	0,01
0,750 % fällig am 25.05.2052	3.550	2.112	0,51
1,500 % fällig am 25.05.2050	200	152	0,04
3,000 % fällig am 25.05.2054	400	413	0,10
3,250 % fällig am 25.05.2045	200	219	0,06
		6.818	1,66
Summe Frankreich		12.293	2,99
<b>DEUTSCHLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Deutsche Bank AG			
0,050 % fällig am 20.11.2024	3.800	3.923	0,95
1,375 % fällig am 03.09.2026	400	401	0,10
1,375 % fällig am 17.02.2032	400	324	0,08
1,625 % fällig am 20.01.2027	2.500	2.426	0,59
1,750 % fällig am 19.11.2030	400	345	0,08
2,625 % fällig am 12.02.2026	500	516	0,13
3,035 % fällig am 28.05.2032			
(i)	\$ 1.050	828	0,20
Summe Deutschland		8.763	2,13
<b>GUATEMALA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Guatemala Government International Bond			
5,375 % fällig am 24.04.2032	400	381	0,09
<b>HONGKONG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Huarong Finance Co. Ltd.			
2,125 % fällig am 30.09.2023	400	395	0,10
<b>UNGARN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Hungary Government International Bond			
5,000 % fällig am 22.02.2027	€ 100	110	0,03
6,250 % fällig am 22.09.2032	\$ 1.500	1.540	0,37
6,750 % fällig am 25.09.2052	500	517	0,13
Magyar Export-Import Bank			
6,125 % fällig am 04.12.2027	2.100	2.080	0,50
Summe Ungarn		4.247	1,03



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Advantage Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS				
<b>INDONESIEN</b>				<b>INDONESIEN</b>				<b>INDONESIEN</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>															
Perusahaan Perseroan PT Perusahaan Listrik Negara				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				FORESEA Holding S.A.							
3,000 % fällig am 30.06.2030	\$	3.500	2.997	0,73	0,875 % fällig am 08.10.2027	€	1.300	1.266	0,31	7,500 % fällig am 15.06.2030	\$	284	250	0,06	
				UniCredit SpA				Logicor Financing SARRL							
				7,830 % fällig am 04.12.2023	\$	1.100	1.107	0,27	0,625 % fällig am 17.11.2025	€	200	191	0,05		
								0,750 % fällig am 15.07.2024							
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
Indonesia Government International Bond				Cassa Depositi e Prestiti SpA				TMS Issuer SARRL							
8,375 % fällig am 15.03.2034	IDR	22.982.000	1.765	0,43	5,750 % fällig am 05.05.2026		600	593	0,14	5,780 % fällig am 23.08.2032	\$	800	825	0,20	
Summe Indonesien			4.762	1,16	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro										
					2,350 % fällig am 15.09.2024	€	23.519	25.825	6,28						
<b>IRLAND</b>				<b>IRLAND</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>							
<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>															
Accunia European CLO DAC				Italy Government International Bond				Miravet SARRL							
4,127 % fällig am 15.07.2030	€	426	459	0,11	6,000 % fällig am 04.08.2028	€	1.000	1.241	0,30	4,265 % fällig am 26.05.2065	€	485	521	0,13	
Ares European CLO DAC					Summe Italien					Summe Luxemburg					
3,957 % fällig am 15.10.2031		1.100	1.180	0,29				27.659	6,72			4.395	1,07		
Armada Euro CLO DAC															
3,897 % fällig am 15.07.2031		400	427	0,10	<b>ELFENBEINKÜSTE</b>										
Aurium CLO DAC					<b>STAATSEMISSIONEN</b>										
3,907 % fällig am 16.01.2031		1.098	1.175	0,29	Ivory Coast Government International Bond										
BNPP AM Euro CLO DAC					5,250 % fällig am 22.03.2030	€	1.600	1.480	0,36	<b>MALAYSIA</b>					
4,031 % fällig am 22.07.2032		1.000	1.066	0,26	5,875 % fällig am 17.10.2031	€	700	641	0,15	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
Cairn CLO DAC					Summe Elfenbeinküste					2,480 % fällig am 28.01.2032	\$	500	418	0,10	
3,842 % fällig am 30.04.2031		394	422	0,10						3,500 % fällig am 21.04.2030		200	185	0,05	
Carlyle Euro CLO DAC					<b>JAPAN</b>					4,550 % fällig am 21.04.2050		200	184	0,04	
3,877 % fällig am 15.01.2031		996	1.063	0,26	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					4,800 % fällig am 21.04.2060		200	188	0,05	
Dryden Euro CLO DAC					Nomura Holdings, Inc.					Summe Malaysia				0,24	
3,837 % fällig am 15.04.2033		700	747	0,18	2,329 % fällig am 22.01.2027	\$	400	354	0,09	<b>MULTINATIONAL</b>					
4,183 % fällig am 15.05.2034		1.000	1.068	0,26	Sumitomo Mitsui Banking Corp.					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC					0,409 % fällig am 07.11.2029	€	1.300	1.157	0,28	Preferred Term Securities Ltd.					
4,100 % fällig am 20.01.2032		1.000	1.064	0,26	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.					5,914 % fällig am 23.06.2035		1.056	992	0,24	
Harvest CLO DAC					5,520 % fällig am 13.01.2028	\$	1.200	1.206	0,29	<b>NIEDERLANDE</b>					
3,880 % fällig am 20.10.2031		800	855	0,21	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
3,937 % fällig am 15.07.2031		1.100	1.171	0,28	0,010 % fällig am 15.10.2027	€	1.000	927	0,22	Cooperative Rabobank UA					
4,027 % fällig am 15.01.2032		1.100	1.174	0,29	Summe Japan					3,758 % fällig am 06.04.2033		400	348	0,08	
4,250 % fällig am 26.06.2030		975	1.042	0,25	20.579	5,00				CTP NV					
Jubilee CLO DAC					<b>STAATSEMISSIONEN</b>					0,500 % fällig am 21.06.2025	€	1.100	1.070	0,26	
3,777 % fällig am 15.04.2030		600	639	0,16	Japan Government International Bond					ING Groep NV					
3,827 % fällig am 15.04.2031		400	426	0,10	0,005 % fällig am 01.10.2024	¥	1.050.000	7.277	1,77	2,125 % fällig am 23.05.2026		500	520	0,13	
Madison Park Euro Funding DAC					0,100 % fällig am 10.03.2028					Prosus NV					
3,977 % fällig am 15.07.2032		1.100	1.170	0,28	(e)					1,207 % fällig am 19.01.2026		1.500	1.491	0,36	
Man GLG Euro CLO DAC					0,100 % fällig am 10.03.2029					3,257 % fällig am 19.01.2027	\$	1.600	1.447	0,35	
3,987 % fällig am 15.10.2032		1.099	1.168	0,28	(e)					Summe Niederlande				4.876	1,18
4,216 % fällig am 15.12.2031		599	642	0,16	0,500 % fällig am 20.03.2049					<b>NON-AGENCY-MBS</b>					
Oak Hill European Credit Partners DAC					0,700 % fällig am 20.06.2051					Jubilee Place BV					
3,940 % fällig am 20.10.2031		1.100	1.169	0,28	Summe Kasachstan					4,177 % fällig am 17.10.2057	€	443	484	0,12	
OCF Euro CLO DAC					1.710	0,42				Summe Niederlande					1,30
4,091 % fällig am 22.09.2034		800	850	0,21	<b>KASACHSTAN</b>					<b>NEUSEELAND</b>					
Palmer Square European Loan Funding DAC					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
3,907 % fällig am 15.07.2031		963	1.026	0,25	KazMunayGas National Co. JSC					New Zealand Government International Bond					
Sculptor European CLO DAC					3,500 % fällig am 14.04.2033	\$	1.550	1.204	0,29	1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD	600	294	0,07	
3,916 % fällig am 14.01.2032		1.100	1.179	0,29	5,750 % fällig am 19.04.2047		200	163	0,04	<b>NORWEGEN</b>					
					6,375 % fällig am 24.10.2048		400	343	0,09	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
					Summe Kasachstan					Kommunalbanken A/S					
					21.182	5,15				1,900 % fällig am 19.01.2027	AUD	400	242	0,06	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>AKTIEN</b>							
AerCap Ireland Capital DAC										Norway Government International Bond					
2,450 % fällig am 29.10.2026	\$	400	357	0,09	DrillCo Holding Lux S.A. (b)		6.700	129	0,03	1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK	6.000	539	0,13	
3,000 % fällig am 29.10.2028		500	433	0,10	DrillCo Holding Lux S.A. (b)(f)		16.048	308	0,08	Summe Norwegen					
					Summe Stammaktien					437	0,11				
										<b>PERU</b>					
										<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
										Banco de Credito del Peru S.A.					
										4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	1.700	449	0,11	
										Summe Peru					
										2.100	616	0,15			
										<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
										Peru Government International Bond					
										8,200 % fällig am 12.08.2026					
										Summe Peru					
										1.065	0,26				
<b>ITALIEN</b>				<b>ITALIEN</b>				<b>ITALIEN</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>															
AMCO - Asset Management Co. SpA				CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan				CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan							
1,500 % fällig am 17.07.2023	€	389	424	0,10	European Core Fund					0,900 % fällig am 12.10.2029		300	240	0,06	
4,625 % fällig am 06.02.2027		600	651	0,16	CPI Property Group S.A.					1,625 % fällig am 23.04.2027		700	558	0,13	

BESCHREIBUNG	PAR	MARKT- WERT	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
	(000S)	(000S)	
<b>PHILIPPINEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Philippines Government International Bond 6,250 % fällig am 14.01.2036	PHP	21.000	\$ 379 0,09
<b>POLEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Poland Government International Bond 3,875 % fällig am 14.02.2033	€	1.300	1.409 0,34
4,250 % fällig am 14.02.2043		900	966 0,23
4,875 % fällig am 04.10.2033	\$	400	393 0,10
5,500 % fällig am 16.11.2027		100	103 0,03
5,500 % fällig am 04.04.2053		300	303 0,07
Summe Polen		3.174	0,77
<b>PORTUGAL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Espirito Santo S.A. 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	€	1.900	508 0,12
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^		600	160 0,04
Summe Portugal		668	0,16
<b>KATAR</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
QatarEnergy 2,250 % fällig am 12.07.2031	\$	200	168 0,04
3,300 % fällig am 12.07.2051		200	147 0,04
Summe Katar		315	0,08
<b>RUMÄNIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Romania Government International Bond 1,375 % fällig am 02.12.2029	€	360	305 0,08
1,750 % fällig am 13.07.2030		1.300	1.085 0,26
2,000 % fällig am 28.01.2032		100	80 0,02
2,000 % fällig am 14.04.2033		800	618 0,15
2,124 % fällig am 16.07.2031		300	249 0,06
2,625 % fällig am 02.12.2040		100	67 0,02
2,750 % fällig am 14.04.2041		200	134 0,03
2,875 % fällig am 13.04.2042		500	336 0,08
6,625 % fällig am 27.09.2029		800	909 0,22
Summe Rumänien		3.783	0,92
<b>RUSLAND</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Russia Government International Bond 1,125 % fällig am 20.11.2027 ^	€	2.000	1.025 0,25
4,750 % fällig am 27.05.2026 ^	\$	200	101 0,03
7,700 % fällig am 23.03.2033 ^	RUB	33.500	135 0,03
Summe Russland		1.261	0,31
<b>SAUDI-ARABIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Saudi Arabia Government International Bond 3,250 % fällig am 22.10.2030	\$	200	182 0,04
4,750 % fällig am 18.01.2028		1.200	1.191 0,29
4,875 % fällig am 18.07.2033		1.300	1.300 0,32
5,000 % fällig am 18.01.2053		900	835 0,20
Summe Saudi-Arabien		3.508	0,85
<b>SERBIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Serbia Government International Bond 2,050 % fällig am 23.09.2036	€	400	268 0,06
3,125 % fällig am 15.05.2027		2.500	2.454 0,60
Summe Serbien		2.722	0,66
<b>SINGAPUR</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
CapitalLand Ascendas REIT 0,750 % fällig am 23.06.2028		1.000	873 0,21
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,650 % fällig am 19.05.2030	\$	400	396 0,10
Summe Singapur		1.269	0,31

BESCHREIBUNG	PAR	MARKT- WERT	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
	(000S)	(000S)	
<b>SLOWENIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % fällig am 27.01.2025	€	400	\$ 422 0,10
Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030		400	371 0,09
Summe Slowenien		793	0,19
<b>SÜDAFRIKA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
South Africa Government International Bond 5,375 % fällig am 24.07.2044	\$	300	214 0,05
5,750 % fällig am 30.09.2049		200	142 0,04
Summe Südafrika		356	0,09
<b>SÜDKOREA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
South Korea Government International Bond 2,000 % fällig am 10.06.2031	KRW	1.018.830	686 0,16
2,125 % fällig am 10.06.2027		680.000	487 0,12
2,375 % fällig am 10.12.2028		2.960.000	2.103 0,51
3,250 % fällig am 10.06.2033		1.728.590	1.268 0,31
4,250 % fällig am 10.12.2032		4.950.810	3.926 0,95
5,500 % fällig am 10.03.2028		640.000	524 0,13
Summe Südkorea		8.994	2,18
<b>SPANIEN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	€	145	154 0,04
Banco Santander S.A. 1,849 % fällig am 25.03.2026	\$	200	179 0,04
3,496 % fällig am 24.03.2025		800	767 0,19
CaixaBank S.A. 1,750 % fällig am 24.10.2023	€	600	650 0,16
Summe Spanien		1.596	0,39
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035		300	325 0,08
Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 31.10.2071		500	264 0,06
3,450 % fällig am 30.07.2066		2.000	1.990 0,48
Summe Spanien		2.579	0,62
Summe Spanien		4.329	1,05
<b>SUPRANATIONAL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Asian Development Bank 6,150 % fällig am 25.02.2030	INR	252.300	2.972 0,72
<b>SCHWEIZ</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	\$	1.400	1.395 0,34
UBS Group AG 4,125 % fällig am 24.09.2025		200	191 0,05
6,373 % fällig am 15.07.2026		500	497 0,12
6,537 % fällig am 12.08.2033		300	307 0,07
7,000 % fällig am 30.09.2027	£	300	376 0,09
7,375 % fällig am 07.09.2033		200	267 0,06
7,750 % fällig am 01.03.2029	€	1.900	2.299 0,56
9,016 % fällig am 15.11.2033	\$	500	600 0,15
Summe Schweiz		5.932	1,44
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
MDGH GMTN RSC Ltd. 5,500 % fällig am 28.04.2033		200	211 0,05

BESCHREIBUNG	PAR	MARKT- WERT	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
	(000S)	(000S)	
<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Antofagasta PLC 2,375 % fällig am 14.10.2030	\$	400	\$ 326 0,08
Barclays PLC 6,224 % fällig am 09.05.2034		600	598 0,14
7,437 % fällig am 02.11.2033		300	325 0,08
Haleon UK Capital PLC 3,125 % fällig am 24.03.2025		700	669 0,16
HSBC Holdings PLC 2,251 % fällig am 22.11.2027		400	355 0,09
4,041 % fällig am 13.03.2028		200	188 0,05
4,583 % fällig am 19.06.2029		1.000	942 0,23
Nationwide Building Society 2,972 % fällig am 16.02.2028		1.300	1.169 0,28
NatWest Group PLC 5,076 % fällig am 27.01.2030		1.100	1.050 0,25
Santander UK Group Holdings PLC 2,469 % fällig am 11.01.2028		500	437 0,11
6,534 % fällig am 10.01.2029		1.300	1.310 0,32
Standard Chartered PLC 0,991 % fällig am 12.01.2025		800	776 0,19
2,608 % fällig am 12.01.2028		600	532 0,13
2,678 % fällig am 29.06.2032		400	314 0,08
2,819 % fällig am 30.01.2026		400	377 0,09
TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028	£	400	376 0,09
Summe Großbritannien		9.744	2,37
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Alba PLC 5,191 % fällig am 17.03.2039		854	1.044 0,25
Avon Finance PLC 5,809 % fällig am 20.09.2048		539	685 0,17
Canada Square Funding PLC 5,682 % fällig am 17.06.2058		623	787 0,19
Eurosail PLC 3,629 % fällig am 13.03.2045	€	10	10 0,00
5,140 % fällig am 13.03.2045	£	195	246 0,06
Great Hall Mortgages PLC 5,152 % fällig am 18.03.2039		18	23 0,01
5,166 % fällig am 18.06.2039		169	212 0,05
5,644 % fällig am 18.06.2039	\$	115	114 0,03
Paragon Mortgages PLC 5,752 % fällig am 15.05.2045	£	135	171 0,04
Polaris PLC 5,631 % fällig am 23.12.2058		668	845 0,21
Resloc UK PLC 5,161 % fällig am 15.12.2043		474	581 0,14
Ripon Mortgages PLC 5,491 % fällig am 28.08.2056		2.983	3.779 0,92
RMAC Securities PLC 5,154 % fällig am 12.06.2044		549	668 0,16
Stratton Mortgage Funding PLC 5,391 % fällig am 20.07.2060		1.237	1.572 0,38
5,765 % fällig am 12.03.2052		566	717 0,17
5,792 % fällig am 25.09.2051		889	1.128 0,27
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,841 % fällig am 20.07.2045		940	1.196 0,29
Trinity Square PLC 5,316 % fällig am 15.07.2059		573	728 0,18
Summe Großbritannien		14.506	3,52
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2024 (e)		5.533	6.900 1,68
0,125 % fällig am 22.03.2051 (e)		291	295 0,07
0,125 % fällig am 22.03.2068 (e)		164	166 0,04
0,625 % fällig am 22.11.2042 (e)		175	212 0,05
0,625 % fällig am 22.10.2050		1.300	672 0,16
1,250 % fällig am 31.07.2051		370	233 0,06
1,500 % fällig am 31.07.2053		300	199 0,05
Summe Großbritannien		8.677	2,11
Summe Großbritannien		32.927	8,00



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES	
		MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS
4,000 % fällig am 01.08.2053	\$ 17.800	\$ 16.720	4,06	U.S. Treasury Notes				HUNGARY TREASURY BILLS			
4,500 % fällig am 01.08.2053	23.300	22.414	5,45	2,875 % fällig am 30.04.2025	\$ 9.300	\$ 8.957	2,18	16,220 % fällig am 06.07.2023			
5,000 % fällig am 01.08.2053	17.400	17,054	4,14	3,500 % fällig am 15.02.2033	1.300	1.266	0,31	(c)(d)	HUF 831.000	\$ 2.426	0,58
5,500 % fällig am 01.08.2053	23.300	23.185	5,63	4,000 % fällig am 29.02.2028	300	298	0,07	Summe kurzfristige Instrumente		3.280	0,80
6,000 % fällig am 01.08.2053	32.100	32.378	7,87			48.517	11,78	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 518.780	126,03
6,500 % fällig am 01.07.2053	31.900	32.571	7,91	Summe USA		256.683	62,35				
		157.879	38,35								
<b>US-SCHATZOBBLIGATIONEN</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>AKTIEN</b>			
<b>U.S. Treasury Bonds</b>				<b>COMMERCIAL PAPER</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
1,625 % fällig am 15.11.2050	1.300	808	0,20	Conagra Foods, Inc.				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
1,875 % fällig am 15.02.2041	9.000	6.543	1,59	5,750 % fällig am 05.07.2023	500	499	0,12	PIMCO Select Funds plc -			
2,875 % fällig am 15.05.2052	300	249	0,06	Global Payments, Inc.				PIMCO US Dollar Short-			
4,000 % fällig am 15.11.2052	400	411	0,10	5,930 % fällig am 28.07.2023	300	299	0,08	Term Floating NAV Fund			
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)</b>						798	0,20	(g)	1.573.660	15.670	3,81
0,125 % fällig am 15.04.2025	3.112	2.961	0,72	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>				PIMCO Specialty Funds			
0,125 % fällig am 15.07.2030	2.011	1.804	0,44	(28,578) % fällig am				Ireland p.l.c. - PIMCO			
0,125 % fällig am 15.07.2031	1.245	1.104	0,27	18.10.2023 (c)(d)	ARS 13.855	28	0,01	China Bond Fund (g)			
0,125 % fällig am 15.01.2032	3.939	3.470	0,84	(12,549) % fällig am				446.527	5.819	1,41	
0,250 % fällig am 15.01.2025	3.330	3.192	0,78	23.11.2023 (c)(d)	13.517	28	0,01	Summe Investmentfonds		\$ 21.489	5,22
0,250 % fällig am 15.02.2050	1.180	826	0,20			56	0,02				
0,500 % fällig am 15.01.2028	10.083	9.435	2,28								
0,625 % fällig am 15.07.2032	1.670	1.536	0,37								
0,750 % fällig am 15.07.2028	2.054	1.947	0,47								
1,125 % fällig am 15.01.2033	3.869	3.710	0,90								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 2.347	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (2.394)	\$ 2.347	\$ 2.347	0,57
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (2.394)	\$ 2.347	\$ 2.347	0,57

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	96	\$ 255	0,06
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	41	14	0,00
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	41	(9)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	28	11	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	50	20	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 170,000 EUR auf Euro-OAT September 2023 Futures <sup>(1)</sup>	Long	08.2023	41	0	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1	2	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	202	368	0,09
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	118	(129)	(0,03)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	105	113	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	4	5	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	5	(11)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	213	235	0,06
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	272	64	0,02
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	11	(41)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	10	30	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	107	212	0,05
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	5	(6)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	67	90	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	24	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	3	6	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	135	175	0,04
				\$ 1.405	0,34

(1) Future-Style-Option.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Advantage Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHADELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	9	\$ (4)	\$ (3)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	9	(3)	(1)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	7	(6)	0	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	7	(6)	(33)	(0,01)
				\$ (19)	\$ (37)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate						\$ 1.368 0,33

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2023	\$ 300	\$ (3)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	400	12	0,00
				\$ 9	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 10-Year Index	(1,000) %	20.06.2033	\$ 59.000	\$ (606)	(0,15)
iTraxx Europe Main 39 10-Year Index	(1,000)	20.06.2033	€ 6.700	(94)	(0,02)
				\$ (700)	(0,17)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	\$ 39.700	\$ 189	0,05

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 900	\$ (80)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	31.900	(1.727)	(0,42)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	3.200	(204)	(0,05)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	900	(33)	(0,01)
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	16.03.2032	INR 63.900	(56)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	15.03.2028	678.215	(27)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	¥ 250.000	(19)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	230.000	(36)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	440.000	(21)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	280.000	174	0,04
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,789	23.01.2033	1.356.000	(230)	(0,06)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	300.000	118	0,03
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	15.03.2028	SGD 2.370	(45)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	25.08.2023	\$ 8.100	(112)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	31.08.2023	9.500	(132)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.09.2023	10.200	(142)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	18.09.2023	200	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	10.400	878	0,21
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	10.080	(501)	(0,12)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,249	31.08.2024	9.500	664	0,16
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	10.200	1.192	0,30
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,298	25.08.2024	8.100	579	0,14
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,430	31.03.2024	200	6	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2024	200	18	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	9.900	(1.309)	(0,32)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	800	(99)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	2.300	(272)	(0,07)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	500	(59)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	10.740	81	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	19.230	344	0,08
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	520	15	0,00



Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,850 %	21.04.2024	\$ 21.900	\$ 498	0,12
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	2.000	(699)	(0,17)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,209	31.03.2024	2.236	68	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,400	21.06.2024	600	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	1.080	(34)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,906	16.09.2052	600	(40)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	16.400	825	0,20
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,968	30.06.2024	13.100	(301)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	3.980	63	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	400	(17)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,070	15.11.2032	2.500	112	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,083	15.11.2032	2.300	100	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,086	15.11.2032	2.600	87	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	1.200	(48)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,106	15.11.2032	1.900	79	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,139	15.11.2032	2.400	94	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,150	13.05.2025	42.700	416	0,10
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,163	30.09.2029	3.100	(117)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,165	03.10.2053	600	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,173	15.11.2032	1.700	63	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,174	15.11.2032	1.800	65	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,200	13.05.2025	2.700	31	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,225	30.09.2029	2.100	(73)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,240	03.10.2053	600	10	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	7.400	81	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	2.400	10	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,445	03.10.2038	1.800	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	2.900	(51)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	700	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	1.000	(9)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	100	1	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	301	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	400	(6)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,533	03.10.2038	1.800	(18)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	9.600	154	0,04
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	5.584	49	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,752	03.10.2028	2.300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	700	(6)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,850	03.10.2028	2.300	6	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,898	30.06.2029	3.200	18	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,159	31.03.2025	14.500	232	0,06
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	31.996	169	0,04
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024	4.500	(57)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024	4.500	59	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,427	27.09.2024	10.300	(122)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,427	27.09.2024	10.300	105	0,03
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,433	06.09.2024	21.300	(257)	(0,07)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,433	06.09.2024	21.300	222	0,06
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024	3.400	(27)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024	3.400	15	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,280	04.01.2027	BRL 1.600	27	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 6.700	(402)	(0,10)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	2.600	(159)	(0,04)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	1.600	(131)	(0,03)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,750	16.12.2046	1.400	162	0,04
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	3.700	(336)	(0,08)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2033	1.900	69	0,02
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033	7.000	49	0,01
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2053	3.000	(61)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	10.05.2025	58.900	(361)	(0,09)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF 1.700	(115)	(0,03)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	4.400	(285)	(0,07)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,300	15.02.2027	1.700	(113)	(0,03)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	1.300	(86)	(0,02)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	900	(79)	(0,02)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	21.12.2027	CNY 12.600	(31)	(0,01)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.12.2027	69.500	(165)	(0,04)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	21.06.2028	25.500	(60)	(0,01)
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,000	23.11.2024	€ 9.400	(174)	(0,04)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2028	KRW 22.984.540	(309)	(0,08)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033	472.359	1	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.09.2033	2.534.930	5	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD 350	(7)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	2.600	(294)	(0,07)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	4.100	(38)	(0,01)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	24.900	(225)	(0,05)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month NZD-BBR	4,750	20.03.2025	12.400	(43)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month NZD-BBR	5,250	20.03.2025	11.700	(8)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK 12.700	(58)	(0,01)
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	16.100	(223)	(0,05)
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB 138.460	47	0,01

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Advantage Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000 %	25.08.2023	\$ 8.100	\$ 112	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	31.08.2023	9.500	133	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.09.2023	10.200	145	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	18.09.2023	200	3	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023	9.900	(103)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023	800	(5)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.07.2023	2.300	(12)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.07.2023	500	(3)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.09.2023	2.000	(18)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023	4.500	10	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023	4.500	(10)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,427	27.07.2023	10.300	(7)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,427	27.09.2023	10.300	32	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,433	06.07.2023	21.300	(9)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,433	06.09.2023	21.300	63	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.07.2023	3.400	(2)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.09.2023	3.400	7	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 5.700	563	0,14
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	1.900	(114)	(0,03)
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.06.2031	1.750	205	0,05
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033	4.200	(115)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	1.100	(5)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	12.400	(247)	(0,06)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	22.500	39	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€ 200	51	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	500	178	0,04
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035	300	86	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	500	(22)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	1.400	(149)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	900	(94)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	700	(73)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	1.600	(150)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	700	(66)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	3.900	(61)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	8.800	(138)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	1.800	(30)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	1.300	(18)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	1.300	(19)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	1.200	(18)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	1.400	(28)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	12.800	(107)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027	17.660	(119)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	36.200	(214)	(0,05)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033	7.860	(21)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	69.300	285	0,07
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	15.700	(5)	0,00
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,635	18.03.2025	NOK 6.200	43	0,01
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,993	12.11.2024	4.200	26	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN 41.500	(119)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	26.02.2025	10.500	(38)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,380	25.02.2025	12.300	(48)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,415	25.02.2025	300	(1)	0,00
					\$ (2.929)	(0,71)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (3.431)</b>	<b>(0,83)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180 %	11.01.2024	1.900	\$ 54	\$ 195	0,05



## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	800	\$ 61	\$ 334	0,08

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	1.300	\$ (4)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	1.300	(4)	(18)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310	11.01.2024	16.900	(55)	(409)	(0,10)
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	300	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	300	(2)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	210	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	210	(1)	0	0,00
DUB	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	800	(60)	(306)	(0,08)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	100	(1)	0	0,00
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	700	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	700	(4)	(15)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	1.700	(13)	(2)	0,00
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	1.700	(13)	(30)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,100	31.08.2023	900	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	31.08.2023	900	(7)	(9)	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	500	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	500	(3)	(11)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	500	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	500	(3)	(10)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	600	(4)	(12)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	600	(4)	(11)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	500	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	500	(3)	(9)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	600	(4)	(12)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	400	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	400	(3)	(9)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	300	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	300	(2)	(6)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	900	(6)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	900	(6)	(19)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	1.600	(6)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	1.600	(6)	(21)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	1.000	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	1.000	(3)	(14)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	900	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	900	(3)	(11)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	2.000	(16)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	2.000	(16)	(37)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	600	(5)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	600	(5)	(11)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	4.600	(32)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	700	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	700	(2)	(3)	0,00
Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	400	(3)	0	0,00	
Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	400	(3)	(8)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	190	(1)	0	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	190	(1)	0	0,00	
							\$ (357)	\$ (1.006)	(0,24)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 500	\$ (12)	\$ 18	\$ 6	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	(10)	15	5	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	500	(12)	18	6	0,00
					\$ (34)	\$ 51	\$ 17	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Advantage Fund (Forts.)

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 700	\$ 527	\$ 3	\$ (2)	1	0,00
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	5.900	4.071	(1)	10	9	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	5.600	3.864	(11)	9	(2)	0,00
						\$ (9)	\$ 17	\$ 8	0,00

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 20.216	\$ (8)	\$ 37	\$ 29	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	12.340	(3)	31	28	0,01
BPS	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	5.219	(2)	10	8	0,00
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	3.753	0	4	4	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,635	05.04.2024	7.015	(2)	1	(1)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	1.606	3	1	4	0,00
JPM	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,960	11.02.2029	COP 15.800	0	0	0	0,00
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	MYR 3.400	(10)	8	(2)	0,00
						\$ (22)	\$ 92	\$ 70	0,02

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2023	MXN	26.761	\$ 1.454	\$ 0	\$ (103)	(0,02)		
	07.2023	NZD	208	126	0	(1)	0,00		
	07.2023	PLN	515	124	0	(3)	0,00		
	07.2023	\$	1.705	£ 1.348	9	0	9	0,00	
	08.2023	AUD	270	\$ 178	0	(2)	(2)	0,00	
	08.2023	CNH	3.527	505	18	0	18	0,00	
	08.2023	\$	5.586	AUD 8.264	0	(79)	(79)	(0,02)	
	08.2023	603	CAD	796	0	(1)	(1)	0,00	
	08.2023	165	CNH	1.157	0	(6)	(6)	0,00	
	08.2023	5.104	CNY	35.027	0	(258)	(258)	(0,06)	
	08.2023	454	¥	64.900	0	(2)	(2)	0,00	
	09.2023	TWD	16.946	\$ 558	13	0	13	0,00	
	09.2023	\$	446	CLP 364.511	4	0	4	0,00	
	09.2023	1.461	HKD	11.414	0	(2)	(2)	0,00	
	09.2023	926	INR	76.598	5	0	5	0,00	
	09.2023	476	KRW	603.042	0	(16)	(16)	0,00	
	09.2023	440	PEN	1.614	3	0	3	0,00	
	BPS	07.2023	463	CZK	9.957	0	(6)	(6)	0,00
		07.2023	504	£	393	0	(4)	(4)	0,00
		07.2023	481	MYR	2.210	0	(7)	(7)	0,00
07.2023		53	SGD	71	0	(1)	(1)	0,00	
08.2023		CNH	26.112	\$ 3.703	101	0	101	0,02	
08.2023		€	1.979	2.170	7	0	7	0,00	
08.2023		TWD	8.482	278	5	0	5	0,00	
08.2023		\$	5.356	CNH 36.999	0	(253)	(253)	(0,06)	
08.2023		6.024	CNY	41.189	0	(326)	(326)	(0,08)	
08.2023		3.555	€	3.250	1	(3)	(2)	0,00	
BRC	08.2023	313	ZAR	5.812	0	(6)	(6)	0,00	
	09.2023	8	\$	0	0	0	0	0,00	
	09.2023	\$	570	IDR 8.572.440	0	(1)	(1)	0,00	
	12.2023	330	MXN	5.886	3	0	3	0,00	
	07.2023	422	£	333	2	0	2	0,00	
	07.2023	63	MYR	289	0	(1)	(1)	0,00	
	08.2023	257	CNH	1.825	0	(6)	(6)	0,00	
	08.2023	848	COP	3.613.553	7	0	7	0,00	
08.2023	858	¥	113.582	0	(67)	(67)	(0,02)		

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
	08.2023	\$ 339	ZAR 6.266	\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	0,00
	09.2023	IDR 39.603	\$ 3	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS 24	7	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 25	IDR 373.724	0	0	0	0,00
BSH	09.2023	64	PEN 233	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	554	2.040	8	0	8	0,00
	07.2023	BRL 1.268	\$ 258	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	CLP 208.540	258	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	IDR 372.985	25	0	0	0	0,00
	07.2023	NZD 650	399	0	0	0	0,00
	07.2023	PEN 33.120	8.524	0	(613)	(613)	(0,15)
	07.2023	\$ 408	CZK 8.787	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	10.083	PEN 36.727	48	0	48	0,01
	07.2023	959	PHP 52.328	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	873	RON 3.946	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	CLP 304.881	\$ 368	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	CNH 5.595	803	31	0	31	0,01
	08.2023	DKK 61.305	8.855	0	(150)	(150)	(0,04)
	08.2023	€ 972	1.046	0	(17)	(17)	0,00
	08.2023	TWD 8.831	289	6	0	6	0,00
	08.2023	\$ 363	BRL 1.875	24	0	24	0,01
	08.2023	3.425	CAD 4.594	49	0	49	0,01
	08.2023	14	CNH 97	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	2.098	€ 1.908	4	(16)	(12)	0,00
	08.2023	2.096	NOK 21.868	0	(52)	(52)	(0,01)
	08.2023	723	PEN 2.824	53	0	53	0,01
	08.2023	2.916	SEK 29.569	0	(173)	(173)	(0,04)
	09.2023	CNH 9.742	\$ 1.367	20	0	20	0,00
	09.2023	KRW 5.414	4	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 1.419	THB 49.085	1	(25)	(24)	(0,01)
	09.2023	1.090	VND 25.691.912	1	0	1	0,00
	10.2023	CLP 1.390	\$ 2	0	0	0	0,00
CLY	11.2023	ILS 5.907	1.765	163	0	163	0,04
	08.2023	\$ 245	CNH 1.739	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	2.367	NOK 24.805	0	(48)	(48)	(0,01)
DUB	07.2023	PEN 59.407	\$ 16.296	0	(89)	(89)	(0,02)
	07.2023	\$ 5.323	BRL 28.844	655	0	655	0,16
	07.2023	8.121	PEN 29.704	73	0	73	0,02
	08.2023	TWD 11.514	\$ 377	7	0	7	0,00
	09.2023	\$ 289	PEN 1.057	2	0	2	0,00
GLM	07.2023	BRL 29.117	\$ 6.030	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	IDR 373.975	25	0	0	0	0,00
	07.2023	PEN 3.705	1.015	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	\$ 287	BRL 1.449	13	0	13	0,00
	08.2023	1.696	CHF 1.501	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	922	NOK 9.780	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	457	PEN 1.667	1	0	1	0,00
	09.2023	6.030	BRL 29.440	5	0	5	0,00
	09.2023	558	PEN 2.052	5	0	5	0,00
	09.2023	1.997	SGD 2.670	0	(18)	(18)	0,00
JPM	09.2023	1	THB 34	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW 5.164.251	\$ 4.042	120	0	120	0,03
	07.2023	SGD 277	210	5	0	5	0,00
	07.2023	\$ 63	PHP 3.424	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	1.678	SGD 2.218	0	(39)	(39)	(0,01)
	08.2023	CNH 2.069	\$ 290	5	0	5	0,00
	08.2023	HUF 130.000	377	2	0	2	0,00
	08.2023	\$ 3.052	CAD 4.080	33	0	33	0,01
	08.2023	2.556	CHF 2.248	0	(33)	(33)	(0,01)
	08.2023	4.096	CNH 28.306	0	(192)	(192)	(0,05)
	08.2023	6.354	CNY 43.453	0	(342)	(342)	(0,08)
	08.2023	141	¥ 18.666	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	340	NOK 3.606	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	IDR 40.699	\$ 3	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS 23	6	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 1	IDR 9.960	0	0	0	0,00
	09.2023	6.812	INR 561.424	12	0	12	0,00
	09.2023	4.395	PEN 16.181	43	0	43	0,01
	09.2023	1.357	THB 46.527	0	(35)	(35)	(0,01)
	12.2023	2.118	INR 174.780	0	(1)	(1)	0,00
MBC	10.2024	¥ 110.000	\$ 890	74	0	74	0,02
	07.2023	£ 10.482	13.024	9	(311)	(302)	(0,07)
	08.2023	CAD 498	375	1	(2)	(1)	0,00
	08.2023	CNH 7.796	1.100	25	0	25	0,01
	08.2023	€ 20.657	22.784	204	(2)	202	0,05
	08.2023	\$ 248	CNH 1.783	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	549	HUF 187.162	0	(8)	(8)	0,00
	09.2023	IDR 943	\$ 0	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 176	IDR 2.614.097	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	803	KRW 1.023.838	0	(23)	(23)	(0,01)
	10.2024	¥ 340.000	\$ 2.725	203	0	203	0,05

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens				
MYI	07.2023	£	290	\$	360	\$	(8)	0,00			
	07.2023	IDR	498.726		33	0	0	0,00			
	07.2023	\$	2	€	2	0	0	0,00			
	07.2023		8	IDR	122.933	0	0	0,00			
	07.2023		366	KZT	171.575	12	0	0,00			
	07.2023		20	MYR	92	0	0	0,00			
	08.2023	¥	41.300	\$	298	10	0	0,00			
	08.2023	TWD	16.924		557	13	0	0,00			
	08.2023	\$	670	€	613	1	0	0,00			
	08.2023		12.239	¥	1.626.444	0	(914)	(0,22)			
	08.2023		69	ZAR	1.340	2	0	0,00			
	09.2023	IDR	123.040	\$	8	0	0	0,00			
	09.2023	\$	816	IDR	12.183.983	0	(6)	(0,00)			
	09.2023		1.470	INR	121.264	4	0	0,00			
	09.2023		899	KRW	1.150.628	0	(22)	(0,01)			
	09.2023		619	THB	21.208	0	(17)	(0,00)			
	10.2024	¥	600.000	\$	4.906	456	0	0,11			
	RBC	07.2023	\$	5.604	MXN	107.822	671	0	0,16		
		08.2023	CHF	59	\$	67	0	0	0,00		
	SCX	08.2023	MXN	5.115		295	0	(1)	0,00		
		07.2023	NZD	541		329	0	(3)	(0,00)		
		07.2023	\$	482	MYR	2.217	0	(6)	(0,00)		
		08.2023	TWD	6.147		201	4	0	0,00		
08.2023		\$	425	AUD	634	0	(2)	(0,00)			
08.2023			2.269	CNH	15.609	0	(117)	(0,03)			
08.2023			16.900	CNY	115.378	0	(937)	(0,23)			
08.2023			259	€	237	0	0	0,00			
08.2023			417	¥	57.800	0	(15)	(0,00)			
09.2023		CNH	2.191	\$	307	4	0	0,00			
09.2023		TWD	14.174		465	9	0	0,00			
09.2023		\$	2.241	IDR	33.519.603	0	(15)	(0,00)			
09.2023			4.263	INR	351.124	5	0	0,00			
09.2023			818	KRW	1.042.034	0	(24)	(0,01)			
09.2023			248	PEN	919	4	0	0,00			
09.2023			1.894	THB	65.396	0	(36)	(0,01)			
SOG		07.2023		2.302	PLN	9.918	137	0	0,03		
		07.2023		260	CLP	208.839	0	0	0,00		
SSB		07.2023		8.144	PEN	29.705	47	0	0,01		
		08.2023	CLP	209.442	\$	260	0	0	0,00		
		08.2023	PEN	29.705		8.133	0	(42)	(0,01)		
TOR		09.2023	BRL	1.918		378	0	(15)	(0,00)		
		09.2023	KRW	2.672.560		2.061	24	0	0,01		
	07.2023	\$	11.053	£	8.698	6	0	0,00			
	07.2023		852	NZD	1.399	5	0	0,00			
	08.2023	CAD	404	\$	300	0	(6)	(0,00)			
	08.2023	£	8.698		11.055	0	(5)	(0,00)			
	08.2023	NZD	1.399		852	0	(5)	(0,00)			
UAG	08.2023	\$	5.649	¥	749.077	0	(433)	(0,11)			
	08.2023	CAD	76	\$	56	0	(1)	(0,00)			
	08.2023	\$	500	CNH	3.467	0	(22)	(0,01)			
	08.2023		215	€	196	0	(1)	(0,00)			
	08.2023		132	ZAR	2.531	2	0	0,00			
	09.2023	CNH	2.939	THB	14.234	0	(2)	(0,00)			
	09.2023	SGD	2.123	\$	1.588	15	0	0,00			
	09.2023	\$	877	INR	72.464	4	0	0,00			
09.2023		447	ZAR	7.833	0	(35)	(0,01)				
					\$	3.518	\$	(6.139)	\$	(2.621)	(0,64)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2023	AUD	139	\$	91	\$	(2)	0,00
	07.2023	\$	275	AUD	414	1	0	0,00
BOA	08.2023	AUD	414	\$	275	0	(1)	(0,00)
	07.2023		780		509	0	(11)	(0,00)
	07.2023	CAD	3.534		2.597	0	(73)	(0,02)
	07.2023	DKK	913		132	0	(2)	(0,00)
	07.2023	¥	23.717		171	6	0	0,00
	07.2023	NOK	3.380		308	0	(8)	(0,00)
	07.2023	NZD	176		107	0	(1)	(0,00)
	07.2023	SEK	62		6	0	0	0,00
BPS	07.2023	\$	244	DKK	1.656	0	(1)	(0,00)
	08.2023	DKK	1.654	\$	244	1	0	0,00
	07.2023	CHF	34.850		38.967	13	0	0,00
	07.2023	DKK	3		0	0	0	0,00
	07.2023	¥	1.051.337		7.567	293	0	0,07
	07.2023	NZD	16		10	0	0	0,00
	07.2023	\$	196	AUD	296	1	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	07.2023	\$ 16.017	CHF 14.480	\$ 168	\$ 0	\$ 168	0,04
	07.2023	24.352	€ 22.225	0	(104)	(104)	(0,03)
	07.2023	74	NOK 791	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD 296	\$ 196	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	€ 22.225	24.386	105	0	105	0,02
	08.2023	NOK 790	74	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 38.967	CHF 34.751	0	(13)	(13)	0,00
CBK	07.2023	NOK 147	\$ 13	0	(1)	(1)	0,00
CLY	07.2023	CHF 18.420	20.506	0	(83)	(83)	(0,02)
	07.2023	DKK 2.682	387	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	\$ 20.506	CHF 18.367	83	0	83	0,02
GLM	07.2023	452	NOK 4.876	3	0	3	0,00
	08.2023	NOK 4.871	\$ 452	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07.2023	\$ 2.560	¥ 366.105	0	(27)	(27)	(0,01)
	08.2023	¥ 364.550	\$ 2.560	27	0	27	0,01
MBC	07.2023	CAD 2	1	0	0	0	0,00
	07.2023	£ 3.552	4.397	0	(119)	(119)	(0,03)
	07.2023	SEK 115	11	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 1.022	CHF 928	16	0	16	0,00
MYI	07.2023	CHF 677	\$ 748	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	SEK 8.874	827	5	0	5	0,00
	07.2023	\$ 217	DKK 1.477	0	0	0	0,00
	07.2023	840	SEK 9.065	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK 1.475	\$ 217	0	0	0	0,00
	08.2023	SEK 9.054	840	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD 821	537	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	NZD 460	279	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 404	AUD 608	1	0	1	0,00
	07.2023	36.854	CHF 33.114	160	0	160	0,04
	08.2023	AUD 608	\$ 404	0	(1)	(1)	0,00
SOG	07.2023	920	602	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	€ 22.225	23.908	0	(339)	(339)	(0,08)
TOR	07.2023	AUD 487	319	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	\$ 494	AUD 748	4	0	4	0,00
	07.2023	2.672	CAD 3.536	2	(2)	0	0,00
	07.2023	4.514	£ 3.552	2	0	2	0,00
	07.2023	4.923	¥ 708.899	0	(18)	(18)	0,00
	07.2023	397	NZD 652	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD 748	\$ 495	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	CAD 3.535	2.672	2	(2)	0	0,00
	08.2023	£ 3.552	4.515	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	¥ 705.893	4.923	18	0	18	0,00
	08.2023	NZD 652	397	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07.2023	AUD 111	73	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CHF 24.332	27.143	0	(54)	(54)	(0,01)
	07.2023	NOK 2.365	214	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	\$ 797	AUD 1.193	2	(4)	(2)	0,00
	07.2023	33.657	CHF 30.242	146	0	146	0,03
	08.2023	AUD 1.193	\$ 797	5	(2)	3	0,00
	08.2023	\$ 27.143	CHF 24.263	53	0	53	0,01
				\$ 1.119	\$ (931)	\$ 188	0,04

Zum 30. Juni 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	07.2023	AUD 184	\$ 120	\$ 0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 531	AUD 800	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD 800	\$ 531	0	(2)	(2)	0,00
BOA	07.2023	1.400	913	0	(19)	(19)	(0,01)
	07.2023	CAD 6.667	4.900	0	(139)	(139)	(0,03)
	07.2023	DKK 1.698	245	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	€ 26	28	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK 6.187	563	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	NZD 221	134	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	SEK 115	11	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 453	DKK 3.083	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	10	¥ 1.395	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK 3.078	\$ 453	2	0	2	0,00
BPS	07.2023	CHF 10	11	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK 6	1	0	0	0	0,00
	07.2023	€ 69.251	75.878	325	0	325	0,08
	07.2023	¥ 1.938.587	13.953	541	0	541	0,13
	07.2023	NZD 20	12	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 379	AUD 572	2	0	2	0,00
	07.2023	2.120	CHF 1.896	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	42.547	€ 39.569	623	0	623	0,15
	07.2023	135	NOK 1.447	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD 572	\$ 379	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	CHF 1.891	2.120	1	0	1	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	08.2023	NOK	\$ 1.446	\$ 135	\$ 0	\$ 0	0,00	
	08.2023	\$	75.982	€ 69.249	0	(330)	(0,08)	
CBK	07.2023	€	51	\$ 55	0	(1)	0,00	
	07.2023	NOK	269	24	0	(1)	0,00	
CLY	07.2023	DKK	4.991	720	0	(11)	0,00	
	07.2023	\$	53	CHF 48	0	0	0,00	
	08.2023	CHF	48	\$ 53	0	0	0,00	
GLM	07.2023	\$	828	NOK 8.924	5	5	0,00	
	08.2023	NOK	8.915	\$ 828	0	(5)	0,00	
JPM	07.2023	AUD	1.123	734	0	(13)	0,00	
	07.2023	€	38.737	42.297	35	35	0,01	
	07.2023	\$	4.613	¥ 659.703	0	(49)	(0,01)	
	08.2023	¥	656.900	\$ 4.613	49	49	0,01	
	08.2023	\$	42.356	€ 38.737	0	(36)	(0,01)	
MBC	07.2023	CAD	3	\$ 3	0	0	0,00	
	07.2023	€	25	27	0	0	0,00	
	07.2023	£	6.706	8.301	0	(225)	(0,06)	
	07.2023	SEK	214	20	0	0	0,00	
	07.2023	\$	474	£ 381	10	10	0,00	
MYI	07.2023	CHF	14	\$ 16	0	0	0,00	
	07.2023	SEK	16.512	1.538	10	10	0,00	
	07.2023	\$	403	DKK 2.749	0	0	0,00	
	07.2023	1.562	SEK 16.867	0	(1)	(1)	0,00	
	08.2023	DKK	2.745	\$ 403	0	0	0,00	
	08.2023	SEK	16.846	1.562	1	1	0,00	
SCX	07.2023	AUD	1.585	1.036	0	(19)	(0,01)	
	07.2023	CHF	1.847	2.056	0	(9)	0,00	
	07.2023	NZD	576	349	0	(3)	0,00	
	07.2023	\$	780	AUD 1.174	2	2	0,00	
	08.2023	AUD	1.174	\$ 780	0	(2)	0,00	
SOG	07.2023	1.213	794	0	(14)	(14)	0,00	
	07.2023	\$	73.708	€ 68.519	1.047	1.047	0,25	
TOR	07.2023	AUD	642	\$ 420	0	(7)	0,00	
	07.2023	\$	955	AUD 1.445	7	7	0,00	
	07.2023	5.041	CAD 6.671	4	(4)	0	0,00	
	07.2023	8.037	£ 6.325	4	0	4	0,00	
	07.2023	8.871	¥ 1.277.400	0	(33)	(33)	(0,01)	
	07.2023	497	NZD 817	3	0	3	0,00	
	08.2023	AUD	1.445	\$ 955	0	(7)	0,00	
	08.2023	CAD	6.668	5.041	3	(3)	0,00	
	08.2023	£	6.325	8.039	0	(4)	0,00	
	08.2023	¥	1.271.983	8.871	33	33	0,01	
	08.2023	NZD	817	497	0	(3)	0,00	
UAG	07.2023	AUD	147	96	0	(2)	0,00	
	07.2023	CHF	120	134	0	(1)	0,00	
	07.2023	NOK	4.327	391	0	(13)	0,00	
	07.2023	\$	1.538	AUD 2.303	3	(8)	(5)	
	07.2023	52	CHF 47	0	0	0	0,00	
	08.2023	AUD	2.303	\$ 1.539	8	(3)	5	
	08.2023	CHF	47	52	0	0	0,00	
					\$ 2.720	\$ (994)	\$ 1.726	0,42

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	\$ 46	\$ 30	\$ 0	(1)	0,00
	07.2023	\$	132	AUD 199	0	0	0,00
	08.2023	AUD	199	\$ 132	0	0	0,00
BOA	07.2023	348	227	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	CAD	1.667	1.225	0	(35)	(0,01)
	07.2023	DKK	451	65	0	(1)	0,00
	07.2023	£	85	106	0	(1)	0,00
	07.2023	¥	16.698	119	3	3	0,00
	07.2023	NZD	69	42	0	0	0,00
	07.2023	SEK	29	3	0	0	0,00
	07.2023	\$	120	DKK 818	0	0	0,00
	07.2023	111	¥ 15.429	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	16.898	NOK 186.026	466	466	0,11	
	07.2023	388	SEK 4.190	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	817	\$ 120	0	0	0,00
	08.2023	SEK	4.185	388	0	0	0,00
BPS	07.2023	CHF	2	3	0	0	0,00
	07.2023	DKK	2	0	0	0	0,00
	07.2023	€	129	141	0	0	0,00
	07.2023	¥	496.394	3.573	138	138	0,03
	07.2023	NOK	56.578	5.263	0	(18)	0,00
	07.2023	NZD	6	4	0	0	0,00
	07.2023	\$	94	AUD 142	0	0	0,00
	07.2023	534	CHF 478	0	0	0	0,00
	07.2023	11.428	€ 10.430	0	(49)	(49)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	08.2023	AUD 142	\$ 94	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	08.2023	CHF 476	\$ 534	0	0	0	0,00
	08.2023	€ 10.430	11.444	49	0	49	0,01
CBK	08.2023	\$ 5.263	NOK 56.523	19	0	19	0,00
	07.2023	NOK 2.838	\$ 255	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	\$ 413	€ 385	7	0	7	0,00
CLY	07.2023	6.515	NOK 73.265	323	0	323	0,08
	07.2023	DKK 1.324	\$ 191	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	\$ 13	CHF 12	0	0	0	0,00
GLM	08.2023	CHF 12	\$ 13	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK 166.319	15.431	0	(94)	(94)	(0,02)
	08.2023	\$ 15.431	NOK 166.156	94	0	94	0,02
JPM	07.2023	AUD 279	\$ 182	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	\$ 1.185	¥ 169.477	0	(13)	(13)	0,00
	08.2023	¥ 168.757	\$ 1.185	13	0	13	0,00
MBC	07.2023	CAD 1	1	0	0	0	0,00
	07.2023	€ 390	421	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	£ 1.648	2.040	0	(55)	(55)	(0,01)
	07.2023	SEK 53	5	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 126	£ 101	3	0	3	0,00
MYI	07.2023	CHF 4	\$ 4	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK 4.103	382	2	0	2	0,00
	07.2023	\$ 107	DKK 730	0	0	0	0,00
SCX	08.2023	DKK 728	\$ 107	0	0	0	0,00
	07.2023	AUD 394	257	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	CHF 465	518	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	NZD 179	108	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 194	AUD 292	1	0	1	0,00
SOG	08.2023	AUD 292	\$ 194	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	301	197	0	(3)	(3)	0,00
TOR	07.2023	€ 10.297	11.077	0	(158)	(158)	(0,04)
	07.2023	AUD 159	104	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 237	AUD 359	2	0	2	0,00
	07.2023	1.261	CAD 1.668	1	(1)	0	0,00
	07.2023	2.073	£ 1.631	1	0	1	0,00
	07.2023	2.279	¥ 328.163	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	154	NZD 253	1	0	1	0,00
	08.2023	AUD 359	\$ 237	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	CAD 1.668	1.261	1	(1)	0	0,00
	08.2023	£ 1.631	2.074	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	¥ 326.772	2.279	8	0	8	0,00
UAG	08.2023	NZD 253	154	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	AUD 37	24	0	0	0	0,00
	07.2023	CHF 30	34	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 382	AUD 572	1	(2)	(1)	0,00
	07.2023	13	CHF 12	0	0	0	0,00
	07.2023	16.091	NOK 178.058	530	0	530	0,13
	08.2023	AUD 572	\$ 382	2	(1)	1	0,00
	08.2023	CHF 12	13	0	0	0	0,00
				\$ 1.665	\$ (485)	\$ 1.180	0,29
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 91	0,02

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMOGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHORDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fallig am 01.07.2038	\$ 7.000	\$ (6.204)	(1,51)
2,000 % fallig am 01.08.2053	27.750	(22.669)	(5,50)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (28.873)	(7,01)
Summe Anlagen		\$ 511.771	124,33
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (100.156)	(24,33)
Nettovermogen		\$ 411.615	100,00

## ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf Null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Advantage Fund (Forts.)

- (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
 (g) Mit dem Fonds verbunden.  
 (h) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,46 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG 3,035 %, fällig am 28.05.2032	21.06.2021	\$ 1.062	\$ 828	0,20
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	321	308	0,08
		\$ 1.383	\$ 1.136	0,28

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 1.525 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von 14.781 USD (31. Dezember 2022: 13.884 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.840 USD (31. Dezember 2022: 1.120 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 517.946	\$ 834	\$ 518.780
Investmentfonds	21.489	0	0	21.489
Pensionsgeschäfte	0	2.347	0	2.347
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	812	(2.784)	0	(1.972)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(28.873)	0	(28.873)
Summen	\$ 22.301	\$ 488.636	\$ 834	\$ 511.771

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 442.801	\$ 831	\$ 443.632
Investmentfonds	18.242	0	0	18.242
Pensionsgeschäfte	0	1.408	0	1.408
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	4.652	(41)	0	4.611
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(28.813)	0	(28.813)
Summen	\$ 22.894	\$ 415.355	\$ 831	\$ 439.080

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (4)	\$ 10	\$ 6	\$ 7	\$ 0	\$ 7
BOA	(437)	580	143	1.000	(730)	270
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	24	0	24
BPS	1.305	(1.250)	55	(629)	560	(69)
BRC	(69)	60	(9)	272	0	272
BSH	8	0	8	3	0	3
CBK	(355)	310	(45)	1.063	(1.120)	(57)
CLY	(73)	0	(73)	(8)	0	(8)
DUB	601	(460)	141	(125)	20	(105)
FAR	(10)	0	(10)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(216)	0	(216)	150	(370)	(220)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)
IND	k. A.	k. A.	k. A.	110	0	110
JPM	(389)	280	(109)	1.248	(760)	488
MBC	(282)	140	(142)	264	(90)	174
MYC	(8)	0	(8)	(5)	0	(5)
MYI	(461)	290	(171)	(909)	540	(369)
RBC	670	(660)	10	116	0	116

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
RYL	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ (2)	\$ 0	\$ (2)
SCX	(1.022)	830	(192)	992	(910)	82
SOG	660	(510)	150	77	(70)	7
SSB	14	0	14	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(453)	340	(113)	6	0	6
UAG	612	(410)	202	85	0	85

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	89,34	65,89
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	36,58	41,33
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,11	0,88
Investmentfonds	5,22	4,44
Pensionsgeschäfte	0,57	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,33	1,08
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,83)	(0,87)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,02	0,91
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,01)	(7,03)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,37)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,02	0,02
Australien	1,65	1,74
Brasilien	0,69	0,76
Bulgarien	0,55	k. A.
Kanada	0,67	0,73
Cayman Inseln	5,60	5,78
Chile	0,59	0,56
China	0,07	k. A.
Kolumbien	0,48	0,02
Tschechische Republik	0,11	0,10
Dänemark	2,62	2,67
Dominikanische Republik	0,17	0,16
Frankreich	2,99	2,83
Deutschland	2,13	2,33
Guatemala	0,09	0,10
Hongkong	0,10	0,21
Ungarn	1,03	0,03
Indonesien	1,16	1,10
Irland	5,34	5,34
Israel	1,21	0,98
Italien	7,56	7,32
Elfenbeinküste	0,51	0,35
Japan	5,88	4,40
Kasachstan	0,42	k. A.
Luxemburg	1,07	0,67
Malaysia	0,24	0,98
Mexiko	k. A.	0,28
Marokko	k. A.	0,37
Multinational	0,24	0,25
Niederlande	1,30	1,59
Neuseeland	0,07	0,07
Norwegen	0,19	0,20
Peru	0,26	1,68
Philippinen	0,09	0,08
Polen	0,77	0,03
Portugal	0,16	0,09
Katar	0,08	0,08
Rumänien	0,92	0,63
Russland	0,31	0,20
Saudi-Arabien	0,85	k. A.
Serbien	0,66	0,88
Singapur	0,31	0,20
Slowenien	0,19	0,18
Südafrika	0,09	0,09
Südkorea	2,18	0,78
Spanien	1,05	1,04
Supranational	0,72	0,71
Schweiz	1,44	1,64
Thailand	k. A.	0,26
Vereinigte Arabische Emirate	0,05	0,05
Großbritannien	8,00	9,05
Vereinigte Staaten	62,35	45,54

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kurzfristige Instrumente	0,80	2,95
Investmentfonds	5,22	4,44
Pensionsgeschäfte	0,57	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,34	1,09
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,17)	(0,15)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,05	0,00
Zinsswaps — Basiswaps	k. A.	0,01
Zinsswaps	(0,71)	(0,73)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,05	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,08	0,08
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,24)	(0,27)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	0,02	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,64)	0,37
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,75	0,68
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,01)	(7,03)
Sonstige Aktiva und Passiva	(24,33)	(06,97)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Pepper SPARKZ Trust 5,160 % fällig am 17.08.2028 AUD	3.783	2.517	0,02
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Interstar Millennium Trust 4,530 % fällig am 27.03.2038	7	4	0,00
RESIMAC Bastille Trust 6,093 % fällig am 05.09.2057	1.242	1.242	0,01
		1.246	0,01
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026 AUD	146.900	87.513	0,69
1,000 % fällig am 21.12.2030	14.400	7.748	0,06
1,250 % fällig am 21.05.2032	13.600	7.195	0,06
1,750 % fällig am 21.06.2051	16.900	6.552	0,05
2,500 % fällig am 21.05.2030	17.800	10.800	0,09
4,500 % fällig am 21.04.2033	63.300	43.746	0,35
		163.554	1,30
Summe Australien		167.317	1,33
<b>KANADA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	15.200	14.940	0,12
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,650 % fällig am 12.08.2053 CAD	7.100	5.059	0,04
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.06.2028	650	458	0,00
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.12.2044 (e)	10.550	7.979	0,06
CPPIB Capital, Inc. 0,750 % fällig am 02.02.2037	2.200	1.699	0,01
Ontario Teachers' Finance Trust 0,900 % fällig am 20.05.2041	9.700	6.927	0,06
Province of Ontario 0,010 % fällig am 25.11.2030	30.200	25.820	0,21
		42.883	0,34
Summe Kanada		62.882	0,50
<b>CAYMAN INSELN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Apidos CLO 6,340 % fällig am 15.04.2031	4.500	4.455	0,04
6,420 % fällig am 20.10.2031	12.240	12.116	0,10
Atlas Senior Loan Fund Ltd. 6,410 % fällig am 16.01.2030	8.702	8.660	0,07
Benefit Street Partners CLO Ltd. 6,340 % fällig am 20.04.2031	8.370	8.268	0,07
BlueMountain CLO Ltd. 6,340 % fällig am 15.07.2031	8.250	8.142	0,06
Carbone CLO Ltd. 6,390 % fällig am 20.01.2031	6.805	6.759	0,05
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,360 % fällig am 15.10.2030	2.786	2.774	0,02
6,371 % fällig am 15.05.2031	5.938	5.872	0,05
Catamaran CLO Ltd. 6,373 % fällig am 22.04.2030	22.846	22.709	0,18
CBAM Ltd. 6,500 % fällig am 20.07.2030	17.337	17.272	0,14
Deer Creek CLO Ltd. 6,430 % fällig am 20.10.2030	4.578	4.547	0,04
Dryden Senior Loan Fund 6,230 % fällig am 15.04.2031	10.400	10.318	0,08
Gallatin CLO Ltd. 6,311 % fällig am 21.01.2028	3.734	3.730	0,03

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ICG U.S. CLO Ltd. 6,353 % fällig am 22.07.2031	13.700	13.545	0,11
Marble Point CLO Ltd. 6,442 % fällig am 18.12.2030	14.688	14.476	0,11
Midocean Credit CLO 6,385 % fällig am 19.07.2028	1.507	1.508	0,01
OZLM Ltd. 6,348 % fällig am 16.05.2030	6.812	6.765	0,05
6,400 % fällig am 20.01.2031	3.720	3.684	0,03
Palmer Square CLO Ltd. 6,390 % fällig am 17.01.2031	3.407	3.385	0,03
Regatta Funding Ltd. 6,510 % fällig am 17.10.2030	7.848	7.815	0,06
Sound Point CLO Ltd. 6,368 % fällig am 26.07.2031	1.200	1.179	0,01
Venture CLO Ltd. 6,140 % fällig am 15.04.2027	1.456	1.451	0,01
		169.430	1,35
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	431	364	0,00
Gaci First Investment Co. 4,750 % fällig am 14.02.2030	23.000	22.668	0,18
4,875 % fällig am 14.02.2035	22.100	21.216	0,17
5,125 % fällig am 14.02.2053	14.400	12.978	0,10
KSA Sukuk Ltd. 5,268 % fällig am 25.10.2028	8.500	8.690	0,07
QNB Finance Ltd. 1,375 % fällig am 26.01.2026	2.060	1.868	0,02
Sands China Ltd. 5,625 % fällig am 08.08.2025	4.100	4.002	0,03
5,900 % fällig am 08.08.2028	9.300	8.874	0,07
Tencent Holdings Ltd. 3,595 % fällig am 19.01.2028	8.500	7.915	0,06
		88.575	0,70
Summe Cayman Inseln		258.005	2,05
<b>CHINA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
China Government International Bond 3,190 % fällig am 15.04.2053 CNY	61.240	8.736	0,07
<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Czech Republic Government International Bond 2,500 % fällig am 25.08.2028 CZK	2.900	121	0,00
<b>DÄNEMARK</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050 DKK	505.214	50.931	0,40
1,500 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.07.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	611.150	61.309	0,49
1,500 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	40.389	4.459	0,03
2,000 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	1.259.811	129.747	1,03
1,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	8.153	899	0,01
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
2,500 % fällig am 01.10.2036 DKK	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
3,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
5,000 % fällig am 01.10.2053	249.403	35.995	0,28
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	117.711	12.401	0,10
1,000 % fällig am 01.10.2053	35.087	3.656	0,03
1,500 % fällig am 01.10.2053	8.549	943	0,01
2,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2036	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2047	0	0	0,00
3,000 % fällig am 01.07.2046	0	0	0,00
4,797 % fällig am 01.01.2038	0	0	0,00
Summe Dänemark		300.340	2,38
<b>FINNLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nordea Kiinnitysluotopankki Oyj 0,625 % fällig am 23.05.2025	1.000	1.028	0,01
<b>FRANKREICH</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
BNP Paribas S.A. 2,219 % fällig am 09.06.2026	5.200	4.812	0,04
Dexia Credit Local S.A. 0,000 % fällig am 21.01.2028	9.100	8.532	0,07
(c)	2.300	2.385	0,02
0,500 % fällig am 17.01.2025			
Societe Generale S.A. 1,488 % fällig am 14.12.2026	21.700	19.108	0,15
2,226 % fällig am 21.01.2026	24.200	22.487	0,18
2,797 % fällig am 19.01.2028	17.500	15.517	0,12
6,221 % fällig am 15.06.2033	13.800	12.859	0,10
6,446 % fällig am 10.01.2029	3.100	3.108	0,02
6,691 % fällig am 10.01.2034	12.200	12.429	0,10
		101.237	0,80
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.06.2044	6.750	4.365	0,03
0,500 % fällig am 25.05.2072	15.250	6.555	0,05
0,750 % fällig am 25.05.2052	115.450	68.689	0,55
2,000 % fällig am 25.05.2048	73.081	63.069	0,50
3,250 % fällig am 25.05.2045	19.100	20.910	0,17
		163.588	1,30
Summe Frankreich		264.825	2,10
<b>DEUTSCHLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Aareal Bank AG 0,625 % fällig am 14.02.2025	800	737	0,01
Deutsche Bank AG 0,050 % fällig am 20.11.2024	19.600	20.236	0,16
1,000 % fällig am 19.11.2025	400	412	0,00
1,375 % fällig am 03.09.2026	32.100	32.194	0,26
1,375 % fällig am 17.02.2032	14.300	11.576	0,09
1,625 % fällig am 20.01.2027	54.400	52.781	0,42
1,750 % fällig am 19.11.2030	20.500	17.699	0,14
1,875 % fällig am 23.02.2028	5.900	5.704	0,05
2,625 % fällig am 16.12.2024	23.600	27.926	0,22
3,547 % fällig am 18.09.2031	12.700	10.555	0,08
3,729 % fällig am 14.01.2032 (h)	2.000	1.514	0,01
3,961 % fällig am 26.11.2025	26.750	25.519	0,20
4,100 % fällig am 13.01.2026	1.800	1.686	0,01
6,119 % fällig am 14.07.2026	19.300	19.092	0,15
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	12.050	12.299	0,10
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 5,000 % fällig am 19.03.2024 AUD	1.500	1.001	0,01
Summe Deutschland		240.931	1,91
<b>HONGKONG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023	14.200	14.035	0,11
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3,150 % fällig am 12.05.2025	8.300	7.750	0,06
Summe Hongkong		21.785	0,17

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS		
<b>UNGARN</b>								<b>JAPAN</b>					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
Hungary Government International Bond				Man GLG Euro CLO DAC	€	10.288	10,934	0,09	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$	29.800	27,298	0,22
3,000 % fällig am 27.10.2027	HUF	117.500	286	0,04	Oak Hill European Credit Partners DAC	24.100	25.607	0,20	1,412 % fällig am 17.07.2025		33.700	31,776	0,25
5,000 % fällig am 22.02.2027	€	4.100	4,507	0,04	3,940 % fällig am 20.10.2031				2,193 % fällig am 25.02.2025				
6,250 % fällig am 22.09.2032	\$	17.200	17,665	0,14	OCF Euro CLO DAC	22.300	23.696	0,19	Mizuho Financial Group, Inc.		9.000	8,994	0,07
7,625 % fällig am 29.03.2041		100	113	0,00	4,091 % fällig am 22.09.2034				1,241 % fällig am 10.07.2024		11.000	10,949	0,09
Summe Ungarn		22.571	0,18	Palmer Square European Loan Funding DAC					3,922 % fällig am 11.09.2024		13.000	13,016	0,10
				3,897 % fällig am 15.10.2031	11.915	12.740	0,10	Nissan Motor Co. Ltd.		2.100	1,954	0,01	
<b>INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>													
Project Mercury	€	25.000	27,275	0,22	3,907 % fällig am 15.07.2031	3.501	3,730	0,03	3,522 % fällig am 17.09.2025		11.100	9,821	0,08
TBD % fällig am 17.07.2030				0,00	3,957 % fällig am 15.04.2031	16.011	17,161	0,14	Nomura Holdings, Inc.		11.100	9,821	0,08
<b>IRLAND</b>													
<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>													
Accunia European CLO DAC				Sculptor European CLO DAC				Sumitomo Mitsui Banking Corp.	€	43.700	43,597	0,35	
4,127 % fällig am 15.07.2030	5.003	5,389	0,04	3,916 % fällig am 14.01.2032	35.800	38,368	0,30	0,010 % fällig am 10.09.2025		26.500	23,590	0,19	
Adagio CLO DAC				Segovia European CLO DAC				0,409 % fällig am 07.11.2029		35.700	38,522	0,30	
3,897 % fällig am 15.10.2031	10.250	10,968	0,09	4,080 % fällig am 20.07.2032	13.700	14,563	0,12	0,550 % fällig am 06.11.2023		26.400	25,520	0,20	
Aqueduct European CLO DAC				Tikehau CLO DAC				2,440 % fällig am 18.06.2024		35.700	35,870	0,28	
3,840 % fällig am 20.07.2030	11.521	12,407	0,10	4,144 % fällig am 04.08.2034	10.600	11,300	0,09	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$	31.100	31,106	0,25	
Ares European CLO				Toro European CLO DAC				5,520 % fällig am 13.01.2028		31.100	31,106	0,25	
3,837 % fällig am 15.10.2030	8.148	8,724	0,07	3,995 % fällig am 12.01.2032	9.300	9,952	0,08	6,125 % fällig am 19.07.2023		34.800	32,250	0,26	
Ares European CLO DAC				4,133 % fällig am 15.02.2034	22.750	24,156	0,19	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.	€	34.800	32,250	0,26	
3,787 % fällig am 15.04.2030	6.983	7,472	0,06	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,010 % fällig am 15.10.2027			334,263	2,65	
3,837 % fällig am 15.10.2030	7.453	7,979	0,06	<b>AerCap Ireland Capital DAC</b>									
3,957 % fällig am 15.10.2031	24.100	25,843	0,20	1,650 % fällig am 29.10.2024	\$	5.450	5,124	0,04	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
4,050 % fällig am 20.04.2032	9.100	9,742	0,08	1,750 % fällig am 29.10.2024		5.300	4,980	0,04	<b>Development Bank of Japan, Inc.</b>				
Armada Euro CLO DAC				2,450 % fällig am 29.10.2026		200	179	0,00	1,750 % fällig am 28.08.2024	\$	13.400	12,815	0,10
3,897 % fällig am 15.07.2031	8.996	9,602	0,08	3,000 % fällig am 15.01.2025		1.300	1,245	0,01	1,875 % fällig am 22.01.2024		12.800	12,226	0,10
Aurium CLO DAC				5,772 % fällig am 29.09.2023	7.250	7,240	0,05	Japan Finance Organization for Municipalities		1.400	1,268	0,01	
3,907 % fällig am 16.01.2031	28.758	30,772	0,24	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				3,000 % fällig am 12.03.2024		13.100	12,856	0,10	
Avoca CLO DAC				<b>Bruegel DAC</b>				Japan Government International Bond					
3,997 % fällig am 15.10.2032	9.800	10,452	0,08	4,183 % fällig am 22.05.2031	€	341	351	0,00	0,005 % fällig am 01.02.2024	¥	700.000	4,848	0,04
Bain Capital Euro CLO DAC				European Loan Conduit DAC				0,005 % fällig am 01.03.2024		15.550.000	107,704	0,85	
3,940 % fällig am 20.01.2032	12.427	13,260	0,11	4,358 % fällig am 17.02.2030	3.058	3,267	0,03	0,005 % fällig am 01.04.2024		8.140.000	56,386	0,45	
Black Diamond CLO DAC				Summe Irland				0,005 % fällig am 01.05.2024		5.580.000	38,654	0,31	
4,303 % fällig am 15.05.2032	5.400	5,764	0,05	<b>ISRAEL</b>				0,005 % fällig am 01.10.2024		17.912.450	124,140	0,98	
Blackrock European CLO DAC				<b>ISRAEL STAATSEMISSIONEN</b>				0,100 % fällig am					
3,797 % fällig am 15.10.2031	10.800	11,513	0,09	<b>Israel Government International Bond</b>				10.03.2028 (e)	14.532.141	105,974	0,84		
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				1,000 % fällig am 31.03.2030	ILS	800	181	0,00	0,200 % fällig am 20.06.2036		362.750	2,376	0,02
3,897 % fällig am 15.01.2031	11.184	11,956	0,09	1,500 % fällig am 30.11.2023	102.800	27,353	0,22	0,500 % fällig am 20.09.2046		8.768.000	53,243	0,42	
BNPP AM Euro CLO DAC				2,000 % fällig am 31.03.2027	87.900	22,160	0,17	0,500 % fällig am 21.03.2049		11.468.000	67,241	0,53	
4,031 % fällig am 22.07.2032	12.700	13,539	0,11	4,500 % fällig am 17.01.2033	\$	11.300	11,140	0,09	0,700 % fällig am 20.12.2048		7.461.650	46,185	0,37
Cairn CLO BV				Summe Israel				0,700 % fällig am 20.06.2051		202.000	1,217	0,01	
3,957 % fällig am 15.10.2031	16.400	17,538	0,14	<b>ITALIEN</b>				1,000 % fällig am 20.03.2052		70.000	454	0,00	
Carlyle Euro CLO DAC				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				1,300 % fällig am 20.06.2052		500.000	3,492	0,03	
3,953 % fällig am 15.08.2030	6.384	6,809	0,05	<b>AMCO - Asset Management Co. SpA</b>				Tokyo Metropolitan Government	\$	18.600	16,962	0,14	
4,213 % fällig am 15.08.2032	3.200	3,413	0,03	0,750 % fällig am 20.04.2028	€	300	272	0,00	0,750 % fällig am 16.07.2025			668,041	5,30
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				1,500 % fällig am 17.07.2023		13.775	15,018	0,12	Summe Japan			1.002,304	7,95
4,073 % fällig am 15.11.2031	11.500	12,310	0,10	4,625 % fällig am 06.02.2027		17.500	18,980	0,15	<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				
Contego CLO DAC				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
3,851 % fällig am 23.01.2030	6.283	6,719	0,05	0,875 % fällig am 08.10.2027	8.000	7,793	0,06	<b>G City Europe Ltd.</b>					
CVC Cordatus Loan Fund DAC				2,000 % fällig am 29.01.2024	26.600	28,640	0,23	4,250 % fällig am 11.09.2025	€	10.000	9,546	0,07	
3,855 % fällig am 21.07.2030	20.933	22,461	0,18	2,625 % fällig am 28.04.2025	2.800	2,868	0,03	<b>LUXEMBURG</b>					
Dryden Euro CLO DAC				Nexi SpA				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
3,837 % fällig am 15.04.2033	6.600	7,044	0,06	1,625 % fällig am 30.04.2026	6.639	6,618	0,05	<b>Aroundtown S.A.</b>					
4,183 % fällig am 15.05.2034	23.450	25,036	0,20	UniCredit SpA				<b>0,000 % fällig am</b>					
Griffith Park CLO DAC				7,830 % fällig am 04.12.2023	\$	26.210	26,367	0,21	16.07.2026 (c)		11.000	9,202	0,07
Harvest CLO DAC				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				0,375 % fällig am 15.04.2027		1.700	1,335	0,01	
3,880 % fällig am 20.10.2031	15.500	16,566	0,13	<b>Cassa Depositi e Prestiti SpA</b>				5,375 % fällig am 21.03.2029	\$	2.700	2,001	0,02	
3,937 % fällig am 15.07.2031	9.850	10,488	0,08	5,750 % fällig am 05.05.2026	21.500	21,235	0,17	<b>CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan</b>					
4,027 % fällig am 15.01.2032	22.300	23,808	0,19	Italy Government International Bond				<b>European Core Fund</b>					
4,250 % fällig am 26.06.2030	8.818	9,427	0,07	6,000 % fällig am 04.08.2028	£	5.684	7,055	0,05	0,900 % fällig am 12.10.2029	€	200	160	0,00
Jubilee CLO DAC				<b>ISRAEL</b>				CPI Property Group S.A.					
3,777 % fällig am 15.04.2030	20.800	22,168	0,18	<b>ISRAEL STAATSEMISSIONEN</b>				1,625 % fällig am 23.04.2027		16.100	12,839	0,10	
3,827 % fällig am 15.04.2031	1.100	1,170	0,01	<b>ISRAEL STAATSEMISSIONEN</b>				1,750 % fällig am 14.01.2030		17.000	11,257	0,09	
4,326 % fällig am 15.12.2029	1.511	1,630	0,01	<b>ISRAEL STAATSEMISSIONEN</b>				2,750 % fällig am 12.05.2026		1.400	1,243	0,01	
Laurelin DAC				<b>ISRAEL STAATSEMISSIONEN</b>				2,750 % fällig am 22.01.2028	£	1.000	852	0,01	
3,920 % fällig am 20.10.2031	15.000	16,070	0,13	<b>ISRAEL STAATSEMISSIONEN</b>				Logicor Financing SARL					
Madison Park Euro Funding DAC				<b>ISRAEL STAATSEMISSIONEN</b>				0,625 % fällig am 17.11.2025	€	4.600	4,402	0,03	
3,927 % fällig am 15.01.2032	22.900	24,461	0,19	<b>ISRAEL STAATSEMISSIONEN</b>				0,750 % fällig am 15.07.2024		10.900	11,337	0,09	
3,977 % fällig am 15.07.2032	7.300	7,768	0,06	<b>ISRAEL STAATSEMISSIONEN</b>				2,250 % fällig am 13.05.2025		2.000	2,031	0,02	

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>			
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^	\$	500	0,00
		56.689	0,45
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Miravet SARL 4,265 % fällig am 26.05.2065	€	13.365	0,11
Summe Luxemburg		71.045	0,56
<b>MALAYSIA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Petronas Capital Ltd. 2,480 % fällig am 28.01.2032	\$	5.500	0,04
3,500 % fällig am 21.04.2030		8.600	0,06
4,550 % fällig am 21.04.2050		6.100	0,04
4,800 % fällig am 21.04.2060		5.000	0,04
		22.862	0,18
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Malaysia Government International Bond 2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	36.118	0,06
Malaysia Government Investment Issue 3,465 % fällig am 15.10.2030		21.759	0,03
		11.684	0,09
Summe Malaysia		34.546	0,27
<b>MEXIKO</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 15.03.2115	€	800	0,01
5,000 % fällig am 27.04.2051 (i)	\$	7.800	0,05
Summe Mexiko		7.429	0,06
<b>MULTINATIONAL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Preferred Term Securities Ltd. 5,862 % fällig am 22.12.2036		8.973	0,07
5,952 % fällig am 22.03.2038		2.939	0,02
Summe multinational		10.931	0,09
<b>NIEDERLANDE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
ABN AMRO Bank NV 1,125 % fällig am 12.01.2032	€	300	0,00
Coöperatieve Rabobank UA 3,758 % fällig am 06.04.2033	\$	2.300	0,02
<b>CTP NV</b>			
0,625 % fällig am 27.09.2026	€	10.500	0,07
0,875 % fällig am 20.01.2026		14.100	0,11
1,500 % fällig am 27.09.2031		6.500	0,04
<b>ING Groep NV</b>			
4,100 % fällig am 02.10.2023	\$	2.600	0,02
6,533 % fällig am 02.10.2023		2.400	0,02
<b>Sagax Euro MTN NL BV</b>			
1,625 % fällig am 24.02.2026	€	11.900	0,09
		46.246	0,37
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Domi BV 4,376 % fällig am 15.06.2051		120	0,00
Dutch Property Finance BV 3,872 % fällig am 28.04.2051		124	0,00
3,892 % fällig am 28.07.2054		228	0,00
3,892 % fällig am 28.07.2058		13.820	0,12
<b>Eurosaill BV</b>			
4,677 % fällig am 17.10.2040		39	0,00
<b>Jubilee Place BV</b>			
4,007 % fällig am 17.07.2058		10.221	0,09
4,177 % fällig am 17.10.2057		5.612	0,05
		32.872	0,26
Summe Niederlande		79.118	0,63

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>NEUSEELAND</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Auckland Council 1,000 % fällig am 19.01.2027	€	5.800	0,04
New Zealand Government International Bond 1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD	22.600	0,09
2,000 % fällig am 20.09.2025		1.279	0,01
Summe Neuseeland		17.637	0,14
<b>NORWEGEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Kommunalbanken A/S 0,625 % fällig am 20.04.2026	€	600	0,00
1,900 % fällig am 19.01.2027	AUD	22.000	0,11
5,250 % fällig am 15.07.2024		3.300	0,02
Norway Government International Bond 1,250 % fällig am 17.09.2031	NOK	1.900	0,00
1,750 % fällig am 13.03.2025		86.700	0,06
1,750 % fällig am 17.02.2027		1.100	0,00
2,000 % fällig am 26.04.2028		7.300	0,01
Summe Norwegen		24.767	0,20
<b>PERU</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Peru Government International Bond 2,780 % fällig am 01.12.2060	\$	6.000	0,03
3,230 % fällig am 28.07.2121		4.200	0,02
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	5.817	0,01
6,150 % fällig am 12.08.2032		40.948	0,09
Summe Peru		18.643	0,15
<b>POLEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Poland Government International Bond 3,875 % fällig am 14.02.2033	€	15.400	0,13
4,250 % fällig am 14.02.2043		3.400	0,03
4,875 % fällig am 04.10.2033	\$	6.400	0,05
5,500 % fällig am 16.11.2027		2.700	0,02
5,500 % fällig am 04.04.2053		5.800	0,05
Summe Polen		35.260	0,28
<b>PORTUGAL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Espírito Santo S.A. 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	€	6.900	0,02
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^		1.900	0,00
Summe Portugal		2.352	0,02
<b>KATAR</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
QatarEnergy 2,250 % fällig am 12.07.2031	\$	8.000	0,05
3,300 % fällig am 12.07.2051		5.100	0,03
		10.474	0,08
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
Qatar National Bank QPSC 5,966 % fällig am 10.10.2023		4.600	0,04
Summe Katar		15.074	0,12
<b>RUMÄNIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Romania Government International Bond 1,375 % fällig am 02.12.2029	€	6.560	0,04
1,750 % fällig am 13.07.2030		16.600	0,11
2,000 % fällig am 28.01.2032		1.000	0,01
2,000 % fällig am 14.04.2033		2.150	0,01
2,124 % fällig am 16.07.2031 (i)		2.600	0,02
2,125 % fällig am 07.03.2028		19.300	0,14
2,625 % fällig am 02.12.2040		7.400	0,04
2,750 % fällig am 14.04.2041		7.000	0,04
2,875 % fällig am 13.04.2042		17.300	0,09
5,000 % fällig am 27.09.2026		6.800	0,06
6,625 % fällig am 27.09.2029		8.500	0,08
Summe Rumänien		80.717	0,64

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>SAUDI-ARABIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Saudi Arabian Oil Co. 2,250 % fällig am 24.11.2030	\$	12.600	0,08
3,250 % fällig am 24.11.2050		6.500	0,04
3,500 % fällig am 24.11.2070		1.600	0,01
		16.092	0,13
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Saudi Arabia Government International Bond 3,250 % fällig am 22.10.2030		3.100	0,02
4,750 % fällig am 18.01.2028		32.400	0,25
4,875 % fällig am 18.07.2033		33.500	0,27
5,000 % fällig am 18.01.2053		2.700	0,02
		70.992	0,56
Summe Saudi-Arabien		87.084	0,69
<b>SINGAPUR</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,450 % fällig am 19.05.2028		1.500	0,01
5,340 % fällig am 19.05.2063		8.400	0,07
Summe Singapur		9.982	0,08
<b>SLOWENIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % fällig am 27.01.2025	€	11.200	0,09
Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030		3.500	0,03
3,650 % fällig am 19.11.2029		8.300	0,06
Summe Slowenien		22.762	0,18
<b>SÜDKOREA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
South Korea Government International Bond 2,000 % fällig am 10.06.2031	KRW	30.643.570	0,16
2,125 % fällig am 10.06.2027		16.365.000	0,09
2,375 % fällig am 10.12.2027		14.900.000	0,08
2,375 % fällig am 10.12.2028		69.980.000	0,39
2,625 % fällig am 10.06.2028		32.730.000	0,19
3,250 % fällig am 10.06.2033		68.223.770	0,40
4,250 % fällig am 10.12.2032		166.494.540	1,05
5,500 % fällig am 10.03.2028		14.900.000	0,10
Summe Südkorea		310.745	2,46
<b>SPANIEN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	€	5.189	0,04
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Santander S.A. 1,849 % fällig am 25.03.2026	\$	5.800	0,04
4,175 % fällig am 24.03.2028		2.000	0,02
CaixaBank S.A. 1,750 % fällig am 24.10.2023	€	10.400	0,09
		18.339	0,15
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Fondo de Titulacion de Activos Santander Hipotecario 3,325 % fällig am 18.01.2049		389	0,00
Fondo de Titulacion de Activos UCI 3,097 % fällig am 15.09.2041		761	0,01
		809	0,01
		1.228	0,01
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035		3.900	0,03
Autonomous Community of Madrid 1,571 % fällig am 30.04.2029		1.300	0,01
Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 31.10.2071		7.375	0,03
1,900 % fällig am 31.10.2052		2.700	0,02



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		
		MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS	
3,450 % fällig am 30.07.2066	€ 53.300	\$ 53.029	0,42	NatWest Group PLC	\$ 19.200	\$ 18.333	0,15	Southern Pacific Financing PLC	£ 542	\$ 679	0,01	
5,250 % fällig am 06.04.2029	£ 800	995	0,01	5,076 % fällig am 27.01.2030				5,221 % fällig am 10.03.2044				
		65.384	0,52	NatWest Markets PLC	€ 7.721	8.189	0,06	Stratton Mortgage Funding PLC	41.687	53.004	0,42	
Summe Spanien		90.469	0,72	1,000 % fällig am 28.05.2024				5,765 % fällig am 12.03.2052	15.710	19.903	0,16	
<b>SUPRANATIONAL</b>				Santander UK Group Holdings PLC	\$ 20.100	19.949	0,16	Towd Point Mortgage Funding PLC				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,796 % fällig am 15.11.2024	1.900	1.915	0,02	5,635 % fällig am 20.10.2051	12.486	15.897	0,13	
<b>Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung</b>				6,534 % fällig am 10.01.2029				5,841 % fällig am 20.07.2045	21.156	26.909	0,21	
0,500 % fällig am 01.09.2023	AUD 5.400	3.571	0,03	Santander UK PLC	£ 16.900	21.517	0,17	Trinity Square PLC	14.720	18.687	0,15	
0,500 % fällig am 12.12.2023	4.000	2.607	0,02	5,234 % fällig am 12.02.2027				5,316 % fällig am 15.07.2059				
Europäische Investitionsbank				Standard Chartered PLC	\$ 13.400	12.997	0,10	Twin Bridges PLC	10.461	13.252	0,11	
0,500 % fällig am 10.08.2023	10.200	6.763	0,05	0,991 % fällig am 12.01.2025				5,715 % fällig am 12.03.2055				
4,600 % fällig am 30.01.2037	CAD 1.050	822	0,01	1,822 % fällig am 23.11.2025				Uropa Securities PLC				
Inter-American Development Bank				2,608 % fällig am 12.01.2028				4,729 % fällig am 10.10.2040	53	65	0,00	
2,500 % fällig am 14.04.2027	AUD 15.200	9.396	0,07	2,678 % fällig am 29.06.2032				Warwick Finance Residential Mortgages PLC				
Summe Supranational		23.159	0,18	TP ICAP Finance PLC	£ 9.800	9.211	0,07	0,000 % fällig am 21.12.2049 (c)	1	5.914	0,05	
<b>SCHWEDEN</b>				2,625 % fällig am 18.11.2028		255.425	2,02	5,865 % fällig am 21.12.2049	33.599	42.513	0,34	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Alba PLC	€ 97	101	0,00	6,564 % fällig am 21.12.2049	7.280	9.168	0,07	
<b>Molnlycke Holding AB</b>				3,686 % fällig am 15.12.2038	€ 4.450	5.414	0,04	7,064 % fällig am 21.12.2049	3.640	4.559	0,04	
1,875 % fällig am 28.02.2025	€ 400	419	0,00	5,171 % fällig am 15.12.2038				7,564 % fällig am 21.12.2049	2.080	2.597	0,02	
<b>SCHWEIZ</b>				Avon Finance PLC	20.123	25.577	0,20	8,064 % fällig am 21.12.2049	2.080	2.553	0,02	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,809 % fällig am 20.09.2048						449.982	3,57	
<b>Credit Suisse AG</b>				Brass PLC	4.372	5.574	0,04	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
0,250 % fällig am 05.01.2026	11.800	11.508	0,09	5,430 % fällig am 16.11.2066				United Kingdom Gilt				
6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	\$ 30.906	30.793	0,25	Business Mortgage Finance PLC	5	7	0,00	0,625 % fällig am 22.10.2050	46.810	24.193	0,19	
<b>UBS Group AG</b>				5,822 % fällig am 15.02.2041				1,250 % fällig am 31.07.2051	31.025	19.572	0,16	
2,193 % fällig am 05.06.2026	400	367	0,00	Canada Square Funding PLC	16.815	21.262	0,17	1,500 % fällig am 31.07.2053	11.300	7.503	0,06	
2,875 % fällig am 02.04.2032	€ 19.700	18.760	0,15	5,682 % fällig am 17.06.2058						51.268	0,41	
3,091 % fällig am 14.05.2032	\$ 27.800	22.499	0,18	5,852 % fällig am 17.06.2058				Summe Großbritannien			757.184	6,00
3,869 % fällig am 12.01.2029	12.550	11.356	0,09	6,152 % fällig am 17.12.2057				<b>USA</b>				
4,194 % fällig am 01.04.2031	1.600	1.425	0,01	Eurohome UK Mortgages PLC	132	162	0,00	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
4,488 % fällig am 12.05.2026	1.500	1.451	0,01	5,137 % fällig am 15.06.2044				Accredited Mortgage Loan Trust				
4,550 % fällig am 17.04.2026	400	385	0,00	Eurosail PLC	€ 10	10	0,00	5,410 % fällig am 25.09.2036	\$ 1.302	1.281	0,01	
6,373 % fällig am 15.07.2026	900	895	0,01	3,629 % fällig am 13.03.2045	€ 10	418	0,00	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
6,442 % fällig am 11.08.2028	30.600	30.738	0,24	3,709 % fällig am 13.03.2045	400	418	0,00	5,270 % fällig am 25.10.2036	4	2	0,00	
6,537 % fällig am 12.08.2033	5.700	5.843	0,05	3,766 % fällig am 15.12.2044	148	159	0,00	5,410 % fällig am 25.12.2036	6.042	3.317	0,03	
7,375 % fällig am 07.09.2033	£ 6.900	9.195	0,07	5,140 % fällig am 13.03.2045	£ 52	65	0,00	5,450 % fällig am 25.07.2036	2.155	801	0,01	
7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 15.900	19.238	0,15	5,690 % fällig am 13.09.2045	866	1.089	0,01	5,945 % fällig am 25.01.2035	710	649	0,01	
Summe Schweiz		164.453	1,30	5,940 % fällig am 13.06.2045	49	61	0,00	6,050 % fällig am 25.12.2034	947	849	0,01	
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				Great Hall Mortgages PLC	€ 237	256	0,00	6,050 % fällig am 25.08.2035	4.150	3.988	0,03	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,677 % fällig am 18.03.2039	€ 144	156	0,00	Ameritrust Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through				
<b>MDGH GMTN RSC Ltd.</b>				3,697 % fällig am 18.06.2038	£ 4.670	5.709	0,05	Certificates				
5,500 % fällig am 28.04.2033	\$ 7.000	7.370	0,06	5,262 % fällig am 18.03.2039	\$ 46	46	0,00	5,900 % fällig am 25.01.2036	600	577	0,00	
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				5,644 % fällig am 18.06.2039				6,125 % fällig am 25.07.2035	800	745	0,01	
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Ludgate Funding PLC	€ 451	470	0,00	6,200 % fällig am 25.11.2034	630	617	0,01	
<b>PCL Funding PLC</b>				3,212 % fällig am 01.01.2061				Amortizing Residential Collateral Trust				
5,469 % fällig am 15.10.2025	£ 400	509	0,00	Mansard Mortgages PLC	£ 5.743	7.154	0,06	5,850 % fällig am 25.10.2031	27	26	0,00	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,651 % fällig am 15.12.2049				Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
<b>AstraZeneca PLC</b>				Newgate Funding PLC	€ 424	438	0,00	6,090 % fällig am 25.06.2029	41	39	0,00	
5,995 % fällig am 17.08.2023	\$ 400	400	0,00	3,704 % fällig am 01.12.2050	€ 1.632	1.607	0,01	Argent Securities Trust				
<b>Barclays PLC</b>				3,827 % fällig am 01.12.2050	655	689	0,01	5,450 % fällig am 25.07.2036	6.152	5.246	0,04	
3,125 % fällig am 17.01.2024	£ 800	999	0,01	4,126 % fällig am 15.12.2050	1.951	1.953	0,02	Asset-Backed Funding Certificates Trust				
4,375 % fällig am 12.01.2026	\$ 2.200	2.114	0,02	4,776 % fällig am 15.12.2050	£ 502	609	0,01	5,850 % fällig am 25.06.2034	236	229	0,00	
6,467 % fällig am 26.06.2024	AUD 4.000	2.684	0,02	5,026 % fällig am 15.12.2050	€ 3.406	3.312	0,03	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
<b>Haleon UK Capital PLC</b>				5,038 % fällig am 01.12.2050	£ 604	727	0,01	5,765 % fällig am 25.02.2036	2.325	2.258	0,02	
3,125 % fällig am 24.03.2025	\$ 16.600	15.868	0,13	5,078 % fällig am 01.12.2050	£ 362	429	0,00	5,790 % fällig am 25.12.2034	4	4	0,00	
<b>HSBC Holdings PLC</b>				6,005 % fällig am 15.12.2050	2.449	2.987	0,02	5,810 % fällig am 25.10.2032	3	2	0,00	
2,848 % fällig am 04.06.2031	9.900	8.220	0,06	6,255 % fällig am 15.12.2050	2.181	2.555	0,02	6,150 % fällig am 25.11.2042	18	18	0,00	
2,999 % fällig am 10.03.2026	1.300	1.233	0,01	Paragon Mortgages PLC	\$ 23	22	0,00	6,155 % fällig am 25.06.2035	1.412	1.352	0,01	
3,973 % fällig am 22.05.2030	21.700	19.506	0,15	5,541 % fällig am 15.11.2038	£ 2.799	3.561	0,03	6,200 % fällig am 25.08.2037	2.140	1.796	0,01	
4,041 % fällig am 13.03.2028	7.300	6.842	0,05	5,752 % fällig am 15.05.2045				Centex Home Equity Loan Trust				
4,583 % fällig am 19.06.2029	19.600	18.464	0,15	Polaris PLC	6.008	7.604	0,06	5,610 % fällig am 25.07.2032	16	14	0,00	
4,755 % fällig am 09.06.2028	11.200	10.770	0,09	Residential Mortgage Securities PLC	16.213	20.678	0,16	CIT Mortgage Loan Trust				
5,210 % fällig am 11.08.2028	19.400	18.986	0,15	6,159 % fällig am 20.06.2070				6,500 % fällig am 25.10.2037	1.275	1.273	0,01	
<b>John Lewis PLC</b>				Resloc UK PLC	£ 53	65	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust				
6,125 % fällig am 21.01.2025	£ 100	122	0,00	5,161 % fällig am 15.12.2043	2.499	2.993	0,02	5,210 % fällig am 25.07.2045	61	42	0,00	
<b>Lloyds Banking Group PLC</b>				5,221 % fällig am 15.12.2043	\$ 132	124	0,00	5,764 % fällig am 25.01.2037 ^	442	431	0,00	
4,650 % fällig am 24.03.2026	\$ 1	1	0,00	5,250 % fällig am 15.12.2043				7,250 % fällig am 25.05.2036	1.333	710	0,01	
<b>Nationwide Building Society</b>				Ripon Mortgages PLC	£ 80.930	102.525	0,81	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
2,972 % fällig am 16.02.2028	8.800	7.913	0,06	5,491 % fällig am 28.08.2056				5,540 % fällig am 25.06.2037	3.157	3.110	0,02	
4,363 % fällig am 01.08.2024	11.200	11.178	0,09	RMAC Securities PLC	€ 848	875	0,01	Countrywide Asset-Backed Certificates				
				3,736 % fällig am 12.06.2044	£ 351	427	0,00	5,830 % fällig am 25.12.2036 ^	119	87	0,00	
				5,134 % fällig am 12.06.2044								
				5,154 % fällig am 12.06.2044								





# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Ford Motor Credit Co. LLC				Organon & Co.				4,009 % fällig am 25.03.2036	\$	132	0,00
2,748 % fällig am 14.06.2024	£ 2.600	\$ 3.164	0,03	8,250 % fällig am 02.06.2028	\$ 5.933	\$ 5.939	0,05	4,116 % fällig am 25.08.2036 ^	1.198	626	0,01
2,900 % fällig am 16.02.2028	\$ 700	600	0,01					4,164 % fällig am 25.08.2036 ^	10	7	0,00
3,370 % fällig am 17.11.2023	14.500	14.364	0,11	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,195 % fällig am 25.05.2035	42	39	0,00
3,375 % fällig am 13.11.2025	2.700	2.513	0,02	American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				4,202 % fällig am 25.09.2035 ^	1.606	999	0,01
3,664 % fällig am 08.09.2024	1.100	1.064	0,01	6,270 % fällig am 15.02.2050	90	99	0,00	4,523 % fällig am 25.01.2036	1.100	1.013	0,01
3,815 % fällig am 02.11.2027	1.400	1.253	0,01	American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010				5,470 % fällig am 25.02.2034	111	99	0,00
4,389 % fällig am 08.01.2026	1.000	947	0,01	7,734 % fällig am 15.02.2033	100	118	0,00	5,870 % fällig am 25.08.2035	9.644	8.990	0,07
4,687 % fällig am 09.06.2025	600	578	0,01	7,834 % fällig am 15.02.2041	1.700	2.147	0,02	Bear Stearns Mortgage Funding Trust			
5,584 % fällig am 18.03.2024	2.400	2.385	0,02	Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021	3.610	3.278	0,03	5,310 % fällig am 25.12.2046	356	292	0,00
GA Global Funding Trust				Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, (ST APPROP Insured), Series 2021	200	168	0,00	Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust			
2,250 % fällig am 06.01.2027	9.400	8.335	0,07	Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021	6.000	5.042	0,04	3,484 % fällig am 26.12.2046 ^	1.544	1.165	0,01
GLP Capital LP				2,687 % fällig am 01.06.2030	6.000	5.042	0,04	Chase Mortgage Finance Trust			
5,250 % fällig am 01.06.2025	1.500	1.471	0,01	2,787 % fällig am 01.06.2031	4.400	3.638	0,03	3,962 % fällig am 25.03.2037 ^	48	45	0,00
5,300 % fällig am 15.01.2029	2.500	2.383	0,02	3,037 % fällig am 01.06.2032	8.045	6.640	0,05	4,086 % fällig am 25.03.2037 ^	521	485	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.				Los Angeles County, California Public Works Financing Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010	2.800	3.524	0,03	4,483 % fällig am 25.02.2037	128	125	0,00
3,750 % fällig am 30.04.2024	€ 18.600	20.302	0,16	Louisiana Local Government Environmental Facilities & Community Development Auth Revenue Bonds, Series 2023	6.600	6.656	0,05	4,529 % fällig am 25.07.2037	39	30	0,00
4,281 % fällig am 07.02.2025	6.800	7.450	0,06	Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010	286	328	0,00	Citicorp Mortgage Securities Trust			
5,749 % fällig am 24.01.2025	\$ 19.000	18.973	0,15	6,655 % fällig am 01.04.2057	286	328	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	61	49	0,00
Goodman U.S. Finance Three LLC				New Jersey Transportation Trust Fund Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010	200	202	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust			
3,700 % fällig am 15.03.2028	6.600	5.990	0,05	5,754 % fällig am 15.12.2028	200	31.840	0,25	4,418 % fällig am 25.08.2035	67	66	0,00
HCA, Inc.				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				5,278 % fällig am 25.08.2036	9.463	3.900	0,03
5,375 % fällig am 01.09.2026	2.170	2.154	0,02	Adjustable Rate Mortgage Trust				5,410 % fällig am 25.10.2035	8	8	0,00
Hyatt Hotels Corp.				4,395 % fällig am 25.09.2035 ^	50	43	0,00	6,980 % fällig am 25.05.2035	5	5	0,00
1,300 % fällig am 01.10.2023	100	99	0,00	6,300 % fällig am 25.03.2035	571	479	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
JPMorgan Chase & Co.				American Home Mortgage Assets Trust	7.434	2.294	0,02	5,014 % fällig am 25.08.2035 ^	237	220	0,00
2,595 % fällig am 24.02.2026	21.600	20.492	0,16	4,896 % fällig am 25.11.2046	247	207	0,00	6,080 % fällig am 25.09.2035	11	11	0,00
4,080 % fällig am 26.04.2026	33.800	32.860	0,26	5,340 % fällig am 25.05.2046 ^	247	207	0,00	6,780 % fällig am 25.09.2035	111	110	0,00
Komatsu Finance America, Inc.				5,360 % fällig am 25.10.2046	65	36	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates			
0,849 % fällig am 09.09.2023	500	495	0,00	5,530 % fällig am 25.09.2046 ^	736	628	0,01	3,626 % fällig am 25.09.2035 ^	475	412	0,00
Lehman Brothers Holdings, Inc.				American Home Mortgage Investment Trust	3.519	1.575	0,01	6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	302	269	0,00
0,000 % fällig am 25.05.2010 ^	8.800	20	0,00	7,129 % fällig am 25.09.2035	3.519	1.575	0,01	Commercial Mortgage Trust			
5,625 % fällig am 24.01.2013 ^	12.700	29	0,00	Banc of America Funding Trust				3,545 % fällig am 10.02.2036	28.500	25.903	0,21
6,200 % fällig am 26.09.2014 ^	9.800	22	0,00	3,896 % fällig am 20.10.2046 ^	99	84	0,00	3,590 % fällig am 10.11.2047	15.500	14.909	0,12
7,875 % fällig am 08.05.2018 ^	£ 14.000	89	0,00	4,245 % fällig am 20.11.2035 ^	90	80	0,00	Countrywide Alternative Loan Trust			
Morgan Stanley				4,416 % fällig am 20.01.2047 ^	103	96	0,00	3,369 % fällig am 25.10.2035 ^	9	8	0,00
2,103 % fällig am 08.05.2026	€ 30.000	31.250	0,25	4,449 % fällig am 20.02.2036	248	233	0,00	4,048 % fällig am 20.11.2035	28	26	0,00
2,630 % fällig am 18.02.2026	\$ 11.600	11.003	0,09	5,477 % fällig am 20.02.2047	612	532	0,01	5,250 % fällig am 25.06.2035 ^	167	129	0,00
Organon & Co.				5,750 % fällig am 25.11.2035	7	6	0,00	5,337 % fällig am 20.02.2047 ^	4.876	3.804	0,03
2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 3.400	3.229	0,03	Banc of America Mortgage Trust				5,352 % fällig am 20.12.2046 ^	2.379	1.994	0,02
4,125 % fällig am 30.04.2028	\$ 4.900	4.354	0,03	4,330 % fällig am 25.09.2035	5	4	0,00	5,360 % fällig am 25.05.2035	31	28	0,00
Pacific Gas & Electric Co.				4,617 % fällig am 25.09.2033	6	6	0,00	5,367 % fällig am 20.07.2046 ^	242	195	0,00
2,100 % fällig am 01.08.2027	500	427	0,00	BCAP LLC Trust				5,390 % fällig am 25.06.2036	936	847	0,01
2,950 % fällig am 01.03.2026 ^	1.900	1.741	0,01	4,175 % fällig am 26.01.2047	251	240	0,00	5,437 % fällig am 20.09.2046	1.219	879	0,01
3,150 % fällig am 01.01.2026	5.300	4.921	0,04	5,250 % fällig am 26.04.2037	550	320	0,00	5,470 % fällig am 25.02.2047	127	115	0,00
3,300 % fällig am 01.12.2027 ^	800	702	0,01	5,490 % fällig am 25.01.2037 ^	24	22	0,00	5,476 % fällig am 25.11.2035	305	261	0,00
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	1.300	1.258	0,01	5,590 % fällig am 25.05.2047 ^	165	158	0,00	5,490 % fällig am 25.05.2047	3.242	2.793	0,02
3,450 % fällig am 01.07.2025	400	378	0,00	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	832	620	0,01
3,750 % fällig am 01.07.2028	1.500	1.345	0,01	3,887 % fällig am 25.05.2047 ^	95	85	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035	1.484	1.019	0,01
4,000 % fällig am 01.12.2046 ^	1.600	1.075	0,01	4,096 % fällig am 25.05.2034	70	59	0,00	5,500 % fällig am 25.05.2037 ^	530	172	0,00
4,250 % fällig am 15.03.2046 ^	800	570	0,00	4,342 % fällig am 25.08.2033	5	5	0,00	5,550 % fällig am 25.05.2036	70	60	0,00
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	1.500	1.073	0,01	4,403 % fällig am 25.10.2033	27	25	0,00	5,570 % fällig am 25.07.2046 ^	54	45	0,00
4,500 % fällig am 01.07.2040	800	623	0,01	4,439 % fällig am 25.02.2034	8	7	0,00	5,577 % fällig am 20.03.2046	1.585	1.299	0,01
4,600 % fällig am 15.06.2043 ^	1.000	758	0,01	4,614 % fällig am 25.02.2036 ^	38	34	0,00	5,610 % fällig am 25.11.2036 ^	5.535	4.804	0,04
4,750 % fällig am 15.02.2044 ^	200	155	0,00	4,996 % fällig am 25.05.2034	65	59	0,00	5,617 % fällig am 20.05.2046 ^	2.455	2.089	0,02
4,950 % fällig am 01.07.2050	600	472	0,00	5,500 % fällig am 25.08.2033	39	36	0,00	5,710 % fällig am 25.02.2037	876	726	0,01
Penske Truck Leasing Co. LP				6,800 % fällig am 25.02.2036	49	46	0,00	5,790 % fällig am 25.11.2035	11	9	0,00
3,450 % fällig am 01.07.2024	4.800	4.677	0,04	Bear Stearns ALT-A Trust				5,797 % fällig am 20.12.2035	1.604	1.498	0,01
Principal Life Global Funding				3,731 % fällig am 25.11.2036 ^	470	223	0,00	5,803 % fällig am 20.11.2035	357	330	0,00
1,375 % fällig am 10.01.2025	7.200	6.719	0,05	3,817 % fällig am 25.11.2036 ^	2.600	1.375	0,01	5,830 % fällig am 25.10.2046 ^	772	568	0,01
Sabine Pass Liquefaction LLC				3,990 % fällig am 25.11.2035 ^	501	391	0,00	5,900 % fällig am 25.07.2036	275	121	0,00
5,750 % fällig am 15.05.2024	6.500	6.491	0,05	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				6,000 % fällig am 25.03.2036	1.822	843	0,01
Southern California Edison Co.				CenturyLink, Inc.				6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	177	81	0,00
1,100 % fällig am 01.04.2024	5.700	5.504	0,04	7,467 % fällig am 15.03.2027	9.143	7.080	0,05	6,016 % fällig am 25.11.2035	236	207	0,00
5,922 % fällig am 01.04.2024	2.900	2.896	0,02					6,170 % fällig am 25.03.2037 ^	188	107	0,00
Southern Co. Gas Capital Corp.								6,250 % fällig am 25.08.2037 ^	124	96	0,00
2,450 % fällig am 01.10.2023	1.747	1.732	0,01					6,500 % fällig am 25.08.2032	3	3	0,00
T-Mobile USA, Inc.								6,690 % fällig am 25.11.2035	266	216	0,00
5,050 % fällig am 15.07.2033	10.900	10.707	0,09					Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
Warner Media LLC								3,514 % fällig am 25.04.2035	128	102	0,00
1,950 % fällig am 15.09.2023	€ 350	380	0,00					3,680 % fällig am 20.09.2036 ^	53	46	0,00
Wells Fargo & Co.								3,797 % fällig am 20.04.2036	980	855	0,01
3,908 % fällig am 25.04.2026	\$ 8.700	8.416	0,07					3,810 % fällig am 25.11.2034	138	126	0,00
		501.126	3,97					3,911 % fällig am 20.02.2036 ^	13	10	0,00
								3,991 % fällig am 25.09.2033 ^	11	8	0,00
								4,366 % fällig am 19.01.2034	34	30	0,00
								5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	63	32	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,610 % fällig am 25.05.2035	\$ 399	\$ 338	0,00	4,826 % fällig am 19.12.2036 ^	\$ 290	\$ 247	0,00	MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust	\$ 3.983	\$ 3.239	0,03
5,730 % fällig am 25.04.2035	185	171	0,00	5,347 % fällig am 19.09.2037	495	434	0,00	5,610 % fällig am 25.06.2047			
5,730 % fällig am 25.04.2035	11	9	0,00	5,546 % fällig am 19.09.2046 ^	566	523	0,01	New Century Alternative Mortgage Loan Trust	4,907	1.177	0,01
5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	323	169	0,00	5,567 % fällig am 19.12.2036	8.609	7.194	0,06	6,173 % fällig am 25.07.2036			
5,790 % fällig am 25.03.2035	1.083	943	0,01	5,626 % fällig am 19.03.2036 ^	117	107	0,00	New Residential Mortgage Loan Trust	2.177	2.042	0,02
5,810 % fällig am 25.02.2035	222	203	0,00	5,657 % fällig am 19.01.2036	319	198	0,00	3,500 % fällig am 25.12.2057			
5,830 % fällig am 25.02.2035	90	77	0,00	5,857 % fällig am 19.01.2035	89	79	0,00	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust	29	17	0,00
5,850 % fällig am 25.02.2036 ^	7	3	0,00	5,976 % fällig am 19.10.2035	379	213	0,00	3,834 % fällig am 25.10.2035			
5,910 % fällig am 25.09.2034	23	22	0,00	6,657 % fällig am 19.10.2035	229	153	0,00	NovaStar Mortgage Funding Trust	1.323	463	0,00
5,910 % fällig am 20.02.2036 ^	12	10	0,00	HomeBanc Mortgage Trust				0,440 % fällig am 25.09.2046			
5,910 % fällig am 20.02.2036 ^	21	18	0,00	5,510 % fällig am 25.12.2036	1	1	0,00	Residential Accredited Loans, Inc. Trust	39	15	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036	293	159	0,00	HSI Asset Loan Obligation Trust				3,923 % fällig am 25.08.2035 ^			
6,000 % fällig am 25.05.2037	1.063	511	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	34	30	0,00	4,165 % fällig am 25.06.2046	4.580	1.116	0,01
6,500 % fällig am 25.12.2037	672	295	0,00	Impac CMB Trust				5,091 % fällig am 25.11.2037	1.664	1.388	0,01
6,500 % fällig am 25.11.2047	508	275	0,00	5,790 % fällig am 25.03.2035	6	6	0,00	5,300 % fällig am 25.02.2047	405	153	0,00
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				6,150 % fällig am 25.07.2033	4	4	0,00	5,450 % fällig am 25.06.2037 ^	1.056	939	0,01
5,510 % fällig am 25.03.2035 ^	617	551	0,01	Impac Secured Assets Trust				5,470 % fällig am 25.03.2047	1.510	1.360	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2035 ^	44	41	0,00	5,670 % fällig am 25.01.2037	3.991	3.195	0,03	5,570 % fällig am 25.04.2046	3.480	1.028	0,01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				IndyMac Mortgage Loan Trust				5,650 % fällig am 25.08.2037	492	449	0,00
5,449 % fällig am 25.03.2032	37	34	0,00	3,093 % fällig am 25.01.2036 ^	41	38	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2036	365	291	0,00
6,500 % fällig am 25.04.2033	3	3	0,00	3,281 % fällig am 25.10.2035	98	78	0,00	Residential Asset Securitization Trust			
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				3,327 % fällig am 25.03.2036	474	325	0,00	5,550 % fällig am 25.01.2046 ^	11	3	0,00
4,260 % fällig am 25.07.2033	6	5	0,00	3,367 % fällig am 25.06.2036	155	124	0,00	5,750 % fällig am 25.02.2036	1.791	1.381	0,01
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				3,438 % fällig am 25.03.2036 ^	1.864	1.320	0,01	5,750 % fällig am 25.04.2037 ^	1.129	596	0,01
6,079 % fällig am 25.04.2037 ^	66	18	0,00	3,482 % fällig am 25.08.2035 ^	90	69	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	773	335	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				3,916 % fällig am 25.12.2034	48	46	0,00	6,500 % fällig am 25.08.2036 ^	1.089	328	0,00
3,474 % fällig am 25.06.2050	4.582	3.845	0,03	5,510 % fällig am 25.02.2037 ^	1.489	1.325	0,01	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
3,850 % fällig am 25.09.2057	9.181	8.614	0,07	5,550 % fällig am 25.06.2046	899	720	0,01	4,149 % fällig am 25.09.2035 ^	223	144	0,00
DBGS Mortgage Trust				5,630 % fällig am 25.06.2037	111	100	0,00	6,500 % fällig am 25.03.2032	7	7	0,00
6,038 % fällig am 15.06.2033	1.120	1.043	0,01	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust				Sequoia Mortgage Trust			
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				0,719 % fällig am 15.04.2047 (a)	21.560	64	0,00	3,271 % fällig am 20.01.2047 ^	262	173	0,00
5,390 % fällig am 25.08.2036 ^	1.575	1.425	0,01	JP Morgan Alternative Loan Trust				3,723 % fällig am 20.07.2037	624	504	0,01
5,450 % fällig am 25.03.2037 ^	1.708	1.611	0,01	4,667 % fällig am 25.12.2035 ^	683	509	0,01	4,601 % fällig am 25.04.2035	29	28	0,00
5,450 % fällig am 25.09.2047 ^	2.706	2.304	0,02	5,500 % fällig am 25.11.2036 ^	12	6	0,00	5,846 % fällig am 19.10.2026	21	20	0,00
5,480 % fällig am 25.08.2037 ^	2.715	2.303	0,02	5,630 % fällig am 25.10.2036	2.861	2.555	0,02	5,857 % fällig am 25.07.2033	121	110	0,00
5,530 % fällig am 25.08.2047	3.467	2.839	0,02	5,660 % fällig am 27.06.2037	140	101	0,00	5,917 % fällig am 20.10.2027	2	2	0,00
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				JP Morgan Mortgage Trust				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
2,907 % fällig am 25.10.2035	8	8	0,00	3,854 % fällig am 25.11.2033	56	51	0,00	3,525 % fällig am 25.11.2035 ^	44	39	0,00
Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust				3,963 % fällig am 25.12.2034	177	165	0,00	4,045 % fällig am 25.07.2035 ^	758	651	0,01
5,250 % fällig am 25.10.2036 ^	6	5	0,00	4,000 % fällig am 25.02.2036 ^	133	99	0,00	4,222 % fällig am 25.08.2035	92	80	0,00
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				4,018 % fällig am 25.08.2034	82	80	0,00	4,974 % fällig am 25.12.2035	388	286	0,00
5,347 % fällig am 19.10.2036	1.238	1.027	0,01	4,047 % fällig am 25.07.2035	84	81	0,00	4,984 % fällig am 25.09.2034	169	161	0,00
5,997 % fällig am 19.09.2044	30	27	0,00	4,121 % fällig am 25.02.2036 ^	403	315	0,00	5,227 % fällig am 25.09.2034	4	4	0,00
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				4,282 % fällig am 25.06.2036 ^	210	156	0,00	5,282 % fällig am 25.02.2034	47	44	0,00
5,024 % fällig am 25.04.2035	77	75	0,00	4,319 % fällig am 25.07.2035	36	34	0,00	5,470 % fällig am 25.10.2035	354	324	0,00
6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	157	53	0,00	Lehman XS Trust				5,590 % fällig am 25.05.2037	9	8	0,00
6,250 % fällig am 25.08.2037 ^	167	73	0,00	5,510 % fällig am 25.12.2036	2.509	2.434	0,02	5,701 % fällig am 25.04.2034	47	45	0,00
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				5,610 % fällig am 25.05.2046	228	389	0,00	Structured Asset Mortgage Investments Trust			
4,715 % fällig am 25.08.2035	51	37	0,00	Luminent Mortgage Trust				3,547 % fällig am 25.05.2047 ^	2.399	1.975	0,02
GreenPoint Mortgage Funding Trust				5,510 % fällig am 25.12.2036 ^	208	190	0,00	5,270 % fällig am 25.08.2036	1.520	1.319	0,01
5,510 % fällig am 25.01.2037	629	546	0,01	5,550 % fällig am 25.10.2046	361	322	0,00	5,330 % fällig am 25.01.2037	1.970	1.750	0,02
5,570 % fällig am 25.04.2036	287	246	0,00	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				5,330 % fällig am 25.09.2047	1.512	1.386	0,01
5,590 % fällig am 25.06.2045	50	47	0,00	4,560 % fällig am 21.11.2034	81	77	0,00	5,370 % fällig am 25.09.2047	22	19	0,00
5,690 % fällig am 25.04.2036 ^	188	179	0,00	MASTR Alternative Loan Trust				5,376 % fällig am 25.12.2035 ^	71	58	0,00
5,690 % fällig am 25.11.2045	67	59	0,00	5,550 % fällig am 25.03.2036 ^	677	68	0,00	5,470 % fällig am 25.01.2037	1.116	985	0,01
5,790 % fällig am 25.09.2046 ^	1.019	832	0,01	MASTR Asset Securitization Trust				5,476 % fällig am 25.08.2047 ^	1.183	1.065	0,01
5,830 % fällig am 25.10.2046 ^	1.279	934	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	152	101	0,00	5,530 % fällig am 25.06.2036	42	40	0,00
GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates				Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				5,550 % fällig am 25.10.2036	2.397	2.092	0,02
4,725 % fällig am 25.10.2033	6	6	0,00	5,893 % fällig am 15.11.2031	47	45	0,00	5,570 % fällig am 25.05.2036	444	299	0,00
GS Mortgage Securities Corp. Trust				Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				5,570 % fällig am 25.09.2047 ^	2.133	1.767	0,02
6,343 % fällig am 15.07.2031	5.000	4.405	0,04	5,632 % fällig am 20.10.2029	17	17	0,00	5,590 % fällig am 25.05.2036	2.298	1.843	0,02
GSMSC Pass-Through Trust				5,633 % fällig am 15.12.2030	43	41	0,00	5,590 % fällig am 25.05.2046	2.467	858	0,01
7,500 % fällig am 25.10.2036	51	10	0,00	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				5,646 % fällig am 19.07.2035	28	27	0,00
GSR Mortgage Loan Trust				5,470 % fällig am 25.01.2037	8.769	2.748	0,02	5,670 % fällig am 25.05.2046 ^	47	28	0,00
3,935 % fällig am 25.01.2036 ^	38	37	0,00	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				5,710 % fällig am 25.02.2036 ^	293	247	0,00
4,070 % fällig am 25.09.2035	36	34	0,00	4,015 % fällig am 25.12.2034	136	128	0,00	5,726 % fällig am 19.07.2034	22	20	0,00
4,234 % fällig am 25.06.2034	20	19	0,00	4,229 % fällig am 25.06.2037	15	14	0,00	5,806 % fällig am 19.09.2032	18	17	0,00
4,481 % fällig am 25.11.2035	14	14	0,00	4,386 % fällig am 25.02.2033	65	61	0,00	5,846 % fällig am 19.03.2034	4	4	0,00
5,380 % fällig am 25.05.2037	9.822	5.038	0,04	5,810 % fällig am 25.06.2028	12	11	0,00	Structured Asset Securities Corp.			
5,500 % fällig am 25.01.2037	115	142	0,00	Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust				5,430 % fällig am 25.01.2036	69	55	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2032	0	0	0,00	3,673 % fällig am 25.04.2037 ^	724	646	0,01	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
6,780 % fällig am 25.03.2033	20	19	0,00	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust				5,440 % fällig am 25.10.2036	514	431	0,00
6,970 % fällig am 25.04.2032	76	63	0,00	3,732 % fällig am 15.05.2048	8.100	7.693	0,06	TBW Mortgage-Backed Trust			
HarborView Mortgage Loan Trust				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				6,130 % fällig am 25.01.2037 ^	27	7	0,00
4,201 % fällig am 19.07.2035 ^	51	37	0,00	3,103 % fällig am 25.11.2037	479	318	0,00	Thornburg Mortgage Securities Trust			
4,688 % fällig am 19.08.2036 ^	41	38	0,00	3,647 % fällig am 25.11.2035 ^	24	18	0,00	3,018 % fällig am 25.09.2037	18	17	0,00
				5,410 % fällig am 25.04.2035	151	141	0,00	6,400 % fällig am 25.06.2037 ^	558	512	0,01
								7,101 % fällig am 25.06.2037	1.267	1.059	0,01
								7,151 % fällig am 25.06.2037	1.486	1.267	0,01
								7,151 % fällig am 25.06.2047 ^	990	869	0,01

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
7,151 % fällig am 25.06.2047	\$ 4	\$ 4	0,00	6,086 % fällig am 01.04.2033	\$ 35	\$ 35	0,00	6,500 % fällig am 01.07.2053	840.600	858.204	6,81
7,201 % fällig am 25.03.2037 ^	648	537	0,01	6,295 % fällig am 01.04.2033	50	50	0,00				
Towd Point Mortgage Trust				6,500 % fällig am 01.11.2036	76	76	0,00				
3,750 % fällig am 25.05.2058	9.249	8.731	0,07	7,000 % fällig am 25.07.2042	70	73	0,00				
Verus Securitization Trust				Freddie Mac				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>			
1,829 % fällig am 25.10.2066	6.439	5.483	0,04	3,000 % fällig am 01.11.2026 - 01.04.2045	359	328	0,00	U.S. Treasury Bonds			
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				3,500 % fällig am 01.08.2026 - 01.04.2049	5.212	4.821	0,04	1,375 % fällig am 15.11.2040	\$ 61.050	\$ 40.894	0,32
3,320 % fällig am 25.05.2037 ^	910	715	0,01	3,885 % fällig am 01.10.2034	18	18	0,00	1,625 % fällig am 15.11.2050	117.170	72.831	0,58
3,528 % fällig am 25.12.2036 ^	449	395	0,00	3,981 % fällig am 01.08.2035	18	18	0,00	1,875 % fällig am 15.02.2041	205.300	149.252	1,18
3,626 % fällig am 25.09.2036	232	201	0,00	4,000 % fällig am 01.09.2024 - 01.09.2041	19	18	0,00	1,875 % fällig am 15.02.2051	100	66	0,00
3,645 % fällig am 25.03.2036 ^	1.035	934	0,01	4,021 % fällig am 01.09.2035	3	3	0,00	2,000 % fällig am 15.08.2051	7.100	4.842	0,04
3,754 % fällig am 25.09.2036 ^	2.685	2.303	0,02	4,442 % fällig am 01.09.2037	104	106	0,00	2,875 % fällig am 15.05.2052	26.900	22.305	0,18
3,823 % fällig am 27.02.2034	65	61	0,00	5,000 % fällig am 15.08.2035 - 01.12.2039	460	453	0,00	3,250 % fällig am 15.05.2042	200	179	0,00
3,852 % fällig am 25.08.2035	26	23	0,00	5,176 % fällig am 25.10.2044 - 25.02.2045	928	855	0,01	4,000 % fällig am 15.11.2052	38.080	39.127	0,31
3,875 % fällig am 25.12.2035	239	218	0,00	5,280 % fällig am 25.08.2031	0	0	0,00	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)			
3,883 % fällig am 25.03.2036	48	44	0,00	5,290 % fällig am 25.09.2031	41	41	0,00	0,125 % fällig am 15.04.2025	91.886	87.424	0,69
3,974 % fällig am 25.05.2037 ^	1.439	1.274	0,01	5,376 % fällig am 25.07.2044	21	19	0,00	0,125 % fällig am 15.07.2031	35.987	31.928	0,25
4,008 % fällig am 25.12.2046	19	17	0,00	5,500 % fällig am 01.06.2037 - 01.10.2039	43	45	0,00	0,125 % fällig am 15.01.2032	9.301	8.192	0,07
4,016 % fällig am 25.03.2033	7	6	0,00	5,643 % fällig am 15.12.2031	0	0	0,00	0,250 % fällig am 15.01.2025	100.142	96.011	0,76
4,134 % fällig am 25.08.2034	60	58	0,00	5,673 % fällig am 15.10.2040	1.640	1.600	0,01	0,375 % fällig am 15.01.2027	43.947	41.246	0,33
4,154 % fällig am 25.09.2033	5	5	0,00	5,693 % fällig am 15.06.2041	2.427	2.377	0,02	0,375 % fällig am 15.07.2027	161	151	0,00
4,163 % fällig am 25.09.2033	10	9	0,00	5,793 % fällig am 15.12.2037	60	60	0,00	0,500 % fällig am 15.01.2028	88.074	82.408	0,65
4,280 % fällig am 25.03.2034	4	4	0,00	6,000 % fällig am 15.04.2036	1.192	1.238	0,01	0,625 % fällig am 15.07.2032	5.533	5.088	0,04
4,830 % fällig am 25.06.2033	34	33	0,00	7,000 % fällig am 01.10.2037	7	7	0,00	0,750 % fällig am 15.07.2028	9.304	8.820	0,07
4,856 % fällig am 25.10.2046 ^	2.244	1.927	0,02	Ginnie Mae				1,125 % fällig am 15.01.2033	93.577	89.715	0,71
4,956 % fällig am 25.06.2046	560	513	0,01	2,625 % fällig am 20.09.2023 - 20.09.2026	3	3	0,00	1,750 % fällig am 15.01.2028	25.626	25.337	0,20
4,976 % fällig am 25.02.2046	1.426	1.273	0,01	2,750 % fällig am 20.11.2026	0	0	0,00	2,375 % fällig am 15.01.2027	1.504	1.512	0,01
4,976 % fällig am 25.08.2046	72	67	0,00	2,875 % fällig am 20.04.2027 - 20.05.2030	7	7	0,00	2,500 % fällig am 15.01.2029	56.933	58.654	0,47
5,176 % fällig am 25.11.2042	23	21	0,00	3,000 % fällig am 20.04.2030 - 20.05.2047	380	357	0,00	3,875 % fällig am 15.04.2029	36.532	40.375	0,32
5,226 % fällig am 25.01.2047	333	300	0,00	3,625 % fällig am 20.01.2025 - 20.01.2030	1	2	0,00	U.S. Treasury Notes			
5,376 % fällig am 25.08.2042	0	0	0,00	4,500 % fällig am 15.04.2039	23	22	0,00	0,375 % fällig am 30.09.2027	2.400	2.043	0,02
5,476 % fällig am 25.10.2046	9	8	0,00	4,628 % fällig am 20.01.2066	1.469	1.450	0,01	0,750 % fällig am 31.01.2028	100	86	0,00
5,610 % fällig am 25.04.2045	15	15	0,00	5,000 % fällig am 20.04.2038	12	12	0,00	2,500 % fällig am 31.03.2027	4.600	4.312	0,03
5,690 % fällig am 25.12.2045	14	14	0,00	5,500 % fällig am 20.08.2035 - 15.02.2039	163	162	0,00	2,875 % fällig am 30.04.2025	96.500	92.943	0,74
5,730 % fällig am 25.07.2045	236	220	0,00	5,924 % fällig am 20.08.2066	3.953	3.932	0,03	3,500 % fällig am 15.02.2033	25.500	24.842	0,20
5,730 % fällig am 25.10.2045	68	65	0,00	Small Business Administration							
5,770 % fällig am 25.01.2045	137	134	0,00	4,760 % fällig am 01.09.2025	9	9	0,00				
5,790 % fällig am 25.01.2045	42	40	0,00	4,840 % fällig am 01.05.2025	5	5	0,00	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
5,890 % fällig am 25.11.2034	163	149	0,00	5,090 % fällig am 01.10.2025	5	5	0,00	<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
5,970 % fällig am 25.11.2045	271	251	0,00	5,110 % fällig am 01.04.2025	1	1	0,00	AT+T, Inc.			
5,970 % fällig am 25.12.2045	3.285	2.993	0,02	5,490 % fällig am 01.05.2028	13	13	0,00	5,700 % fällig am 19.03.2024	48.150	46.094	0,37
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				5,600 % fällig am 01.09.2028	5	5	0,00	Electricite de France S.A.			
4,916 % fällig am 25.07.2046 ^	447	279	0,00	5,680 % fällig am 01.06.2028	3	3	0,00	5,510 % fällig am 03.08.2023	25.400	25.266	0,20
5,500 % fällig am 25.04.2035	121	99	0,00	6,220 % fällig am 01.12.2028	37	37	0,00	Enel Finance America LLC			
5,500 % fällig am 25.07.2036 ^	67	43	0,00	Tennessee Valley Authority				5,450 % fällig am 24.07.2023	5.300	5.281	0,04
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Uniform Mortgage-Backed Security							
4,324 % fällig am 25.06.2033	3	3	0,00	2,500 % fällig am 01.05.2030 - 01.01.2052	57.005	48.718	0,39				
Wells Fargo Alternative Loan Trust				3,000 % fällig am 01.01.2027 - 01.06.2051	26.442	23.512	0,19				
4,412 % fällig am 28.12.2037 ^	240	221	0,00	3,500 % fällig am 01.11.2034 - 01.07.2050	32.648	30.308	0,24	<b>HUNGARY TREASURY BILLS</b>			
6,250 % fällig am 25.07.2037 ^	406	344	0,00	4,000 % fällig am 01.01.2026 - 01.10.2052	21.596	20.474	0,16	16,220 % fällig am 06.07.2023 (c)(d)	HUF 11.026.000	32.185	0,25
		245.119	1,95	4,500 % fällig am 01.08.2023 - 01.09.2052	9.441	9.106	0,07				
				5,500 % fällig am 01.08.2023 - 01.11.2039	34	35	0,00				
				6,500 % fällig am 01.06.2036 - 01.06.2037	12	12	0,00				
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA							
Fannie Mae				2,500 % fällig am 01.08.2053	238.050	202.194	1,60				
3,000 % fällig am 01.03.2060	7.946	7.024	0,06	3,500 % fällig am 01.08.2053	73.900	67.419	0,54				
3,500 % fällig am 01.01.2059	23.406	21.360	0,17	4,000 % fällig am 01.07.2053	605.558	568.822	4,51				
3,621 % fällig am 01.12.2034	35	34	0,00	4,500 % fällig am 01.07.2053	641.400	616.996	4,89				
3,649 % fällig am 01.10.2034	15	15	0,00	5,000 % fällig am 01.07.2053	546.500	535.607	4,25				
3,835 % fällig am 01.08.2033	21	20	0,00	5,500 % fällig am 01.07.2053	726.800	723.224	5,74				
4,082 % fällig am 25.05.2035	1	1	0,00	6,000 % fällig am 01.08.2053	866.950	874.468	6,93				
4,295 % fällig am 01.08.2035	71	70	0,00								
4,415 % fällig am 01.11.2034	257	262	0,00								
4,560 % fällig am 01.08.2036	1	1	0,00								
4,633 % fällig am 01.12.2030	1	1	0,00								
4,943 % fällig am 01.06.2043	4	4	0,00								
4,944 % fällig am 01.11.2042 - 01.10.2044	43	42	0,00								
5,144 % fällig am 01.09.2040	11	11	0,00								
5,248 % fällig am 01.06.2035	2	2	0,00								
5,258 % fällig am 25.03.2034	31	31	0,00								
5,288 % fällig am 25.08.2034	5	5	0,00								
5,377 % fällig am 01.01.2033	22	21	0,00								
5,500 % fällig am 25.09.2042 - 25.03.2044	40	39	0,00								
5,524 % fällig am 25.12.2036	177	172	0,00								
5,550 % fällig am 25.06.2029 - 25.06.2036	199	196	0,00								
6,000 % fällig am 25.04.2043 - 25.07.2044	606	604	0,01								

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ISRAEL TREASURY BILLS</b>								<b>European High Yield Bond Fund (f)</b>			
1,716 % fällig am 05.07.2023 (c)(d)	ILS	18.700	\$ 5,036	0,04	(0,179) % fällig am 11.09.2023 (c)(d)	889.000	6,152	0,05			
<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>								<b>PIMCO Funds: Global Investors Series plc - UK Corporate Bond Fund (f)</b>			
(0,211) % fällig am 24.07.2023 (c)(d)	¥	10.929.000	75.620	0,60	(0,176) % fällig am 14.08.2023 (c)(d)	¥ 7.111.000	49.206	0,39	7.715.431	\$ 82.690	0,65
(0,206) % fällig am 18.07.2023 (c)(d)		22.054.000	152.594	1,21	(0,168) % fällig am 10.07.2023 (c)(d)	8.190.000	56.666	0,45			
(0,202) % fällig am 28.08.2023 (c)(d)		9.595.000	66.398	0,53	(0,163) % fällig am 21.08.2023 (c)(d)	42.739.000	295.751	2,34			
(0,200) % fällig am 14.08.2023 (c)(d)		19.909.000	137.765	1,09	(0,152) % fällig am 25.09.2023 (c)(d)	13.957.000	96.593	0,76			
(0,200) % fällig am 28.08.2023 (c)(d)		17.494.000	121.060	0,96	(0,132) % fällig am 25.09.2023 (c)(d)	22.423.000	155.185	1,23			
(0,199) % fällig am 11.09.2023 (c)(d)		3.981.000	27.550	0,22				2.615.911	20,74		
(0,189) % fällig am 28.08.2023 (c)(d)		9.075.000	62.800	0,50	Summe kurzfristige Instrumente		2.729.773	21,64			
(0,188) % fällig am 18.07.2023 (c)(d)		29.186.000	201.941	1,60	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 14.608.940	115,83				
(0,188) % fällig am 28.08.2023 (c)(d)		26.396.000	182.663	1,45	<b>AKTIEN</b>						
(0,187) % fällig am 10.07.2023 (c)(d)		20.140.000	139.347	1,10	<b>INVESTMENTFONDS</b>						
(0,187) % fällig am 21.08.2023 (c)(d)		22.611.000	156.466	1,24	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>						
(0,184) % fällig am 04.09.2023 (c)(d)		46.240.000	319.993	2,54	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Bond Ex-US Fund (f)	10.956.929	108.693	0,86	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>		
(0,183) % fällig am 21.08.2023 (c)(d)		39.310.000	272.022	2,16	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (f)	4.437.728	47.217	0,37	<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)</b>		
(0,182) % fällig am 24.07.2023 (c)(d)		5.801.000	40.139	0,32	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO	1.355.380	15.349	0,12	<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)</b>		
								<b>Summe Investmentfonds</b>			
								\$ 1.249.595 9,91			

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,110 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 127.200	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.04.2025	\$ (129.709)	\$ 127.200	\$ 127.254	1,01
BRC	5,120	30.06.2023	03.07.2023	593.800	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.05.2025	(605.974)	593.800	594.053	4,71
	5,130	30.06.2023	03.07.2023		100 Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.08.2051	(102)	100	100	0,00
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (735.785)</b>	<b>\$ 721.100</b>	<b>\$ 721.407</b>	<b>5,72</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	2.638	\$ 7.010	0,05
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	1.273	452	0,00
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	1.273	(288)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	1.037	401	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1.351	642	0,01
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	4	6	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	6.617	12.223	0,09
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	319	(349)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	2.884	3.212	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	75	95	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	17	38	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	5.108	1.832	0,01
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	9.056	2.119	0,02
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	76	(278)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	50	(107)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	2.194	(4.317)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	643	818	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	36	(2)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	33	(65)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	1.501	446	0,00
				<b>\$ 23.888</b>	<b>0,19</b>



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHADELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	295	\$ (129)	\$ (111)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	295	(103)	(15)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	222	0	(11)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	222	0	(1.046)	(0,01)
				\$ (232)	\$ (1.183)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 22.705	0,18

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2023	\$ 5.900	\$ (58)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	800	38	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	€ 17.500	(947)	(0,01)
				\$ (967)	(0,01)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 10-Year Index	(1,000) %	20.12.2032	\$ 2.060	\$ (11)	0,00
CDX.IG-40 10-Year Index	(1,000)	20.06.2033	801.370	(9.046)	(0,07)
				\$ (9.057)	(0,07)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 103.500	\$ 933	0,01
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	1.112.600	8.065	0,06
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	€ 53.000	139	0,00
				\$ 9.137	0,07

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 27.400	\$ (2.476)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	787.110	(39.469)	(0,31)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	64.200	(4.096)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	119.200	4.386	0,03
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	16.03.2032	INR 1.997.200	(1.051)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	15.03.2028	3.212.810	319	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	¥ 14.710.000	(2.550)	(0,02)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	19.820.000	(180)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	19.06.2029	6.440.000	(1.586)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	13.160.000	6.788	0,05
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	770.000	(67)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	3.460.000	1.365	0,01
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	15.03.2028	SGD 47.830	(906)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.07.2023	\$ 578.050	7.814	0,06
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	25.08.2023	155.100	(2.152)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	31.08.2023	178.000	(2.474)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,400	15.01.2028	578.050	(91.394)	(0,72)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	16.880	(813)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,249	31.08.2024	178.000	8.660	0,07
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	444.500	47.347	0,38
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,298	25.08.2024	155.100	7.544	0,06
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	17.09.2024	53.950	2.140	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,430	31.03.2024	256.050	(9.936)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,488	15.08.2031	25.600	(4.403)	(0,04)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	233.690	(30.907)	(0,25)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	17.800	(2.201)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,545	20.01.2029	3.000	(367)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	\$ 63.600	\$ (7.515)	(0,06)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	14.700	(1.725)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	610.261	7.769	0,06
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2025	6.500	7	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	632.731	16.152	0,13
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	35.650	(1.146)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	66.000	(22.984)	(0,18)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	6.600	114	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	74.840	(2.075)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	565.100	28.324	0,22
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	71.300	1.468	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	34.180	(381)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	11.300	(487)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	31.000	(1.242)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	15.11.2032	42.410	(1.558)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,150	13.05.2025	1.265.400	12.333	0,10
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,163	30.09.2029	37.000	(1.390)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,165	03.10.2053	16.700	52	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,200	13.05.2025	78.400	887	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,225	30.09.2029	5.200	(195)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,240	03.10.2053	16.700	287	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	27.300	619	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	16.280	(294)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	59.700	214	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	31.05.2027	100.800	2.783	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	14.06.2033	34.000	(602)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	12.510	(161)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,445	03.10.2038	55.400	18	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	82.000	(1.454)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	15.800	(265)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	32.300	(288)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	2.800	27	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	84.008	(617)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	16.200	(224)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,533	03.10.2038	55.400	(540)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	186.000	2.986	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	244.593	2.111	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,752	03.10.2028	71.600	(112)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	10.300	(85)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,850	03.10.2028	71.600	198	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,898	30.06.2029	66.300	381	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,159	31.03.2025	214.600	3.516	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	838.819	4.418	0,03
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024	300.600	(3.778)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024	300.600	3.927	0,03
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,427	27.09.2024	350.000	(4.183)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,427	27.09.2024	350.000	3.566	0,03
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,433	06.09.2024	611.900	(7.399)	(0,06)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,433	06.09.2024	611.900	6.391	0,05
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024	110.900	(891)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024	110.900	489	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	CAD 57.400	(3.369)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	89.200	(3.708)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	207.300	(21.113)	(0,17)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029	81.100	(7.994)	(0,06)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	107.300	(10.663)	(0,08)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	28.01.2052	700	5	0,00
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2033	88.700	3.226	0,03
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033	101.600	440	0,00
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2053	11.000	12	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	10.05.2025	1.745.300	(10.656)	(0,08)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF 47.000	(3.167)	(0,03)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	19.900	(1.288)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	31.300	(2.059)	(0,02)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	CNY 382.500	542	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.12.2027	21.700	(36)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.12.2027	21.700	36	0,00
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,000	23.11.2024	€ 259.600	(4.745)	(0,04)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2028	KRW 693.114.366	(9.580)	(0,08)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033	38.398.724	87	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.09.2033	76.861.620	169	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,110	16.12.2023	NZD 600	(9)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	10.000	(227)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023	354.250	(2.910)	(0,02)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	102.300	(1.616)	(0,01)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	624.400	(5.001)	(0,04)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month NZD-BBR	5,000	20.03.2025	324.700	(504)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month NZD-BBR	5,250	20.03.2025	15.800	(11)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK 260.100	(1.463)	(0,01)
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	56.700	(848)	(0,01)
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB 4.091.920	1.380	0,01



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.07.2023	\$ 578.050	\$ (7.752)	(0,06)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	25.08.2023	155.100	2.145	0,02	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	31.08.2023	178.000	2.496	0,02	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.09.2023	444.500	4.916	0,04	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	17.09.2023	53.950	375	0,00	
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023	233.690	(2.439)	(0,02)	
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023	17.800	(103)	0,00	
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	20.07.2023	3.000	(17)	0,00	
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.07.2023	63.600	(331)	0,00	
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.07.2023	14.700	(77)	0,00	
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.09.2023	66.000	(606)	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023	300.600	645	0,01	
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023	300.600	(650)	(0,01)	
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,427	27.07.2023	350.000	(875)	(0,01)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,427	27.09.2023	350.000	1.083	0,01	
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,433	06.07.2023	611.900	(267)	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,433	06.09.2023	611.900	1.813	0,01	
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.07.2023	110.900	(14)	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.09.2023	110.900	234	0,00	
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 128.300	18.826	0,15	
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	92.600	(5.565)	(0,04)	
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033	123.700	(3.207)	(0,03)	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	40.100	(173)	0,00	
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	206.600	(4.326)	(0,03)	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	663.500	909	0,01	
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK 158.300	(1.040)	(0,01)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€ 7.450	3.349	0,03	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	17.650	9.673	0,08	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	12.500	(559)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	34.400	(3.653)	(0,03)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	24.400	(2.540)	(0,02)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	19.200	(2.013)	(0,02)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	30.03.2024	76.900	(1.967)	(0,02)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	41.000	(3.846)	(0,03)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	18.100	(1.697)	(0,01)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	103.300	(1.618)	(0,01)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	218.700	(3.421)	(0,03)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	55.200	(934)	(0,01)	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	32.200	(447)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	38.500	(573)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	32.900	(492)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	55.870	(2.153)	(0,02)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	371.000	(2.383)	(0,02)	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027	489.180	(3.510)	(0,03)	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	1.385.700	(5.465)	(0,04)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033	221.155	(595)	0,00	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	1.691.300	5.269	0,04	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	430.700	(4.186)	(0,03)	
Zahlung	28-Day MXN-TIE	4,870	07.07.2025	MXN 393.200	(2.152)	(0,02)	
						\$ (178.202)	(1,41)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ (179.089)</b>	<b>(1,42)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### OPTIONSKAUF ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180 %	11.01.2024	49.700	\$ 1.420	\$ 5.103	0,04

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	26.800	\$ 2.027	\$ 11.170	0,09

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	31.200	\$ (97)	\$ (3)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	31.200	(97)	(422)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310	11.01.2024	441.600	(1.425)	(10.683)	(0,09)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2023	17.200	(66)	(82)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	17.200	(66)	(51)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	3.100	(20)	(8)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	3.100	(20)	(2)	0,00
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	26.800	(2.027)	(10.259)	(0,08)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	3.600	(25)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	3.600	(25)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	17.000	(55)	(34)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	17.000	(55)	(82)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	5.900	(14)	(11)	0,00
CBK	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	5.900	(14)	(21)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	33.700	(265)	(40)	0,00
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	33.700	(265)	(620)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	19.700	(119)	(2)	0,00
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	19.700	(119)	(423)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	39.000	(300)	(51)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	39.000	(300)	(678)	(0,01)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,688	02.04.2024	14.400	(113)	(17)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,688	02.04.2024	14.400	(113)	(265)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	6.800	(47)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	6.800	(47)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,100	31.08.2023	29.300	(215)	(42)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	31.08.2023	29.300	(215)	(298)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	12.100	(74)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	12.100	(74)	(260)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	13.000	(84)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	13.000	(84)	(265)	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	14.200	(100)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	14.200	(100)	(272)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	13.700	(95)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	13.700	(95)	(257)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	14.200	(98)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	14.200	(98)	(261)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	17.400	(120)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	17.400	(120)	(361)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	14.900	(102)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	14.900	(102)	(325)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	10.800	(78)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	10.800	(78)	(209)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	25.900	(172)	(5)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	25.900	(172)	(538)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	38.900	(141)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	38.900	(141)	(506)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	24.600	(86)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	24.600	(86)	(341)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	22.800	(71)	(3)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	22.800	(71)	(285)	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	6.300	(49)	(7)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	6.300	(49)	(116)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	15.300	(116)	(19)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	15.300	(116)	(275)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	6.900	(16)	(13)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	6.900	(16)	(24)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	123.600	(873)	(129)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	3.000	(10)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	3.000	(10)	(12)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	9.500	(64)	(2)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	9.500	(64)	(200)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	6.900	(23)	(12)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	6.900	(23)	(28)	0,00
						\$ (9.995)	\$ (28.844)	(0,23)	

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 11.810	\$ (285)	\$ 429	\$ 144	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	17.350	(421)	633	212	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	4.020	(97)	146	49	0,00
					\$ (803)	\$ 1.208	\$ 405	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 106.300	\$ 80.086	\$ 526	\$ (309)	\$ 217	0,00
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	105.500	72.795	(26)	167	141	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	101.200	69.828	(205)	168	(37)	0,00
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	65.900	47.343	287	(176)	111	0,00
						\$ 582	\$ (150)	\$ 432	0,00

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 596.458	\$ (227)	\$ 1.113	\$ 886	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	227.400	(66)	579	513	0,01
BPS	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	197.614	(79)	373	294	0,00
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	130.664	0	154	154	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,635	05.04.2024	265.697	(61)	41	(20)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	56.073	117	9	126	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	30.196	(11)	56	45	0,00
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	119.180	(359)	253	(106)	0,00
						\$ (686)	\$ 2.578	\$ 1.892	0,02

### DEWISETERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	1.137	\$ 744	\$ 0	\$ (13)	0,00
	07.2023	NZD	584	355	0	(3)	0,00
	07.2023	\$	5.026	AUD 7.574	16	0	0,00
	07.2023		344	NZD 559	0	(1)	0,00
	08.2023	AUD	7.574	\$ 5.030	0	(16)	0,00
BOA	07.2023		19.442	12.688	0	(253)	0,00
	07.2023	BRL	248	50	0	(1)	0,00
	07.2023	CAD	146.368	107.569	0	(3.043)	(0,02)
	07.2023	€	670.992	721.118	0	(10.935)	(0,09)
	07.2023	IDR	3.728.820	250	2	2	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme		Nicht realisierte (Wertabnahme)		Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)		% des Nettovermögens	
	07.2023	KRW	899.153		\$	700		\$	17	0	\$	17	0,00
	07.2023	NOK	1.365			124			0	(4)		(4)	0,00
	07.2023	NZD	22.612			13.719			0	(134)		(134)	0,00
	07.2023	SEK	500			46			0	0		0	0,00
	07.2023	\$	8.475	CAD		11.319			79	(1)		78	0,00
	07.2023		141.207	DKK		960.098			0	(530)		(530)	0,00
	07.2023		1.862	€		1.704			0	(3)		(3)	0,00
	07.2023		28.630	£		22.634			146	0		146	0,00
	07.2023		100	KRW		130.710			0	(1)		(1)	0,00
	07.2023		16.091	MXN		296.227			1.138	0		1.138	0,01
	07.2023		63.791	NOK		701.238			1.662	0		1.662	0,01
	08.2023	DKK	958.495		\$	141.207			532	0		532	0,00
	08.2023	IDR	5.634.813			375			0	0		0	0,00
	08.2023	¥	15.293.337			110.915			4.226	0		4.226	0,03
	08.2023	KRW	65.888			50			0	0		0	0,00
	08.2023	TWD	449.705			14.781			339	0		339	0,00
	08.2023	\$	357	CNY		2.448			0	(18)		(18)	0,00
	09.2023	¥	46.240.000		\$	337.519			14.536	0		14.536	0,12
	09.2023	KRW	41.122.743			32.458			1.116	0		1.116	0,01
	09.2023	TWD	701.820			23.119			538	0		538	0,00
	09.2023	\$	12.765	IDR		191.086.376			0	(73)		(73)	0,00
	09.2023		26.402	INR		2.183.759			143	0		143	0,00
BPS	07.2023	AUD	20.419		\$	13.642			50	0		50	0,00
	07.2023	CAD	15.425			11.622			16	(51)		(35)	0,00
	07.2023	CHF	174			195			0	0		0	0,00
	07.2023	CZK	23.893			1.111			14	0		14	0,00
	07.2023	DKK	61.825			8.907			0	(152)		(152)	0,00
	07.2023	€	1.408.838			1.514.744			51	(22.351)		(22.300)	(0,18)
	07.2023	ILS	8.989			2.820			397	0		397	0,00
	07.2023	¥	14.201.368			102.216			3.961	0		3.961	0,03
	07.2023	MYR	30.459			6.636			98	0		98	0,00
	07.2023	NOK	165.409			15.383			0	(56)		(56)	0,00
	07.2023	NZD	21.503			13.233			64	(5)		59	0,00
	07.2023	\$	6.324	AUD		9.594			62	0		62	0,00
	07.2023		65	BRL		317			0	0		0	0,00
	07.2023		74.363	€		67.647			0	(560)		(560)	0,00
	07.2023		19.086	£		15.253			350	(45)		305	0,00
	07.2023		7.567	¥		1.051.813			0	(290)		(290)	0,00
	07.2023		414	NZD		688			8	0		8	0,00
	08.2023	AUD	5.415		\$	3.589			0	(18)		(18)	0,00
	08.2023	BRL	317			65			0	0		0	0,00
	08.2023	CNH	583.431			82.698			2.236	0		2.236	0,02
	08.2023	COP	20.000.000			4.360			0	(354)		(354)	0,00
	08.2023	TWD	351.285			11.506			225	0		225	0,00
	08.2023	\$	195	CHF		174			0	0		0	0,00
	08.2023		421	CNY		2.878			0	(23)		(23)	0,00
	08.2023		15.259	NOK		163.888			54	0		54	0,00
	09.2023	IDR	696.653		\$	46			0	0		0	0,00
	09.2023	THB	76			2			0	0		0	0,00
BRC	10.2023	ZAR	8.451			454			11	0		11	0,00
	07.2023	BRL	121			25			0	0		0	0,00
	07.2023	£	7.205			8.944			0	(216)		(216)	0,00
	07.2023	IDR	744.695			50			0	0		0	0,00
	07.2023	¥	51.240.000			396.159			40.954	0		40.954	0,33
	07.2023	NZD	709			426			0	(9)		(9)	0,00
	07.2023	\$	19.627	£		15.591			198	(3)		195	0,00
	07.2023		461	NZD		756			2	0		2	0,00
	09.2023	IDR	722.461		\$	48			0	0		0	0,00
	09.2023	ILS	27.435			7.670			256	0		256	0,00
	09.2023	\$	1.843	IDR		27.659.710			0	(6)		(6)	0,00
	09.2023		6.266	THB		218.569			0	(55)		(55)	0,00
	04.2024	¥	8.140.195		\$	66.630			7.785	0		7.785	0,06
CBK	05.2024		5.580.000			45.133			4.610	0		4.610	0,04
	07.2023	AUD	7.776			5.073			0	(103)		(103)	0,00
	07.2023	CZK	21.086			978			11	0		11	0,00
	07.2023	DKK	469.087			67.384			0	(1.348)		(1.348)	(0,01)
	07.2023	IDR	14.521.350			975			9	0		9	0,00
	07.2023	ILS	9.431			2.966			425	0		425	0,00
	07.2023	KRW	195.713			150			1	0		1	0,00
	07.2023	NOK	1.330			120			0	(4)		(4)	0,00
	07.2023	NZD	845			518			1	0		1	0,00
	07.2023	RON	1.376			304			2	0		2	0,00
	07.2023		1.129	AUD		1.688			0	(6)		(6)	0,00
	07.2023		25	BRL		121			0	0		0	0,00
	07.2023		515	CAD		703			16	0		16	0,00
	07.2023		11.171	CLP		9.040.413			87	0		87	0,00
	07.2023		417.541	€		384.064			1.525	(51)		1.474	0,01
	07.2023		9.033	£		7.104			2	(4)		(2)	0,00
	07.2023		11.661	NOK		129.901			464	0		464	0,00
	08.2023	BRL	18.431		\$	3.566			0	(236)		(236)	0,00
	08.2023	€	350.430			381.526			0	(1.318)		(1.318)	(0,01)
	08.2023	¥	33.690.553			244.448			9.417	0		9.417	0,08

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	TWD	\$	365.728	11.981	\$ 236	0,00
	08.2023	\$	CNH	1.378	9.610	0	0,00
	08.2023		ZAR	677	12.508	(53)	0,00
	09.2023	CNH	\$	13.334	1.871	(18)	0,00
	09.2023	\$	KRW	312	401.547	27	0,00
	09.2023		THB	3.485	119.974	(6)	0,00
	10.2023	CLP	\$	3.904.732	4.764	(76)	0,00
	10.2023	\$	CLP	8.206	6.703.029	(45)	0,00
	11.2023	ILS	\$	101.207	30.243	49	0,00
FAR	07.2023	\$	CLP	17	13.870	2.789	0,02
GLM	07.2023	BRL	\$	304.543	63.731	0	0,00
	07.2023	IDR		13.463.100	900	0	0,00
	07.2023	KRW		193.573	150	600	0,01
	07.2023	NOK		1.011.772	93.870	5	0,00
	07.2023	SGD		498	369	0	0,00
	07.2023	\$	BRL	56.406	303.740	1	0,00
	07.2023		KRW	50	66.248	6.558	0,05
	07.2023		MXN	251	4.415	0	0,00
	08.2023	CNH	\$	201.680	28.707	6	0,00
	08.2023	\$	BRL	63.606	305.488	0	0,01
	08.2023		NOK	93.870	1.010.777	(587)	0,00
	08.2023		ZAR	1.531	28.414	0	0,01
	09.2023	CNH	\$	192.043	26.956	(33)	0,00
	09.2023	\$	SGD	56.437	75.468	0	0,00
	09.2023		THB	40.002	1.378.061	(512)	0,00
IND	10.2023	ZAR	\$	2.164	115	(841)	(0,01)
	07.2023	BRL		242	50	0	0,00
	07.2023	DKK		1.554.364	224.362	2	0,00
	07.2023	KRW		194.309	150	(3.388)	(0,03)
	07.2023	\$	SGD	546	723	0	0,00
JPM	08.2023	CNH	\$	53.735	7.579	(11)	0,00
	07.2023	AUD		17.304	11.313	168	0,00
	07.2023	KRW		173.842.951	136.116	0	0,00
	07.2023	MXN		2.641	153	(205)	0,00
	07.2023	SGD		21.675	16.406	0	0,03
	07.2023	\$	CAD	2.421	3.211	0	0,00
	07.2023		€	1.790.126	1.639.578	6	0,00
	07.2023		£	666.422	527.065	(1.470)	(1,346)
	07.2023		¥	31.169	4.457.527	124	0,00
	07.2023		KRW	50	66.248	3.664	0,03
	07.2023		MXN	201	3.532	0	0,00
	07.2023		NZD	64.146	105.260	(329)	0,00
	07.2023		SGD	2.061	2.723	0	0,00
	08.2023	CNH	\$	83.473	11.798	0	0,00
	08.2023	€		1.633.917	1.786.568	286	0,00
	08.2023	£		527.065	666.563	0	0,01
	08.2023	¥		18.014.696	129.593	(3.656)	(3,656)
	08.2023	NZD		105.260	64.140	0	0,00
	08.2023	\$	CNY	444	3.037	0	0,03
	08.2023		HUF	554	192.394	(339)	0,00
	08.2023		MXN	204	3.540	(24)	0,00
	09.2023	IDR	\$	29.932	2	(1)	0,00
	09.2023	ILS		26.327	7.412	0	0,00
	09.2023	PEN		65.653	17.831	0	0,00
	09.2023	\$	IDR	5.313	79.933.034	0	0,00
	09.2023		INR	10.257	845.296	(3)	0,00
	09.2023		KRW	382	496.689	18	0,00
	09.2023		MXN	270	4.684	0	0,00
	09.2023		SGD	1.635	2.187	(3)	0,00
	09.2023		THB	12.787	438.491	(1)	0,00
	10.2023		ZAR	158	2.953	(15)	0,00
	12.2023		INR	62.001	5.116.400	(326)	0,00
MBC	10.2024	¥	\$	7.740.000	62.332	(3)	0,00
	07.2023	CAD		97.861	73.004	4.924	0,04
	07.2023	€		14.493	15.571	0	0,00
	07.2023	£		36.632	46.841	(951)	(0,01)
	07.2023	¥		16.730.000	128.100	(241)	0,00
	07.2023	NOK		92.305	8.704	0	0,00
	07.2023	SGD		1.277	951	0	0,10
	07.2023	\$	AUD	24.097	36.110	88	0,00
	07.2023		CAD	130.082	174.416	7	0,00
	07.2023		€	10.269	9.564	(61)	0,00
	07.2023		£	19.312	15.497	(30)	1,726
	07.2023		¥	5.695	818.600	(4)	0,00
	08.2023	CNH	\$	291.997	41.895	0	0,00
	08.2023	¥		104.660.000	766.107	0	1,605
	08.2023	\$	ZAR	249	4.668	0	0,00
	09.2023	IDR	\$	70.520	5	(3)	0,00
	09.2023	¥		4.870.000	35.475	0	0,00
	09.2023	KRW		75.933.081	59.541	0	1,426
	09.2023	\$	IDR	1.827	27.200.022	0	0,01
						(20)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
	02.2024	¥	700.018	\$	5.675	\$	663	0,01	
	03.2024		15.550.388		127.046		15.190	0,12	
	10.2024		10.172.450		81.581		6.132	0,05	
MYI	07.2023	€	2.228		2.426		(4)	0,00	
	07.2023	£	562.571		699.204		(16.022)	(0,13)	
	07.2023	IDR	68.027.969		4.543		10	0,00	
	07.2023	KRW	905.289		700		12	0,00	
	07.2023	NOK	624		58		(1)	0,00	
	07.2023	NZD	1.996		1.208		(15)	0,00	
	07.2023	SEK	25.249		2.352		15	0,00	
	07.2023	\$	5.067	CAD	6.674		(27)	(0,00)	
	07.2023		1.032	CHF	928		5	0,00	
	07.2023		125.524	DKK	856.238		(65)	(65)	0,00
	07.2023		15.632	€	14.338		11	0,00	
	07.2023		4.705	£	3.702		(6)	1	0,00
	07.2023		3.352	IDR	50.372.672		8	8	0,00
	07.2023		50	KRW	65.085		(1)	(1)	0,00
	07.2023		2.403	SEK	25.946		(1)	(1)	0,00
	08.2023	DKK	854.810	\$	125.524		66	66	0,00
	08.2023	IDR	2.991.960		200		1	1	0,00
	08.2023	SEK	25.733		2.386		1	1	0,00
	08.2023	TWD	1.973.959		64.804		1.411	1.411	0,01
	08.2023	\$	618	ZAR	11.585		(7)	(7)	0,00
	09.2023	KRW	85.336.510	\$	66.683		1.645	1.645	0,01
	09.2023	\$	18.251	IDR	272.682.426		(138)	(138)	0,00
	09.2023		2.214	INR	182.579		6	6	0,00
	09.2023		5.838	THB	199.874		(158)	(158)	0,00
	10.2023		417	ZAR	7.798		(9)	(9)	0,00
RBC	07.2023	CAD	66	\$	50		0	0	0,00
	07.2023	KRW	65.282		50		0	0	0,00
	07.2023	MXN	483.259		25.116		(3.013)	(3.013)	(0,02)
	07.2023	\$	1.536	AUD	2.369		41	41	0,00
	07.2023		452	CAD	616		14	14	0,00
	08.2023		24.406	MXN	422.963		57	57	0,00
RYL	07.2023	NZD	715	\$	442		3	3	0,00
	07.2023	\$	368	NZD	592		(5)	(5)	0,00
SCX	07.2023	AUD	24.427	\$	15.961		(298)	(298)	0,00
	07.2023	CHF	425		468		(7)	(7)	0,00
	07.2023	MYR	30.458		6.627		89	89	0,00
	07.2023	NOK	2.700		245		(7)	(7)	0,00
	07.2023	NZD	58.891		35.756		(324)	(324)	0,00
	07.2023	\$	7.385	AUD	11.125		20	20	0,00
	07.2023		25	BRL	123		0	0	0,00
	07.2023		4.970	CAD	6.750		131	131	0,00
	07.2023		408	CHF	367		2	2	0,00
	08.2023	AUD	11.125	\$	7.391		(20)	(20)	0,00
	08.2023	CNH	9.683		1.406		71	71	0,00
	08.2023	TWD	1.258.228		41.205		798	798	0,01
	08.2023	\$	1.181	CNY	8.063		(66)	(66)	0,00
	09.2023	CNH	108.227	\$	15.167		198	198	0,00
	09.2023	IDR	30.357.959		2.041		25	25	0,00
	09.2023	TWD	589.168		19.325		369	369	0,00
	09.2023	\$	18.033	IDR	270.631.595		(57)	(57)	0,00
	09.2023		6.419	INR	528.663		7	7	0,00
	09.2023		25.919	KRW	33.016.087		(756)	(756)	(0,01)
	09.2023		13.561	THB	468.253		(254)	(254)	0,00
SOG	07.2023	AUD	7.510	\$	4.913		(86)	(86)	0,00
	07.2023	BRL	120		25		0	0	0,00
	07.2023	SGD	5		4		0	0	0,00
	07.2023	\$	175	BRL	854		2	2	0,00
	07.2023		772	PLN	3.326		46	46	0,00
SSB	07.2023	CLP	18.405.696	\$	22.722		(170)	(170)	0,00
	08.2023	¥	27.020.000		203.550		15.467	15.467	0,12
	08.2023	\$	7.196	CLP	5.797.132		(1)	(1)	0,00
	09.2023	KRW	81.008.828	\$	62.458		718	718	0,01
	09.2023	\$	7.147	BRL	36.231		281	281	0,00
TOR	07.2023	AUD	3.974	\$	2.599		(46)	(46)	0,00
	07.2023	\$	9.043	AUD	13.691		71	71	0,00
	07.2023		44.725	CAD	59.180		(33)	(33)	0,00
	07.2023		54.686	¥	7.872.885		(215)	(215)	0,00
	08.2023	AUD	13.691	\$	9.051		(70)	(70)	0,00
	08.2023	CAD	59.157		44.725		33	33	0,00
	08.2023	¥	7.779.552		54.255		203	203	0,00
	08.2023	\$	214	HUF	74.978		3	3	0,00
UAG	09.2023	¥	36.380.000	\$	258.195		3.269	3.269	0,03
	07.2023	AUD	910		596		(10)	(10)	0,00
	07.2023	CHF	687		764		(4)	(4)	0,00
	07.2023	¥	28.330.000		216.110		19.958	19.958	0,16
	07.2023	\$	14.570	AUD	21.821		(76)	(76)	0,00
	07.2023		247	MXN	4.396		9	9	0,00
	07.2023		44.328	NOK	490.507		1.456	1.456	0,01
	08.2023	AUD	21.821	\$	14.582		(30)	(30)	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
	08.2023	\$ 3.764	CNH 26.091	\$ 0	\$ (166)	\$ (166)	0,00
	08.2023	1.021	ZAR 18.689	0	(35)	(35)	0,00
	09.2023	CNH 81.161	THB 393.063	0	(56)	(56)	0,00
	09.2023	ILS 22.785	\$ 6.364	207	0	207	0,00
	09.2023	SGD 57.024	42.667	411	0	411	0,00
	09.2023	\$ 24.989	INR 2.065.904	122	0	122	0,00
				\$ 255.439	\$ (78.681)	\$ 176.758	1,40

### ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2023	\$ 13.013	CAD 17.706	\$ 368	\$ 0	\$ 368	0,00
CBK	07.2023	13.085	17.830	390	0	390	0,01
JPM	07.2023	13.035	17.683	329	0	329	0,00
MBC	07.2023	CAD 605	\$ 447	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	\$ 300	CAD 402	4	0	4	0,00
UAG	07.2023	623	850	19	0	19	0,00
				\$ 1.110	\$ (11)	\$ 1.099	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, E Class CHF (Hedged) thesaurierend, W Class CHF (Hedged) thesaurierend und W Class CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOS	07.2023	CHF 21	\$ 23	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 383	CHF 343	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	CHF 229.405	\$ 256.504	86	0	86	0,00
	07.2023	\$ 259.072	CHF 234.190	2.695	0	2.695	0,02
	08.2023	256.479	228.730	0	(87)	(87)	0,00
GLM	07.2023	49.977	45.312	671	0	671	0,01
IND	07.2023	CHF 121.237	\$ 134.969	0	(544)	(544)	(0,01)
	08.2023	\$ 134.969	CHF 120.893	544	0	544	0,00
JPM	07.2023	CHF 101	\$ 111	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	421	467	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	\$ 300	CHF 269	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	CHF 3.050	\$ 3.370	0	(40)	(40)	0,00
	07.2023	\$ 103	CHF 94	1	0	1	0,00
RBC	07.2023	CHF 333	\$ 372	1	0	1	0,00
RYL	07.2023	122	136	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2023	4	5	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 278.966	CHF 250.916	1.497	0	1.497	0,01
UAG	07.2023	CHF 237.120	\$ 264.520	0	(522)	(522)	0,00
	07.2023	\$ 221.765	CHF 199.266	965	0	965	0,01
	08.2023	264.477	236.407	521	0	521	0,00
				\$ 6.982	\$ (1.199)	\$ 5.783	0,04

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional GBP (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, E Class USD (Currency Exposure) thesaurierend, E Class USD (Currency Exposure) ausschüttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AZD	07.2023	AUD 2.175	\$ 1.443	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	07.2023	\$ 270	AUD 412	5	0	5	0,00
	08.2023	1.444	2.175	4	0	4	0,00
BOA	07.2023	CLP 241.528	\$ 299	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	DKK 5.589	822	3	0	3	0,00
	07.2023	€ 391	425	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	PEN 1.112	306	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	SEK 28.622	2.652	2	0	2	0,00
	07.2023	THB 72.441	2.036	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	\$ 2.168	AUD 3.320	42	0	42	0,00
	07.2023	23.997	CAD 32.608	645	0	645	0,01
	07.2023	298	CLP 241.516	3	0	3	0,00
	07.2023	22.666	CNY 160.804	0	(508)	(508)	(0,01)
	07.2023	662	COP 2.967.058	49	0	49	0,00
	07.2023	445	DKK 3.079	6	0	6	0,00
	07.2023	465	HUF 162.249	10	0	10	0,00
	07.2023	2.222	¥ 311.031	0	(70)	(70)	0,00
	07.2023	2.976	KRW 3.941.530	16	0	16	0,00
	07.2023	301	NOK 3.313	8	0	8	0,00
	07.2023	373	NZD 615	4	0	4	0,00



Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2023	\$	301	PEN	1.112	\$ 6	\$ 6	0,00
	07.2023		52	SEK	559	0	0	0,00
	08.2023		298	CLP	241.528	2	2	0,00
	08.2023		4.019	CNY	29.033	0	(5)	0,00
	08.2023		822	DKK	5.579	0	(3)	0,00
	08.2023		305	PEN	1.112	1	0	0,00
	08.2023		2.652	SEK	28.587	0	(2)	0,00
	08.2023		2.041	THB	72.441	8	8	0,00
BPS	07.2023	AUD	1.788	\$	1.182	0	(8)	0,00
	07.2023	CHF	3.709		4.147	1	0	0,00
	07.2023	CNY	164.618		22.787	104	104	0,00
	07.2023	€	156.406		171.375	736	736	0,01
	07.2023	£	1.073		1.327	0	(37)	0,00
	07.2023	NOK	809		75	0	0	0,00
	07.2023	TWD	3.965		129	2	2	0,00
	07.2023	\$	617	CNY	4.383	0	(13)	0,00
	07.2023		1.180	CZK	25.996	14	0	0,00
	07.2023		2	DKK	11	0	0	0,00
	07.2023		1.402	€	1.284	0	(2)	0,00
	07.2023		105	£	82	0	(1)	0,00
	07.2023		89.810	¥	12.483.426	0	(3.440)	(0,03 )
	07.2023		33	NZD	55	1	0	0,00
	08.2023		1.031	AUD	1.555	5	0	0,00
	08.2023		4.147	CHF	3.698	0	(1)	0,00
	08.2023		22.787	CNY	164.385	0	(60)	0,00
	08.2023		171.226	€	156.052	0	(740)	(0,01 )
	08.2023		75	NOK	808	0	0	0,00
BRC	07.2023	KRW	3.940.645	\$	2.986	0	(5)	0,00
	07.2023	\$	2.976	KRW	3.937.810	13	0	0,00
	07.2023		1.431	PLN	6.043	56	0	0,00
	08.2023		2.986	KRW	3.935.689	5	0	0,00
CBK	07.2023	CAD	1.285	\$	943	0	(28)	0,00
	07.2023	€	325		350	0	(5)	0,00
	07.2023	ILS	3.410		940	21	0	0,00
	07.2023	MXN	42.784		2.489	0	(5)	0,00
	07.2023	\$	935	AUD	1.433	19	0	0,00
	07.2023		2.233	CNY	15.851	0	(49)	0,00
	07.2023		193	€	178	1	0	0,00
	07.2023		2.378	MXN	42.784	116	0	0,00
	07.2023		27	NOK	295	1	0	0,00
	07.2023		128	TWD	3.977	0	0	0,00
	08.2023	TWD	3.978	\$	128	0	0	0,00
	08.2023	\$	940	ILS	3.407	0	(21)	0,00
	08.2023		2.476	MXN	42.784	5	0	0,00
GLM	07.2023	COP	2.967.058	\$	715	5	5	0,00
	07.2023	NOK	4.987		463	0	(3)	0,00
	07.2023	\$	2.820	MYR	12.650	0	(110)	0,00
	07.2023		2.097	THB	72.441	0	(54)	0,00
	08.2023		708	COP	2.967.058	0	(4)	0,00
	08.2023		463	NOK	4.982	3	0	0,00
IND	07.2023	CHF	94	\$	104	0	0	0,00
	07.2023	\$	1.306	DKK	9.048	20	0	0,00
	08.2023		104	CHF	93	0	0	0,00
JPM	07.2023	€	7.028	\$	7.514	0	(153)	0,00
	07.2023	¥	4.357.101		30.467	321	0	0,00
	07.2023	SGD	99		73	0	0	0,00
	07.2023	\$	2.085	AUD	3.189	38	0	0,00
	08.2023		30.467	¥	4.338.586	0	(323)	0,00
	08.2023		526	KRW	694.391	2	0	0,00
	08.2023		73	SGD	99	0	0	0,00
MBC	07.2023	CAD	1.184	\$	874	0	(21)	0,00
	07.2023	€	1.455		1.559	0	(29)	0,00
	07.2023	\$	22.251	CNY	157.934	0	(489)	0,00
	07.2023		894	€	835	17	0	0,00
	07.2023		31.582	£	25.513	854	0	0,01
	07.2023		1.416	SGD	1.913	0	(2)	0,00
MYI	07.2023	CZK	26.030	\$	1.200	5	0	0,00
	07.2023	DKK	4.984		731	0	0	0,00
	07.2023	IDR	56.374.989		3.741	0	(17)	0,00
	07.2023	MYR	12.650		2.727	16	0	0,00
	07.2023	PLN	6.046		1.493	4	0	0,00
	07.2023	SGD	1.981		1.466	2	0	0,00
	07.2023	\$	52	CHF	47	1	0	0,00
	07.2023		0	CLP	12	0	0	0,00
	07.2023		914	ILS	3.403	3	0	0,00
	07.2023		2.611	SEK	28.031	0	(16)	0,00
	08.2023		1.200	CZK	26.062	0	(5)	0,00
	08.2023		731	DKK	4.976	0	0	0,00
	08.2023		3.741	IDR	56.396.310	8	0	0,00
	08.2023		2.730	MYR	12.650	0	(14)	0,00
	08.2023		1.493	PLN	6.055	0	(5)	0,00
	08.2023		1.466	SGD	1.979	0	(2)	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
SCX	07.2023	AUD	\$	2.120	\$	(6)	0,00			
	07.2023	IDR		5		0	0,00			
	07.2023	\$	AUD	4.501		55	0,00			
	07.2023		CHF	3.614		17	0,00			
	07.2023		NZD	1.601		9	0,00			
	08.2023		AUD	3.194		6	0,00			
SOG	07.2023			2.725		31	0,00			
	07.2023	175.713	€	163.342		2.493	0,02			
TOR	07.2023	AUD	\$	2.596		(20)	0,00			
	07.2023	CAD		15.203		(45)	0,00			
	07.2023	£		24.522		(16)	0,00			
	07.2023	HUF		481		6	0,00			
	07.2023	NZD		2.271		(8)	0,00			
	07.2023	\$	AUD	1.442		17	0,00			
	08.2023			3.931		20	0,00			
	08.2023	15.203	CAD	20.169		45	0,00			
	08.2023	31.167	£	24.522		15	0,00			
	08.2023	481	HUF	163.800		(6)	0,00			
	08.2023	1.383	NZD	2.271		8	0,00			
	07.2023	AUD	\$	4.183		(9)	0,00			
	07.2023	CHF		102		0	0,00			
	07.2023	\$	AUD	330		4	0,00			
07.2023	262	CHF	235		1	0,00				
07.2023	22.223	CNY	156.221		(697)	(0,01)				
07.2023	2	CZK	36		0	0,00				
07.2023	3.741	IDR	56.160.911		1	0,00				
07.2023	2.974	KRW	3.921.725		3	0,00				
07.2023	219	NOK	2.418		7	0,00				
07.2023	125	SGD	169		0	0,00				
08.2023	4.187	AUD	6.265		(9)	(13)	0,00			
08.2023	102	CHF	91		0	0	0,00			
				\$	5.982	\$	(7.095)	\$	(1.113)	(0,01)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) ausschüttend, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, R Class EUR (Hedged) thesaurierend, T Class EUR (Hedged) thesaurierend, W Class EUR (Hedged) thesaurierend und W Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	07.2023	€	\$	4.836	\$	9	0,00			
	07.2023	\$	€	1.298.096	€	1.207.861	19.682	0,16		
BPS	07.2023	€	\$	1.220.730	\$	1.337.499	5.684	0,04		
	07.2023	\$	€	1.299.719	€	1.208.995	19.304	0,15		
CBK	08.2023			1.323.551		1.206.256	0	(0,05)		
	07.2023	€	\$	1.238.349	\$	1.346.016	20	(0,04)		
	07.2023	\$	€	4.690	€	4.347	52	0,00		
	08.2023			1.308.845		1.202.172	4.520	0,04		
JPM	07.2023	€	\$	1.202.172	\$	1.312.651	1.081	0,01		
	07.2023	\$	€	47.005	€	43.964	960	0,01		
MBC	08.2023			1.314.487		1.202.172	0	(0,01)		
	07.2023	€	\$	27.560	\$	29.628	0	0,00		
SOG	07.2023	\$	€	8.473	€	7.898	147	0,00		
	07.2023			1.298.346		1.206.934	18.420	0,15		
				\$	69.879	\$	(12.342)	\$	57.537	0,46

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) thesaurierend, W Class GBP (Hedged) thesaurierend und W Class GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	07.2023	£	\$	43	\$	(1)	0,00			
	07.2023	\$	£	6.162	£	4.872	32	0,00		
BPS	07.2023	£	\$	30	\$	37	0	(0,00)		
	07.2023	\$	£	126.704	£	102.436	3.528	0,03		
BRC	07.2023	£	\$	14	\$	17	0	0,00		
	07.2023	\$	£	3.763	£	3.025	83	0,00		
CBK	07.2023	£	\$	9.279	\$	11.709	8	(96)	0,00	
	07.2023			101.323		128.113	0	(704)	(0,01)	
JPM	08.2023	\$	£	128.140	£	101.323	703	0	0,01	
	07.2023			127.079		102.651	3.426	0	0,03	
MBC	07.2023			126.187		101.529	2.892	0	0,02	
TOR	07.2023	£	\$	102.058	\$	129.685	0	(66)	0,00	
	08.2023	\$	£	129.713	£	102.058	64	0	0,00	
				\$	10.736	\$	(868)	\$	9.868	0,08

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional NOK (Hedged) thesaurierend, Investor NOK (Hedged) thesaurierend und W Class NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 105.240	NOK 1.161.036	\$ 3.132	\$ (1)	\$ 3.131	0,02
BPS	07.2023	NOK 747.566	\$ 69.286	0	(492)	(492)	0,00
	08.2023	\$ 57.195	NOK 614.290	201	0	201	0,00
CBK	07.2023	NOK 189.152	\$ 17.148	0	(507)	(507)	0,00
	07.2023	\$ 90.205	NOK 1.014.373	4.476	0	4.476	0,03
GLM	07.2023	NOK 650.360	\$ 60.339	0	(366)	(366)	0,00
	07.2023	\$ 185	NOK 1.985	0	0	0	0,00
	08.2023	60.339	649.721	367	0	367	0,00
MBC	07.2023	NOK 133.216	\$ 12.078	1	(357)	(356)	0,00
	07.2023	\$ 8	NOK 87	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	NOK 2.574	\$ 241	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 9	NOK 102	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	655	7.059	4	0	4	0,00
SCX	07.2023	NOK 132.468	\$ 12.086	0	(279)	(279)	0,00
	07.2023	\$ 32	NOK 340	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	NOK 132.532	\$ 11.970	0	(400)	(400)	0,00
UAG	07.2023	\$ 80.572	NOK 891.567	2.647	0	2.647	0,02
				\$ 10.829	\$ (2.402)	\$ 8.427	0,07

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	NZD 3	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	07.2023	\$ 31.766	NZD 52.358	311	0	311	0,00
BPS	07.2023	NZD 2.898	\$ 1.757	0	(19)	(19)	0,00
	07.2023	\$ 1.214	NZD 1.971	0	(6)	(6)	0,00
BRC	07.2023	NZD 57.640	\$ 35.051	0	(262)	(262)	0,00
	07.2023	\$ 23.373	NZD 38.932	479	0	479	0,01
	08.2023	35.047	57.640	262	0	262	0,00
CBK	07.2023	NZD 73	\$ 45	0	0	0	0,00
DUB	07.2023	\$ 10	NZD 16	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	NZD 56.492	\$ 34.428	1	(183)	(182)	0,00
	08.2023	\$ 34.307	NZD 56.301	181	0	181	0,00
MYI	07.2023	25.562	42.236	314	0	314	0,00
RYL	07.2023	NZD 175	\$ 108	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	\$ 24.427	NZD 40.231	221	0	221	0,00
TOR	07.2023	NZD 58.593	\$ 35.683	0	(214)	(214)	0,00
	08.2023	\$ 35.600	NZD 58.463	213	0	213	0,00
				\$ 1.983	\$ (684)	\$ 1.299	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK 450.347	\$ 41.727	\$ 37	\$ (3)	\$ 34	0,00
	07.2023	\$ 138	SEK 1.485	1	(1)	0	0,00
	08.2023	40.079	431.992	0	(34)	(34)	0,00
BRC	07.2023	SEK 242	\$ 23	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	\$ 27.855	SEK 304.232	312	0	312	0,00
GLM	07.2023	87	931	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	SEK 19	\$ 2	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 26.972	SEK 290.473	0	(79)	(79)	0,00
MYI	07.2023	SEK 432.715	\$ 40.079	17	0	17	0,00
	07.2023	\$ 39.326	SEK 422.165	0	(241)	(241)	0,00
	08.2023	40.079	432.178	0	(17)	(17)	0,00
SCX	07.2023	SEK 480	\$ 45	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 27.090	SEK 293.027	39	0	39	0,00
				\$ 406	\$ (376)	\$ 30	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II und W Class SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$ 65.357	SGD 88.436	\$ 0	\$ (11)	(11)	0,00
GLM	07.2023	SGD 3.029	\$ 2.255	17	0	17	0,00
	07.2023	\$ 2.524	SGD 3.398	0	(13)	(13)	0,00
JPM	07.2023	SGD 87.984	\$ 65.019	7	0	7	0,00
	07.2023	\$ 6.906	SGD 9.346	0	0	0	0,00
	08.2023	65.019	87.899	0	(5)	(5)	0,00
MBC	07.2023	62.279	84.154	1	(97)	(96)	0,00
	08.2023	118	159	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD 84.903	\$ 62.835	100	0	100	0,00
	08.2023	\$ 62.762	SGD 84.727	0	(95)	(95)	0,00
UAG	07.2023	SGD 256	\$ 191	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 63.197	SGD 85.489	0	(28)	(28)	0,00
				\$ 126	\$ (249)	\$ (123)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 249.723	1,98

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Ginnie Mae, TBA			
4,000 % fällig am 01.08.2053	\$ 7.500	\$ (7.103)	(0,06)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2038	199.400	(176.718)	(1,40)
2,000 % fällig am 01.07.2053	107.526	(87.714)	(0,69)
2,000 % fällig am 01.08.2053	551.624	(450.629)	(3,57)
3,000 % fällig am 01.08.2053	900	(793)	(0,01)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere	\$	(722.957)	(5,73)
Summe Anlagen	\$	15.950.017	126,47
Sonstige Aktiva und Passiva	\$	(3.338.307)	(26,47)
Nettovermögen	\$	12.611.710	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,40 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	3,290 %	17.03.2026	10.03.2022	\$ 33.100	\$ 31.674	0,25
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	21.01.2021	2.005	1.514	0,01
				\$ 35.105	\$ 33.188	0,26

(i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 956 USD (31. Dezember 2022: 1.610 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von 352.461 USD (31. Dezember 2022: 312.124 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 13.960 USD (31. Dezember 2022: 142.980 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 14.570.392	\$ 38.548	\$ 14.608.940
Investmentfonds	1.249.595	0	0	1.249.595
Pensionsgeschäfte	0	721.100	0	721.100
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	20.386	72.953	0	93.339
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(722.957)	0	(722.957)
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.269.981</b>	<b>\$ 14.641.488</b>	<b>\$ 38.548</b>	<b>\$ 15.950.017</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 11.352.524	\$ 8.573	\$ 11.361.097
Investmentfonds	322.306	798.673	0	1.120.979
Pensionsgeschäfte	0	1.346.970	0	1.346.970
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	73.477	(414.644)	0	(341.167)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(721.316)	0	(721.316)
<b>Summen</b>	<b>\$ 395.783</b>	<b>\$ 12.362.207</b>	<b>\$ 8.573</b>	<b>\$ 12.766.563</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
MBC	2,800 %	03.07.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (940)	\$ (1.025)	(0,01)
	3,750	30.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (870)	(870)	(0,01)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (1.895)</b>	<b>(0,02)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 205	\$ 330	\$ 535	\$ (1.118)	\$ 1.920	\$ 802
BOA	28.610	(25.370)	3.240	(61.601)	51.870	(9.731)
BPS	6.617	(4.950)	1.667	2.102	(1.850)	252
BRC	54.200	(52.340)	1.860	1.917	(1.260)	657
CBK	15.509	(15.390)	119	57.544	(56.500)	1.044
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(438)	0	(438)
DUB	(1.154)	560	(594)	(789)	220	(569)
FAR	(622)	400	(222)	(224)	0	(224)
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	40	0	40
GLM	2.854	(2.150)	704	(7.627)	6.700	(927)
GST	45	(40)	5	(287)	280	(7)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(120)	140	20
IND	(3.209)	3.050	(159)	2.835	(2.760)	75
JPM	14.077	(14.700)	(623)	3.194	(3.600)	(406)
MBC	79.744	(77.560)	2.184	(13.437)	11.460	(1.977)
MYC	(131)	270	139	(35)	350	315
MYI	(10.340)	6.480	(3.860)	(9.902)	7.130	(2.772)
RBC	(2.900)	2.870	(30)	(363)	320	(43)
RYL	2	0	2	2	0	2
SCX	1.374	(420)	954	(36.806)	34.940	(1.866)
SOG	20.906	(15.440)	5.466	394	(300)	94
SSB	16.295	(16.720)	(425)	2.274	(1.930)	344
TOR	2.828	(2.820)	8	(12.186)	12.810	624
UAG	24.813	(22.820)	1.993	(15.867)	14.840	(1.027)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Fund (Fort.)

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	66,31	67,82
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	49,52	30,98
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,69
Investmentfonds	9,91	9,82
Pensionsgeschäfte	5,72	11,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,18	0,62
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,42)	(2,82)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,98	(0,79)
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,73)	(6,32)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,02)	(0,01)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,33	1,53
Österreich	k. A.	0,07
Brasilien	k. A.	0,00
Kanada	0,50	0,68
Cayman Inseln	2,05	2,31
China	0,07	0,01
Tschechische Republik	0,00	0,00
Dänemark	2,38	2,36
Finnland	0,01	0,01
Frankreich	2,10	2,98
Deutschland	1,91	2,15
Hongkong	0,17	0,25
Ungarn	0,18	0,04
International	0,22	k. A.
Irland	5,24	5,70
Israel	0,48	0,46
Italien	1,07	1,23
Japan	7,95	6,06
Jersey, Kanalinseln	0,07	0,08
Luxemburg	0,56	0,55
Malaysia	0,27	0,60
Mexiko	0,06	0,12
Multinational	0,09	0,10
Niederlande	0,63	1,10
Neuseeland	0,14	0,21
Norwegen	0,20	0,27
Peru	0,15	0,52
Polen	0,28	0,03
Portugal	0,02	0,01
Katar	0,12	0,13
Rumänien	0,64	0,51
Saudi-Arabien	0,69	0,14
Serbien	k. A.	0,22
Singapur	0,08	k. A.
Slowenien	0,18	0,19
Südafrika	k. A.	0,00
Südkorea	2,46	0,98
Spanien	0,72	0,96
Supranational	0,18	0,20
Schweden	0,00	0,00
Schweiz	1,30	1,25
Thailand	k. A.	0,29
Vereinigte Arabische Emirate	0,06	0,07
Großbritannien	6,00	8,24
Vereinigte Staaten	53,63	39,76
Kurzfristige Instrumente	21,64	17,12
Investmentfonds	9,91	9,82
Pensionsgeschäfte	5,72	11,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,19	0,63
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,07)	(0,13)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,07	k. A.
Zinsswaps – Basisswaps	k. A.	0,01
Zinsswaps	(1,41)	(2,67)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,04	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,09	0,09
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,23)	(0,28)

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	0,02	(0,01)
Devisenterminkontrakte	1,40	(1,70)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,66	1,07
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,73)	(6,32)
Sonstige Aktiva und Passiva	(26,47)	(11,79)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond ESG Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
AerCap Ireland Capital DAC 1,650 % fällig am 29.10.2024	\$ 1.000	\$ 940	0,03	DNB Boligkredit A/S 0,625 % fällig am 19.06.2025	€ 1.600	\$ 1.640	0,05	1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 134.587	\$ 13.927	0,42
5,772 % fällig am 29.09.2023	1.700	1.698	0,05	Doctors Co. An Interinsurance Exchange 4,500 % fällig am 18.01.2032	\$ 600	476	0,01	1,000 % fällig am 01.10.2053	27	3	0,00
AIB Group PLC 4,625 % fällig am 23.07.2029	€ 7.000	7.505	0,22	EQT AB 2,375 % fällig am 06.04.2028	€ 5.000	4.812	0,14	1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
American Tower Corp. 5,250 % fällig am 15.07.2028	\$ 5.000	4.947	0,15	Eurofima Europäische Gesellschaft für die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 3,125 % fällig am 09.11.2031	8.000	8.682	0,26	1,500 % fällig am 01.10.2053	15.128	1.632	0,05
Asian Development Bank 4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN 79.400	4.378	0,13	Europäische Investitionsbank 0,750 % fällig am 15.07.2027	AUD 5.000	2.868	0,09	2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
Aviation Capital Group LLC 4,125 % fällig am 01.08.2025	\$ 1.000	935	0,03	3,300 % fällig am 03.02.2028	1.000	632	0,02	2,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
Banco de Sabadell S.A. 1,125 % fällig am 11.03.2027	€ 2.700	2.670	0,08	Goldman Sachs Group, Inc. 2,650 % fällig am 21.10.2032	\$ 6.900	5.627	0,17	2,500 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
Banco Santander S.A. 1,849 % fällig am 25.03.2026	\$ 400	358	0,01	3,000 % fällig am 15.03.2024	5.900	5.777	0,17	Royal Bank of Canada 0,010 % fällig am 05.10.2028	€ 5.600	5.091	0,15
Bank of America Corp. 2,687 % fällig am 22.04.2032	2.000	1.658	0,05	3,750 % fällig am 30.04.2024	€ 3.200	3.493	0,10	Santander UK Group Holdings PLC 3,530 % fällig am 25.08.2028	6.100	6.273	0,19
4,412 % fällig am 24.08.2025	€ 1.700	1.862	0,06	4,281 % fällig am 07.02.2025	5.200	5.697	0,17	3,625 % fällig am 14.01.2026	€ 300	349	0,01
4,587 % fällig am 22.09.2026	8.000	8.710	0,26	Hana Bank 3,750 % fällig am 04.05.2026	16.200	17.502	0,52	3,823 % fällig am 03.11.2028	\$ 300	270	0,01
5,015 % fällig am 22.07.2033	\$ 6.000	5.873	0,18	HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	\$ 10.940	9.816	0,29	Santander UK PLC 5,234 % fällig am 12.02.2027	€ 700	891	0,03
Barclays PLC 2,667 % fällig am 10.03.2032	6.100	4.800	0,14	HSBC Holdings PLC 2,804 % fällig am 24.05.2032	10.000	8.093	0,24	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	€ 3.300	2.977	0,09
3,125 % fällig am 17.01.2024	€ 1.200	1.498	0,04	2,999 % fällig am 10.03.2026	300	285	0,01	Societe Generale S.A. 1,488 % fällig am 14.12.2026	\$ 4.400	3.875	0,12
4,375 % fällig am 12.01.2026	\$ 2.900	2.787	0,08	3,973 % fällig am 22.05.2030	200	180	0,01	2,226 % fällig am 21.01.2026	4.500	4.182	0,13
6,224 % fällig am 09.05.2034	10.900	10.864	0,32	4,300 % fällig am 08.03.2026	1.600	1.547	0,05	6,691 % fällig am 10.01.2034	8.000	8.150	0,24
BlueHub Loan Fund, Inc. 2,890 % fällig am 01.01.2027	900	799	0,02	6,254 % fällig am 09.03.2034	6.300	6.461	0,19	Standard Chartered PLC 2,678 % fällig am 29.06.2032	6.100	4.785	0,14
3,099 % fällig am 01.01.2030	1.900	1.558	0,05	ING Groep NV 2,125 % fällig am 23.05.2026	€ 8.200	8.534	0,26	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,010 % fällig am 10.09.2025	€ 3.900	3.891	0,12
BNP Paribas S.A. 2,219 % fällig am 09.06.2026	3.600	3.331	0,10	Inter-American Development Bank 2,500 % fällig am 14.04.2027	AUD 600	371	0,01	0,409 % fällig am 07.11.2029	1.300	1.157	0,03
4,375 % fällig am 13.01.2029	€ 6.500	7.063	0,21	Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 3,100 % fällig am 14.04.2038	€ 4.500	4.856	0,15	0,550 % fällig am 06.11.2023	1.650	1.780	0,05
BPCE S.A. 5,748 % fällig am 19.07.2033	\$ 6.100	5.962	0,18	JPMorgan Chase & Co. 2,595 % fällig am 24.02.2026	\$ 3.900	3.700	0,11	2,440 % fällig am 18.06.2024	\$ 1.000	967	0,03
Brookfield Finance, Inc. 2,724 % fällig am 15.04.2031	3.350	2.747	0,08	4,565 % fällig am 14.06.2030	5.100	4.905	0,15	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % fällig am 15.10.2027	€ 2.500	2.317	0,07
Caja Rural de Navarra SCC 0,875 % fällig am 08.05.2025	€ 2.000	2.060	0,06	4,912 % fällig am 25.07.2033	3.700	3.617	0,11	Toronto-Dominion Bank 5,565 % fällig am 12.06.2028	€ 6.200	7.889	0,24
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,900 % fällig am 12.10.2029	6.000	4.793	0,14	5,350 % fällig am 01.06.2034	10.600	10.689	0,32	UBS Group AG 2,593 % fällig am 11.09.2025	\$ 2.080	1.983	0,06
Community Preservation Corp. 2,867 % fällig am 01.02.2030	\$ 3.300	2.768	0,08	Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2023	DKK 180.000	26.225	0,78	2,875 % fällig am 02.04.2032	€ 8.100	7.713	0,23
Cooperative Rabobank UA 3,758 % fällig am 06.04.2033	1.600	1.391	0,04	1,000 % fällig am 01.10.2050	10.610	1.051	0,03	3,750 % fällig am 26.03.2025	\$ 250	239	0,01
Coventry Building Society 0,010 % fällig am 07.07.2028	€ 600	548	0,02	1,500 % fällig am 01.07.2050	0	0	0,00	3,869 % fällig am 12.01.2029	2.000	1.810	0,05
CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	2.700	1.606	0,05	1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	4,177 % fällig am 16.01.2026	€ 340	365	0,01
1,625 % fällig am 23.04.2027	1.200	957	0,03	1,500 % fällig am 01.10.2053	112.123	11.751	0,35	4,194 % fällig am 01.04.2031	\$ 1.800	1.603	0,05
1,750 % fällig am 14.01.2030	5.200	3.443	0,10	2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	4,550 % fällig am 17.04.2026	1.950	1.876	0,06
2,750 % fällig am 22.01.2028	€ 1.000	852	0,03	Kookmin Bank 0,052 % fällig am 15.07.2025	€ 2.100	2.111	0,06	6,442 % fällig am 11.08.2028	2.650	2.662	0,08
Credit Suisse AG 0,250 % fällig am 05.01.2026	€ 900	878	0,03	Lloyds Banking Group PLC 3,900 % fällig am 12.03.2024	\$ 500	492	0,01	6,537 % fällig am 12.08.2033	4.500	4.613	0,14
3,625 % fällig am 09.09.2024	\$ 3.800	3.661	0,11	Logicor Financing SARL 0,625 % fällig am 17.11.2025	€ 3.500	3.350	0,10	7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 2.100	2.541	0,08
6,500 % fällig am 08.08.2023 (d)	7.200	7.174	0,21	Low Income Investment Fund 3,386 % fällig am 01.07.2026	\$ 750	705	0,02	9,016 % fällig am 15.11.2033	\$ 5.700	6.837	0,20
7,500 % fällig am 15.02.2028	4.100	4.359	0,13	3,711 % fällig am 01.07.2029	1.950	1.750	0,05	UniCredit SpA 3,127 % fällig am 03.06.2032	4.700	3.711	0,11
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	€ 3.100	3.015	0,09	MDGH GMTN RSC Ltd. 5,500 % fällig am 28.04.2033	1.400	1.474	0,04	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3,150 % fällig am 12.05.2025	700	654	0,02
0,625 % fällig am 27.09.2026	1.200	1.059	0,03	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,978 % fällig am 09.06.2024	€ 2.200	2.332	0,07	Workspace Group PLC 2,250 % fällig am 11.03.2028	€ 2.300	2.144	0,06
0,875 % fällig am 20.01.2026	1.300	1.211	0,04	Mizuho Financial Group, Inc. 0,958 % fällig am 16.10.2024	4.200	4.405	0,13				
1,500 % fällig am 27.09.2031	1.100	838	0,03	6,540 % fällig am 11.09.2024	\$ 200	200	0,01				
Deutsche Bank AG 0,050 % fällig am 20.11.2024	3.300	3.407	0,10	Morgan Stanley 3,622 % fällig am 01.04.2031	14.700	13.254	0,40	<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
1,375 % fällig am 17.02.2032	1.800	1.457	0,04	Nationwide Building Society 4,302 % fällig am 08.03.2029	300	278	0,01	Broadcom, Inc. 2,450 % fällig am 15.02.2031	\$ 1.600	1.302	0,04
1,625 % fällig am 20.01.2027	2.100	2.038	0,06	4,363 % fällig am 01.08.2024	1.100	1.098	0,03	3,419 % fällig am 15.04.2033	800	669	0,02
1,750 % fällig am 19.11.2030	2.800	2.417	0,07	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.04.2024	DKK 102.700	14.767	0,44	Continental Wind LLC 6,000 % fällig am 28.02.2033	1.658	1.676	0,05
1,875 % fällig am 23.02.2028	4.100	3.964	0,12	1,000 % fällig am 01.10.2050	42.499	4.284	0,13	Dell International LLC 6,200 % fällig am 15.07.2030	2.500	2.599	0,08
2,222 % fällig am 18.09.2024	\$ 1.500	1.481	0,04	1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	Ford Motor Co. 3,250 % fällig am 12.02.2032	3.900	3.072	0,09
2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 600	710	0,02	1,500 % fällig am 01.10.2053	44.294	4.596	0,14	Lendlease Europe Finance PLC 3,500 % fällig am 02.12.2033	€ 1.798	1.497	0,05
2,625 % fällig am 12.02.2026	€ 300	310	0,01	2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	€ 400	435	0,01
3,547 % fällig am 18.09.2031	\$ 500	416	0,01	2,500 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	Oracle Corp. 4,500 % fällig am 06.05.2028	\$ 10.100	9.831	0,30
3,961 % fällig am 26.11.2025	29.500	28.142	0,84	Nykredit Realkredit A/S 0,375 % fällig am 17.01.2028	€ 1.400	1.261	0,04	Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,450 % fällig am 19.05.2028	3.300	3.245	0,10
4,100 % fällig am 13.01.2026	4.200	3.934	0,12	1,000 % fällig am 01.04.2024	DKK 160.400	23.061	0,69	5,110 % fällig am 19.05.2043	3.100	3.109	0,09

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS			
T-Mobile USA, Inc. 5,050 % fällig am 15.07.2033	\$ 7.600	\$ 7.466	0,22	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.09.2027	\$ 2.900	\$ 2.469	0,07	Impac Secured Assets Trust 5,670 % fällig am 25.01.2037	\$ 463	\$ 371	0,01			
ZF North America Capital, Inc. 6,875 % fällig am 14.04.2028	2.700	2.737	0,08	0,625 % fällig am 30.11.2027	12.800	10.965	0,33	IndyMac Mortgage Loan Trust 3,916 % fällig am 25.12.2034	118	112	0,00			
7,125 % fällig am 14.04.2030	3.400	3.462	0,10	0,750 % fällig am 31.01.2028	11.700	10.039	0,30	5,490 % fällig am 25.11.2036	2.443	2.371	0,07			
		48.771	1,46	2,875 % fällig am 30.04.2025	4.200	4.045	0,12	JPMorgan Alternative Loan Trust 5,630 % fällig am 25.10.2036	228	204	0,01			
						213.997	6,40	JPMorgan Mortgage Trust 4,179 % fällig am 25.08.2035	99	95	0,00			
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				6,000 % fällig am 25.06.2037				768	345	0,01
AES Corp. 5,450 % fällig am 01.06.2028	11.700	11.499	0,34	American Home Mortgage Assets Trust 4,916 % fällig am 25.10.2046	81	57	0,00	Lehman XS Trust 5,476 % fällig am 25.03.2047	436	411	0,01			
Electricite de France S.A. 6,250 % fällig am 23.05.2033	4.000	4.069	0,12	5,340 % fällig am 25.10.2046	1.050	579	0,02	Ludgate Funding PLC 4,590 % fällig am 01.01.2061	£ 38	45	0,00			
6,900 % fällig am 23.05.2053	3.000	3.112	0,09	American Home Mortgage Investment Trust 7,129 % fällig am 25.09.2035	170	76	0,00	5,030 % fällig am 01.01.2061	2.301	2.800	0,08			
National Grid PLC 5,809 % fällig am 12.06.2033	3.800	3.869	0,12	Atlas Funding PLC 5,432 % fällig am 25.07.2058	£ 1.712	2.176	0,07	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust 2,925 % fällig am 25.10.2047	\$ 10.448	3.287	0,10			
Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % fällig am 01.04.2053	8.000	7.862	0,24	Atrium Hotel Portfolio Trust 6,373 % fällig am 15.12.2036	\$ 5.000	4.829	0,14	Miravet SARL 4,265 % fällig am 26.05.2065	€ 1.316	1.413	0,04			
Southern Power Co. 0,900 % fällig am 15.01.2026	6.000	5.380	0,16	Avon Finance PLC 5,809 % fällig am 20.09.2048	£ 1.377	1.751	0,05	Mortimer BTL PLC 5,614 % fällig am 23.06.2053	£ 2.245	2.822	0,08			
Verizon Communications, Inc. 5,050 % fällig am 09.05.2033	5.400	5.343	0,16	Bear Stearns ALT-A Trust 3,817 % fällig am 25.11.2036	\$ 612	323	0,01	New Residential Mortgage Loan Trust 3,500 % fällig am 25.12.2057	\$ 937	879	0,03			
		41.134	1,23	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 5,320 % fällig am 25.06.2047	947	799	0,02	Paragon Mortgages PLC 5,752 % fällig am 15.05.2045	£ 108	137	0,00			
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		651.045	19,46	Brass PLC 5,430 % fällig am 16.11.2066	£ 364	464	0,01	Polaris PLC 5,631 % fällig am 23.12.2058	2.069	2.619	0,08			
				Canada Square Funding PLC 5,682 % fällig am 17.06.2058	1.868	2.362	0,07	Residential Accredited Loans, Inc. Trust 5,091 % fällig am 25.11.2037	\$ 249	208	0,01			
<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,852 % fällig am 17.06.2058				3.176	4.019	0,12	5,450 % fällig am 25.06.2037	291	259	0,01
California State General Obligation Bonds, Series 2023 5,125 % fällig am 01.03.2038	3.600	3.623	0,11	6,152 % fällig am 17.12.2057	1.386	1.766	0,05	6,000 % fällig am 25.06.2036	365	291	0,01			
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				Charter Mortgage Funding PLC 5,327 % fällig am 16.01.2057				520	660	0,02	Residential Mortgage Securities PLC 6,159 % fällig am 20.06.2070	£ 1.188	1.515	0,05
Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.03.2060	1.090	964	0,03	Chase Mortgage Finance Trust 4,529 % fällig am 25.07.2037	\$ 7	5	0,00	RESIMAC Bastille Trust 6,093 % fällig am 05.09.2057	\$ 63	63	0,00			
3,500 % fällig am 01.01.2059	640	584	0,02	Citigroup Commercial Mortgage Trust 3,209 % fällig am 10.05.2049	2.100	1.948	0,06	RESIMAC Premier 6,241 % fällig am 07.02.2052	742	742	0,02			
Freddie Mac 3,500 % fällig am 01.05.2048	5.320	4.919	0,15	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 3,994 % fällig am 25.12.2035	343	225	0,01	Ripon Mortgages PLC 5,491 % fällig am 28.08.2056	£ 13.845	17.540	0,53			
4,000 % fällig am 01.06.2048	3.877	3.714	0,11	Commercial Mortgage Trust 3,590 % fällig am 10.11.2047	2.000	1.924	0,06	RMAC Securities PLC 5,154 % fällig am 12.06.2044	34	42	0,00			
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047	23	21	0,00	3,732 % fällig am 10.08.2049	1.000	940	0,03	Sequoia Mortgage Trust 3,723 % fällig am 20.07.2037	\$ 189	152	0,01			
6,464 % fällig am 20.04.2067	199	198	0,01	4,228 % fällig am 10.05.2051	1.700	1.589	0,05	Stratton Mortgage Funding PLC 5,391 % fällig am 20.07.2060	£ 3.026	3.848	0,12			
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.12.2051 - 01.03.2052	47.565	40.419	1,21	Countrywide Alternative Loan Trust 5,390 % fällig am 25.06.2036	73	66	0,00	5,765 % fällig am 12.03.2052	2.011	2.548	0,08			
3,000 % fällig am 01.07.2052	8.161	7.196	0,22	5,500 % fällig am 25.11.2034	120	116	0,00	5,792 % fällig am 25.09.2051	2.599	3.297	0,10			
3,500 % fällig am 01.03.2047 - 01.04.2053	29.260	26.733	0,80	5,570 % fällig am 25.07.2046	448	372	0,01	Structured Asset Securities Corp. 5,430 % fällig am 25.01.2036	\$ 138	109	0,00			
4,000 % fällig am 01.07.2048 - 01.07.2053	129.473	121.637	3,64	5,630 % fällig am 25.08.2047	866	724	0,02	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,440 % fällig am 25.10.2036	285	239	0,01			
4,500 % fällig am 01.12.2052 - 01.06.2053	44.738	43.039	1,29	6,250 % fällig am 25.12.2036	1.036	472	0,01	TBW Mortgage-Backed Trust 5,965 % fällig am 25.07.2037	2.345	749	0,02			
5,000 % fällig am 01.02.2053	138.219	135.521	4,05	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 5,690 % fällig am 25.04.2046	1.851	539	0,02	Towd Point Mortgage Funding PLC 5,635 % fällig am 20.10.2051	£ 661	841	0,03			
5,500 % fällig am 01.02.2053	85.073	84.715	2,53	5,730 % fällig am 25.03.2035	341	280	0,01	5,841 % fällig am 20.07.2045	1.058	1.345	0,04			
6,000 % fällig am 01.01.2053	41.263	41.644	1,24	5,830 % fällig am 25.03.2035	69	61	0,00	Trinidad Mortgage Securities PLC 5,443 % fällig am 24.01.2059	92	116	0,00			
6,500 % fällig am 01.01.2053	22.200	22.682	0,68	6,000 % fällig am 25.07.2036	248	135	0,00	Trinity Square PLC 5,316 % fällig am 15.07.2059	1.720	2.184	0,07			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2053	13.000	11.042	0,33	6,000 % fällig am 25.12.2036	602	261	0,01	Twin Bridges PLC 5,715 % fällig am 12.03.2055	2.598	3.291	0,10			
4,500 % fällig am 01.08.2053	111.400	107.162	3,20	6,000 % fällig am 25.03.2037	598	302	0,01	Uropa Securities PLC 4,879 % fällig am 10.10.2040	258	310	0,01			
5,500 % fällig am 01.08.2053	100.000	99.508	2,97	6,500 % fällig am 25.11.2047	92	50	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,626 % fällig am 25.09.2036	\$ 59	51	0,00			
6,000 % fällig am 01.07.2053	192.600	194.270	5,81	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust 5,450 % fällig am 25.09.2047	724	616	0,02	3,772 % fällig am 25.02.2037	2.721	2.442	0,07			
6,500 % fällig am 01.07.2053	214.400	218.923	6,53	5,710 % fällig am 25.08.2036	4.046	3.649	0,11	3,800 % fällig am 25.10.2035	82	74	0,00			
		1.164.891	34,82	Dutch Property Finance BV 3,892 % fällig am 28.07.2058	€ 2.249	2.450	0,07	4,154 % fällig am 25.09.2033	41	39	0,00			
<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				EMF-UK PLC 5,970 % fällig am 13.03.2046				£ 204	257	0,01	4,976 % fällig am 25.02.2046	258	230	0,01
U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	10.100	6.278	0,19	Eurohome UK Mortgages PLC 5,137 % fällig am 15.06.2044	22	27	0,00	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 5,500 % fällig am 25.04.2035	298	245	0,01			
1,875 % fällig am 15.02.2041	42.500	30.897	0,92	EuroMASTR PLC 5,205 % fällig am 15.06.2040	45	53	0,00			108.059	3,23			
2,875 % fällig am 15.05.2052	6.900	5.721	0,17	Eurosail PLC 3,629 % fällig am 13.03.2045	€ 29	31	0,00							
4,000 % fällig am 15.11.2052	5.200	5.343	0,16	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust 6,250 % fällig am 25.11.2036	\$ 33	11	0,00							
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c) 0,125 % fällig am 15.04.2025	24.777	23.573	0,71	Genesis Mortgage Funding PLC 6,081 % fällig am 15.09.2059	£ 8.124	10.347	0,31							
0,125 % fällig am 15.07.2031	16.636	14.759	0,44	GSR Mortgage Loan Trust 4,481 % fällig am 25.11.2035	\$ 47	47	0,00							
0,125 % fällig am 15.01.2032	27.683	24.384	0,73	5,024 % fällig am 25.10.2035	22	20	0,00							
0,250 % fällig am 15.01.2032	27.020	25.906	0,78											
0,500 % fällig am 15.01.2028	10.452	9.780	0,29											
0,625 % fällig am 15.07.2032	1.566	1.440	0,04											
1,125 % fällig am 15.01.2033	34.722	33.289	1,00											
2,500 % fällig am 15.01.2029	4.168	4.293	0,13											
3,875 % fällig am 15.04.2029	738	816	0,02											

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>											
Accunia European CLO DAC 4,127 % fällig am 15.07.2030	€ 355	\$ 382	0,01	Greenwood Park CLO Ltd. 6,270 % fällig am 15.04.2031	\$ 2.300	\$ 2.267	0,07	Palmer Square European Loan Funding DAC 3,897 % fällig am 15.10.2031	€ 5.441	\$ 5.818	0,17
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 6,050 % fällig am 25.12.2034	\$ 105	94	0,00	Griffith Park CLO DAC 4,103 % fällig am 21.11.2031	€ 1.000	1.070	0,03	3,907 % fällig am 15.07.2031	€ 4.114	4.383	0,13
6,050 % fällig am 25.08.2035	1.413	1.357	0,04	GSAMP Trust 5,650 % fällig am 25.05.2046	\$ 1.329	1.248	0,04	Pepper SPARKZ Trust 5,160 % fällig am 17.08.2028	AUD 536	356	0,01
Adagio CLO DAC 3,897 % fällig am 15.10.2031	€ 2.400	2.568	0,08	5,870 % fällig am 25.11.2035	4.200	3.398	0,10	Renaissance Home Equity Loan Trust 5,762 % fällig am 25.08.2036	\$ 708	282	0,01
Apidos CLO 6,260 % fällig am 20.04.2031	\$ 5.900	5.844	0,17	Harvest CLO DAC 3,817 % fällig am 15.10.2031	€ 3.200	3.408	0,10	Residential Asset Securities Corp. Trust 5,810 % fällig am 25.12.2035	4.997	4.742	0,14
Aqueduct European CLO DAC 3,840 % fällig am 20.07.2030	€ 2.381	2.564	0,08	3,880 % fällig am 20.10.2031	1.200	1.283	0,04	Saxon Asset Securities Trust 1,942 % fällig am 25.05.2035	3.041	2.795	0,08
Ares European CLO DAC 3,957 % fällig am 15.10.2031	2.700	2.895	0,09	3,937 % fällig am 15.07.2031	3.300	3.514	0,11	Sculptor European CLO DAC 3,916 % fällig am 14.01.2032	€ 4.900	5.252	0,16
4,050 % fällig am 20.04.2032	4.100	4.389	0,13	4,027 % fällig am 15.01.2032	4.700	5.018	0,15	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 5,870 % fällig am 25.10.2035	\$ 5.600	4.486	0,13
Argent Securities Trust 5,510 % fällig am 25.04.2036	\$ 5.047	1.670	0,05	4,250 % fällig am 26.06.2030	2.836	3.032	0,09	Segovia European CLO DAC 4,080 % fällig am 20.07.2032	€ 2.700	2.870	0,09
Atlas Senior Loan Fund Ltd. 6,410 % fällig am 16.01.2030	2.851	2.837	0,08	Home Equity Asset Trust 3,883 % fällig am 25.02.2036	\$ 813	782	0,02	Soundview Home Loan Trust 5,555 % fällig am 25.12.2036	\$ 1.396	1.357	0,04
Aurium CLO DAC 3,907 % fällig am 16.01.2031	€ 4.793	5.129	0,15	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 5,370 % fällig am 25.04.2037	258	192	0,01	5,650 % fällig am 25.11.2036	942	874	0,03
Bain Capital Euro CLO DAC 3,940 % fällig am 20.01.2032	1.988	2.122	0,06	7,100 % fällig am 25.03.2035	1.295	1.129	0,03	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,675 % fällig am 25.07.2036	1.129	1.044	0,03
Bayview Financial Asset Trust 6,650 % fällig am 25.03.2037	\$ 98	98	0,00	HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,290 % fällig am 25.01.2037	1.476	1.108	0,03	Terwin Mortgage Trust 6,090 % fällig am 25.11.2033	5	4	0,00
Benefit Street Partners CLO Ltd. 6,350 % fällig am 20.01.2031	2.523	2.503	0,07	IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 4,100 % fällig am 25.03.2035	1.896	1.822	0,05	TIAA CLO Ltd. 6,450 % fällig am 20.07.2031	2.550	2.519	0,08
Black Diamond CLO DAC 4,303 % fällig am 15.05.2032	€ 4.700	5.017	0,15	Jubilee CLO DAC 4,326 % fällig am 15.12.2029	€ 352	380	0,01	Toro European CLO DAC 4,097 % fällig am 15.07.2030	€ 312	338	0,01
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 3,897 % fällig am 15.01.2031	1.988	2.125	0,06	KKR CLO Ltd. 6,440 % fällig am 15.01.2031	\$ 2.902	2.874	0,09	4,133 % fällig am 15.02.2034	€ 5.000	5.309	0,16
4,087 % fällig am 15.01.2033	2.850	3.032	0,09	Laurelin DAC 3,920 % fällig am 20.10.2031	€ 1.500	1.607	0,05	Venture CLO Ltd. 6,140 % fällig am 15.04.2027	\$ 97	97	0,00
BNPP AM Euro CLO DAC 4,031 % fällig am 22.07.2032	4.800	5.117	0,15	Long Beach Mortgage Loan Trust 5,750 % fällig am 25.01.2036	\$ 694	624	0,02	6,350 % fällig am 20.01.2029	2.747	2.728	0,08
Bridgepoint CLO DAC 4,387 % fällig am 15.01.2034	3.400	3.658	0,11	LT Autorahoitus DAC 4,040 % fällig am 18.07.2033	€ 6.960	7.599	0,23	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 5,495 % fällig am 25.01.2037	2.678	2.566	0,08
Cairn CLO BV 3,957 % fällig am 15.10.2031	1.300	1.390	0,04	Madison Park Euro Funding DAC 3,927 % fällig am 15.01.2032	3.200	3.418	0,10			254.511	7,61
Cairn CLO DAC 4,212 % fällig am 20.10.2028	20	22	0,00	3,977 % fällig am 15.07.2032	5.200	5.533	0,17				
Carlyle Euro CLO DAC 3,877 % fällig am 15.01.2031	2.190	2.339	0,07	Madison Park Funding Ltd. 0,000 % fällig am 29.07.2030	\$ 1.976	1.969	0,06	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
4,213 % fällig am 15.08.2032	3.000	3.199	0,10	Man GLG Euro CLO DAC 3,987 % fällig am 15.10.2032	€ 5.194	5.520	0,17	Adif Alta Velocidad 0,550 % fällig am 31.10.2031	€ 5.000	4.225	0,13
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,230 % fällig am 17.04.2031	\$ 3.290	3.262	0,10	MASTR Asset-Backed Securities Trust 5,470 % fällig am 25.08.2036	\$ 12.354	4.544	0,14	Auckland Council 0,250 % fällig am 17.11.2031	5.000	4.236	0,13
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,073 % fällig am 15.11.2031	€ 1.500	1.606	0,05	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 5,390 % fällig am 25.02.2037	633	190	0,01	Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD 5.800	3.455	0,10
Carlyle U.S. CLO Ltd. 6,440 % fällig am 15.01.2030	\$ 3.609	3.578	0,11	5,870 % fällig am 25.05.2036	206	203	0,01	1,000 % fällig am 21.12.2030	2.600	1.399	0,04
Catamaran CLO Ltd. 6,373 % fällig am 22.04.2030	3.793	3.770	0,11	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,220 % fällig am 25.10.2036	811	353	0,01	1,250 % fällig am 21.05.2032	1.200	635	0,02
Cedar Funding CLO Ltd. 6,360 % fällig am 17.07.2031	4.400	4.363	0,13	5,250 % fällig am 25.11.2036	5.930	2.807	0,08	1,750 % fällig am 21.06.2051	1.400	543	0,02
CIFC Funding Ltd. 6,352 % fällig am 27.04.2031	2.300	2.280	0,07	5,400 % fällig am 25.07.2036	61	52	0,00	4,500 % fällig am 21.04.2033	6.000	4.147	0,12
6,440 % fällig am 16.11.2030	4.431	4.414	0,13	5,750 % fällig am 25.12.2034	478	417	0,01	Autonomous Community of Andalusia 0,500 % fällig am 30.04.2031	€ 4.000	3.451	0,10
6,460 % fällig am 17.10.2031	3.200	3.170	0,10	5,825 % fällig am 25.09.2035	3.300	3.062	0,09	Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035	200	217	0,01
CIT Mortgage Loan Trust 6,500 % fällig am 25.10.2037	452	451	0,01	6,110 % fällig am 25.09.2034	680	659	0,02	Autonomous Community of Madrid 0,420 % fällig am 30.04.2031	4.200	3.614	0,11
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,290 % fällig am 25.07.2037	2.010	1.826	0,05	Morgan Stanley Structured Trust 5,450 % fällig am 25.06.2037	2.798	2.555	0,08	BNG Bank NV 0,250 % fällig am 12.01.2032	4.000	3.438	0,10
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^	182	183	0,01	Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. 6,290 % fällig am 20.04.2031	2.500	2.466	0,07	3,300 % fällig am 17.07.2028	AUD 3.000	1.871	0,06
5,380 % fällig am 25.04.2047	5.700	5.188	0,16	New Century Home Equity Loan Trust 5,915 % fällig am 25.02.2035	2.460	2.248	0,07	Bpifrance Financement S.A. 2,000 % fällig am 02.09.2030	€ 4.200	4.232	0,13
5,400 % fällig am 25.02.2036	580	542	0,02	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 5,780 % fällig am 25.02.2036	4.100	3.640	0,11	Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.12.2044	(c) CAD 541	409	0,01
6,125 % fällig am 25.01.2036	2.072	2.008	0,06	NovaStar Mortgage Funding Trust 5,350 % fällig am 25.01.2037	2.485	871	0,03	Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % fällig am 05.05.2026	\$ 5.300	5.235	0,16
CVC Cordatus Loan Fund DAC 4,008 % fällig am 27.01.2031	€ 5.633	6.034	0,18	5,690 % fällig am 25.05.2036	1.700	1.591	0,05	China Government International Bond 3,190 % fällig am 15.04.2053	CNY 28.440	4.057	0,12
Dryden Euro CLO DAC 4,183 % fällig am 15.05.2034	1.250	1.335	0,04	OCP CLO Ltd. 6,370 % fällig am 20.07.2029	2.682	2.665	0,08	Communaute Francaise de Belgique 3,750 % fällig am 22.06.2033	€ 16.300	18.206	0,54
Encore Credit Receivables Trust 5,840 % fällig am 25.07.2035	\$ 454	433	0,01	OCP Euro CLO DAC 4,091 % fällig am 22.09.2034	€ 2.700	2.869	0,09	CPPIB Capital, Inc. 1,500 % fällig am 23.06.2028	AUD 2.300	1.306	0,04
Fremont Home Loan Trust 6,215 % fällig am 25.06.2035	136	129	0,00	Option One Mortgage Loan Trust 5,290 % fällig am 25.01.2037	\$ 256	167	0,01	Development Bank of Japan, Inc. 1,875 % fällig am 02.10.2024	\$ 3.900	3.725	0,11
Gallatin CLO Ltd. 6,311 % fällig am 21.01.2028	157	157	0,00	5,290 % fällig am 25.03.2037	1.174	805	0,02	2,125 % fällig am 01.09.2026	€ 6.000	6.232	0,19
				5,330 % fällig am 25.04.2037	3.031	1.519	0,05	France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.11.2029	(a) 9.900	9.035	0,27
				OZLM Ltd. 6,270 % fällig am 17.07.2029	1.814	1.809	0,05	7,500 % fällig am 25.05.2052	7.700	4.581	0,14
				6,348 % fällig am 16.05.2030	2.814	2.794	0,08				
				6,549 % fällig am 30.10.2030	1.064	1.060	0,03				
				Palmer Square CLO Ltd. 6,360 % fällig am 16.07.2031	3.500	3.470	0,10				

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES	
2,000 % fällig am 25.11.2032	€	6.200	\$	6,271	0,19	Region of Ile de France				2,230 % fällig am 19.07.2032	€	6.000	\$	5,988	0,18
Hungary Government International Bond						3,700 % fällig am 14.06.2038				10.000		11.116		0,33	
5,000 % fällig am 22.02.2027	900	989	0,03		Bundesrepublik Deutschland					0,000 % fällig am 15.08.2031 (a)	53.800	48.632	1,45		
6,250 % fällig am 22.09.2032	\$	4.900	5,033	0,15	Romania Government International Bond					1,375 % fällig am 02.12.2029	1.170	993	0,03		
Israel Government International Bond					2,000 % fällig am 28.01.2032	200	160	0,00		2,000 % fällig am 14.04.2033	400	309	0,01		
1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	64.100	17,056	0,51	2,124 % fällig am 16.07.2031	100	83	0,00		2,125 % fällig am 07.03.2028	14.200	13.478	0,40		
2,000 % fällig am 31.03.2027		7.800	1,966	0,06	2,625 % fällig am 02.12.2040	500	333	0,01		2,750 % fällig am 14.04.2041	600	403	0,01		
3,800 % fällig am 13.05.2060	\$	1.700	1,295	0,04	2,875 % fällig am 14.04.2042	2.000	1.345	0,04		2,875 % fällig am 07.02.2034	2.100	1.857	0,06		
4,500 % fällig am 17.01.2033		2.100	2,070	0,06	6,625 % fällig am 27.09.2029	8.600	9.766	0,29		3,750 % fällig am 07.02.2034	2.100	1.857	0,06		
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro					Serbia Government International Bond					6,625 % fällig am 27.09.2029	8.600	9.766	0,29		
4,000 % fällig am 30.10.2031	€	20.000	22,004	0,66	1,000 % fällig am 23.09.2028	3.100	2.625	0,08		2,050 % fällig am 23.09.2036	2.550	1.711	0,05		
Italy Government International Bond					1,650 % fällig am 03.03.2033	3.000	2.184	0,06		Societe Du Grand Paris EPIC					
6,875 % fällig am 27.09.2023	\$	2.100	2,105	0,06	2,050 % fällig am 23.09.2036	2.550	1.711	0,05		0,700 % fällig am 15.10.2060	4.400	1.901	0,06		
Japan Finance Organization for Municipalities					Societe Nationale SNCF S.A.					3,125 % fällig am 02.11.2027	5.000	5.379	0,16		
0,010 % fällig am 02.02.2028	€	3.600	3,344	0,10	South Korea Government International Bond					2,000 % fällig am 10.06.2031	KRW	34.358.800	23.126	0,69	
Japan Government International Bond					2,000 % fällig am 10.06.2031	KRW	34.358.800	23.126	0,69	3,250 % fällig am 10.06.2033	36.353.420	26.676	0,80		
0,005 % fällig am 01.03.2024	¥	4.110.000	28,467	0,85	4,250 % fällig am 10.12.2032	26.799.020	21.254	0,63		4,250 % fällig am 10.12.2032	26.799.020	21.254	0,63		
0,005 % fällig am 01.04.2024		1.690.000	11,707	0,35	Spain Government International Bond					1,000 % fällig am 30.07.2042	€	3.200	2.202	0,07	
0,005 % fällig am 01.05.2024		1.370.000	9,490	0,28	1,450 % fällig am 31.10.2071	500	265	0,01		1,450 % fällig am 31.10.2071	500	265	0,01		
0,005 % fällig am 01.10.2024		6.820.000	47,265	1,41	3,450 % fällig am 30.07.2066	9.600	9.551	0,29		3,450 % fällig am 30.07.2066	9.600	9.551	0,29		
0,100 % fällig am 10.03.2028		2.944.213	21,470	0,64	Svensk Exportkredit AB					2,000 % fällig am 30.06.2027	5.500	5.676	0,17		
0,200 % fällig am 20.06.2036		500.000	3,275	0,10	Tokyo Metropolitan Government					2,000 % fällig am 30.06.2027	5.500	5.676	0,17		
0,500 % fällig am 20.09.2046		477.000	2,896	0,09	United Kingdom Gilt					2,000 % fällig am 30.06.2027	5.500	5.676	0,17		
0,500 % fällig am 20.03.2049		2.600.000	15,245	0,46	1,250 % fällig am 31.07.2051	£	7.100	4.479	0,13	2,000 % fällig am 30.06.2027	5.500	5.676	0,17		
0,700 % fällig am 20.12.2048		132.000	817	0,02	1,500 % fällig am 31.07.2053	£	7.500	4.980	0,15	2,000 % fällig am 30.06.2027	5.500	5.676	0,17		
0,700 % fällig am 20.06.2051		1.502.000	9,048	0,27	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE					551.504	16,49				
1,300 % fällig am 20.06.2052		620.000	4,331	0,13	COMMERCIAL PAPER										
1,400 % fällig am 20.09.2052		260.000	1,861	0,06	AT+T, Inc.					5,700 % fällig am 19.03.2024	\$	12.700	12.158	0,36	
Kommunalbanken A/S					Global Payments, Inc.					5,930 % fällig am 28.07.2023		2.600	2.588	0,08	
1,900 % fällig am 19.01.2027	AUD	800	484	0,01	Quanta Services, Inc.					5,900 % fällig am 07.07.2023	5.500	5.494	0,16		
Korea Housing Finance Corp.					5,900 % fällig am 10.07.2023	700	699	0,02		5,900 % fällig am 11.07.2023	900	899	0,03		
0,010 % fällig am 29.06.2026	€	1.300	1,257	0,04	5,900 % fällig am 12.07.2023	900	898	0,03		5,900 % fällig am 13.07.2023	900	898	0,03		
3,714 % fällig am 11.04.2027		5.000	5,403	0,16	23.634	0,71									
4,475 % fällig am 06.04.2026	AUD	10.900	7,078	0,21	Summe kurzfristige Instrumente										
Malaysia Government International Bond					Summe Übertragbare Wertpapiere					\$	3.663.093	109,51			
2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	9.583	1,890	0,06											
Malaysia Government Investment Issue															
3,465 % fällig am 15.10.2030		5.724	1,200	0,04											
Mexico Government International Bond															
5,000 % fällig am 27.04.2051	\$	500	435	0,01											
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap															
0,875 % fällig am 21.03.2046	€	3.800	2,418	0,07											
New Zealand Government International Bond															
1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD	1.500	734	0,02											
Ontario Teachers' Finance Trust															
0,900 % fällig am 20.05.2041	€	1.400	1,000	0,03											
1,850 % fällig am 03.05.2032		4.000	3,802	0,11											
Peru Government International Bond															
2,780 % fällig am 01.12.2060	\$	1.500	921	0,03											
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	4.800	1,301	0,04											
6,150 % fällig am 12.08.2032		2.100	555	0,02											
Poland Government International Bond															
3,875 % fällig am 14.02.2033	€	4.200	4,552	0,14											
4,250 % fällig am 14.02.2043		900	966	0,03											
4,875 % fällig am 04.10.2033	\$	2.200	2,164	0,06											
5,500 % fällig am 16.11.2027		600	616	0,02											
5,500 % fällig am 04.04.2053		1.600	1,614	0,05											

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,100 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 100	U.S. Treasury Inflation Protected Securities fällig am 15.01.2030	\$ (102)	\$ 100	\$ 100	0,00
	5,120	30.06.2023	03.07.2023	178.000	U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 31.05.2028	(181.598)	178.000	178.076	5,33
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	26.400	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025	(26.963)	26.400	26.411	0,79
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	1.785	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(1.821)	1.785	1.785	0,05
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (210.484)	\$ 206.285	\$ 206.372	6,17

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond ESG Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	741	\$ 1.986	0,06
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	329	117	0,00
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	329	(74)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	73	29	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	128	53	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	21	33	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	1.978	3.651	0,11
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	759	842	0,03
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	205	(225)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	312	417	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	15	(33)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	325	358	0,01
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	1.677	393	0,01
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	15	(54)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	206	(442)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	542	(834)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	166	190	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	20	(1)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	221	362	0,01
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	320	148	0,00
				<b>\$ 6.916</b>	<b>0,21</b>

### VERKAUFSoPTIONEN

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	76	\$ (33)	\$ (29)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	76	(27)	(4)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	47	0	(2)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	47	0	(221)	(0,01)
				<b>\$ (60)</b>	<b>\$ (256)</b>	<b>(0,01)</b>

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

**\$ 6.660 0,20**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	20.09.2053	£ 15.400	\$ (1.392)	(0,04)	
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	20.09.2033	195.100	(10.205)	(0,30)	
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	20.09.2028	22.400	(1.429)	(0,04)	
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	20.09.2025	29.900	1.100	0,03	
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	16.03.2032	INR 316.000	(248)	(0,01)	
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	15.03.2028	496.310	49	0,00	
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	15.12.2028	¥ 180.000	(4)	0,00	
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	17.03.2031	1.500.000	(74)	0,00	
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	29.11.2029	1.500.000	(57)	0,00	
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	15.12.2031	3.010.000	(120)	0,00	
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	19.06.2029	1.060.000	(49)	0,00	
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	19.06.2039	430.000	84	0,00	
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	15.12.2051	890.000	252	0,01	
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	15.06.2052	360.000	71	0,00	
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	15.03.2028	SGD 14.440	(274)	(0,01)	
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2.684	\$ 900	29	0,00	
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2.696	900	29	0,00	
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2.710	1.000	32	0,00	
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2.714	1.900	61	0,00	
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,250	28.500	(196)	(0,01)	
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	15.12.2023	39.400	1,109	0,03
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	5.300	(120)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,430	31.03.2024	33.000	(266)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	20.200	(759)	(0,02)



Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500 %	15.06.2052	\$ 13.400	\$ (1.611)	(0,05)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	12.300	(546)	(0,02)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,545	20.01.2029	8.200	(366)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	10.300	(469)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	2.300	(103)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,695	15.11.2031	42.700	(3.613)	(0,11)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	139.200	1.760	0,05
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	1.120	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.12.2051	3.000	(412)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	27.180	148	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	26.100	(2.952)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	4.050	(4)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,817	30.04.2029	18.420	1.240	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,819	30.04.2029	12.600	848	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	122.300	6.869	0,21
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	20.570	297	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,048	15.11.2032	8.100	380	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	14.000	(604)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,070	15.11.2032	15.100	675	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	9.600	(176)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,089	15.11.2032	100	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	2.400	(96)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,104	15.11.2032	9.190	385	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,106	15.11.2032	14.500	605	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,139	15.11.2032	19.600	765	0,02
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,150	13.05.2025	361.700	3.529	0,11
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,163	30.09.2029	6.800	(256)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,165	03.10.2053	4.400	14	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,173	15.11.2032	24.700	905	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,174	15.11.2032	13.400	485	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,178	31.08.2027	44.100	(1.380)	(0,04)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,200	13.05.2025	22.500	255	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,224	30.06.2024	7.091	133	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,225	30.09.2029	800	(30)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,240	03.10.2053	4.400	75	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	5.800	(200)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	14.100	(51)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,445	03.10.2038	14.300	5	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	17.400	(308)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	4.900	(82)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	4.400	(39)	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500 %	20.12.2030	\$ 400	\$ 4	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	23.835	194	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,522	30.11.2027	19.640	(316)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	700	(10)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,533	03.10.2038	14.300	(139)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	38.900	739	0,02
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	38.028	328	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,752	03.10.2028	18.400	(29)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	5.800	(48)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,850	03.10.2028	18.400	51	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,898	30.06.2029	15.600	90	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,159	31.03.2025	34.000	569	0,02
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	234.353	1.237	0,04
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024	13.400	(171)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024	13.400	175	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,427	27.09.2024	14.200	(172)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,427	27.09.2024	14.200	145	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,433	06.09.2024	46.500	(707)	(0,02)
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,433	06.09.2024	46.500	486	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024	6.300	(50)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024	6.300	28	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 20.500	(257)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,250	16.06.2031	19.300	(325)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	600	(4)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	27.900	(386)	(0,01)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2028	15.410	554	0,02
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	20.12.2028	24.600	6	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033	46.200	199	0,01
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2053	3.900	4	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	10.05.2025	498.400	(3.051)	(0,09)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF 4.200	(179)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	15.500	(663)	(0,02)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	6.300	(263)	(0,01)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	CNY 83.500	(9)	0,00
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,000	23.11.2024	€ 67.800	(1.254)	(0,04)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2028	KRW 206.689.988	(2.972)	(0,09)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033	19.094.564	20	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.09.2033	23.690.080	51	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD 950	10	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023	53.500	(109)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	35.300	(1.072)	(0,03)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	93.500	(1.062)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month NZD-BBR	5,000	20.03.2025	54.500	(91)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	SEK 11.700	(37)	0,00
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB 1.080.630	365	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	15.09.2023	\$ 39.400	(510)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023	5.300	(69)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023	20.200	(211)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023	12.300	(71)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	20.07.2023	8.200	(46)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.07.2023	10.300	(54)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.07.2023	2.300	(12)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.09.2023	26.100	(240)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023	13.400	29	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023	13.400	(29)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,427	27.07.2023	14.200	(10)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,427	27.09.2023	14.200	44	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,433	06.07.2023	46.500	(81)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,433	06.09.2023	46.500	138	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.07.2023	6.300	(3)	0,00



Zahlung/ Erhalt	variabel Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	4,789 %	07.09.2023	\$ 6.300	\$ 13	0,00
Erhalt		6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 4.800	33	0,00
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	3.000	(28)	0,00
Erhalt		6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.06.2031	6.450	87	0,00
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033	37.200	(977)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	5.700	(25)	0,00
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	40.300	(916)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	207.770	321	0,01
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK 7.400	(5)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€ 600	71	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	1.300	219	0,01
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2036	1.400	(161)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	6.000	(443)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	4.300	(316)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	3.300	(245)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	30.03.2024	130.139	(3.107)	(0,09)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	7.200	(547)	(0,02)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	3.500	(266)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	18.200	(285)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	41.200	(644)	(0,02)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	9.300	(157)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	5.800	(81)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	6.800	(101)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	6.400	(96)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	11.890	(635)	(0,02)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042	6.060	(963)	(0,03)
Erhalt <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	58.300	(587)	(0,02)
Zahlung <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027	136.070	(940)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	327.800	(1.086)	(0,03)
Erhalt <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033	58.910	(154)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	287.460	165	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	47.000	30	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIE	4,870	07.07.2025	MXN 20.400	(9)	0,00
						\$ (27.394)	(0,82)
						\$ (27.394)	(0,82)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**OPTIONSKAUF****ZINSSWAPOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180 %	11.01.2024	8.600	\$ 246	\$ 883	0,02

**OPTIONEN AUF WERTPAPIERE**

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	2.200	\$ 166	\$ 917	0,03

**VERKAUFSOPTIONEN****ZINSSWAPOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	6.200	\$ (19)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	6.200	(19)	(84)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310	11.01.2024	76.400	(247)	(1.849)	(0,06)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2023	4.500	(17)	(22)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	4.500	(17)	(13)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	800	(5)	(2)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	800	(5)	(1)	0,00
BPS	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	2.200	(166)	(842)	(0,03)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	1.000	(7)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	1.000	(7)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	600	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	600	(2)	(3)	0,00
FAR	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	1.700	(12)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	1.700	(12)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,100	31.08.2023	7.900	(58)	(11)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	31.08.2023	7.900	(58)	(80)	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920 %	13.10.2023	5.600	\$ (34)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	5.600	(34)	(120)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	2.500	(16)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	2.500	(16)	(51)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	2.500	(18)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	2.500	(18)	(48)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	2.500	(17)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	2.500	(17)	(47)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	2.600	(18)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	2.600	(18)	(48)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	3.000	(21)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	3.000	(21)	(65)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	5.400	(39)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	5.400	(39)	(104)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	3.000	(20)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	3.000	(20)	(62)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	5.100	(19)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,250	17.11.2023	5.100	(19)	(66)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	4.600	(16)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,150	20.11.2023	4.600	(16)	(64)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	5.200	(16)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,250	07.12.2023	5.200	(16)	(65)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	9.300	(73)	(11)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	9.300	(73)	(171)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	2.800	(21)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	2.800	(21)	(50)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	20.100	(142)	(21)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	800	(3)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	800	(3)	(3)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	9.600	(65)	(2)	0,00
Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	9.600	(65)	(202)	(0,01)	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	1.900	(6)	(3)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	1.900	(6)	(8)	0,00	
							\$ (1.599)	\$ (4.131)	(0,12)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 1.700	\$ (41)	\$ 62	\$ 21	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.100	(27)	40	13	0,00
					\$ (68)	\$ 102	\$ 34	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 14.600	\$ 11.000	\$ 72	\$ (43)	\$ 29	0,00
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	5.100	3.519	(1)	8	7	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	5.000	3.450	(9)	8	(1)	0,00
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	10.100	7.256	44	(27)	17	0,00
						\$ 106	\$ (54)	\$ 52	0,00

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 149.702	\$ (57)	\$ 280	\$ 223	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	40.320	(11)	102	91	0,00
BPS	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	94.570	(38)	179	141	0,01
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	47.895	0	56	56	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,635	05.04.2024	127.141	(29)	20	(9)	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	20.558	43	3	46	0,00
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	8.537	(3)	16	13	0,00
			3,750	15.03.2028	42.080	(127)	89	(38)	0,00
						\$ (222)	\$ 745	\$ 523	0,02

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2023	AUD	3.320	\$ 2.203	\$ 0	\$ (7)	0,00	
	07.2023	\$	737	AUD 1.126	13	0	13	0,00
BOA	08.2023		2.205	3.320	7	0	7	0,00
	07.2023	AUD	8.500	\$ 5.766	108	0	108	0,00
	07.2023	CAD	50.383	37.028	0	(1.049)	(1.049)	(0,03)
	07.2023	DKK	35.412	5.114	0	(75)	(75)	0,00
	07.2023	MXN	71.776	3.899	0	(276)	(276)	(0,01)
	07.2023	NZD	5.349	3.245	0	(32)	(32)	0,00
	07.2023	\$	3.862	AUD 5.924	81	0	81	0,00
	07.2023		2.290	CAD 3.050	15	0	15	0,00
	07.2023		20.627	DKK 140.246	0	(77)	(77)	0,00
	07.2023		1.217	€ 1.114	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023		1.127	£ 886	0	0	0	0,00
	07.2023		19.499	NOK 214.349	508	0	508	0,02
	07.2023		413	PEN 1.516	5	0	5	0,00
	08.2023	CNY	1.769	\$ 258	13	0	13	0,00
	08.2023	DKK	140.012	20.627	78	0	78	0,00
	09.2023	CLP	2.908.781	3.559	0	(36)	(36)	0,00
	09.2023	¥	4.120.000	29.662	820	0	820	0,02
	09.2023	TWD	355.331	11.705	272	0	272	0,01
	09.2023	\$	3.601	IDR 53.909.934	0	(20)	(20)	0,00
	09.2023		8.639	INR 714.528	47	0	47	0,00
	09.2023		3	KRW 3.485	0	0	0	0,00
	09.2023		1.647	PEN 6.043	10	0	10	0,00
BPS	07.2023	AUD	4.133	\$ 2.744	1	(8)	(7)	0,00
	07.2023	CAD	2.526	1.890	0	(19)	(19)	0,00
	07.2023	€	501.328	538.932	0	(8.018)	(8.018)	(0,24)
	07.2023	¥	1.249.547	8.994	349	0	349	0,01
	07.2023	MYR	5.445	1.186	17	0	17	0,00
	07.2023	NOK	47.367	4.406	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	SGD	1.453	1.091	17	0	17	0,00
	07.2023	\$	4.086	AUD 6.238	66	0	66	0,00
	07.2023		56	BRL 274	0	0	0	0,00
	07.2023		420	CHF 375	0	0	0	0,00
	07.2023		554.006	€ 505.576	6	(2.429)	(2.423)	(0,07)
	07.2023		4.185	£ 3.266	0	(33)	(33)	0,00
	08.2023	BRL	274	\$ 56	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	374	420	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	47.871	6.872	267	0	267	0,01
	08.2023	CNY	2.080	304	16	0	16	0,00
	08.2023	€	486.024	533.285	2.306	0	2.306	0,07
	08.2023	TWD	177.855	5.825	114	0	114	0,00
	08.2023	\$	1.573	AUD 2.373	8	0	8	0,00
	08.2023		1.028	CNH 7.105	0	(48)	(48)	0,00
	08.2023		4.406	NOK 47.320	16	0	16	0,00
	08.2023		1.108	TWD 33.746	0	(24)	(24)	0,00
	08.2023		54	ZAR 1.002	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	THB	20	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2024	DKK	79.126	11.744	13	0	13	0,00
BRC	04.2024		86.673	12.926	8	0	8	0,00
	07.2023	£	2.553	3.169	0	(77)	(77)	0,00
	07.2023	¥	8.800.000	68.037	7.033	0	7.033	0,21
	07.2023	MYR	1.117	243	4	0	4	0,00
	07.2023	NZD	126	76	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$	7.779	£ 6.226	137	0	137	0,00
	08.2023		477	CNH 3.307	0	(21)	(21)	0,00
	08.2023		66	ZAR 1.212	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	IDR	182.184	\$ 12	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS	2.726	762	25	0	25	0,00
	09.2023	\$	456	PEN 1.669	2	0	2	0,00
	04.2024	DKK	204.732	\$ 30.585	73	0	73	0,00
	04.2024	¥	1.690.042	13.839	1.621	0	1.621	0,05
	05.2024		1.370.000	11.081	1.132	0	1.132	0,03
BSH	07.2023	\$	1.370	PEN 5.041	21	0	21	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
CBK	07.2023	AUD	3.842	\$ 2.634	\$ 76	\$ 0	0,00		
	07.2023	DKK	269.194	38.669	0	(774)	(0,02)		
	07.2023	£	6.724	8.436	0	(113)	0,00		
	07.2023	ILS	24.718	7.716	1.055	0	1.055	0,03	
	07.2023	NZD	4.317	2.648	3	0	3	0,00	
	07.2023	PEN	5.041	1.384	0	(6)	(6)	0,00	
	07.2023	\$	1.270	AUD 1.947	26	0	26	0,00	
	07.2023		7.767	€ 7.189	81	(5)	76	0,00	
	07.2023		2.896	£ 2.279	1	0	1	0,00	
	07.2023		830	NOK 9.334	41	0	41	0,00	
	07.2023		1.877	PEN 6.875	18	0	18	0,00	
	08.2023	¥	7.743.821	\$ 56.187	2.165	0	2.165	0,06	
	08.2023	PEN	6.056	1.550	0	(115)	(115)	0,00	
	08.2023	TWD	185.168	6.066	119	0	119	0,00	
	08.2023	\$	2.620	CLP 2.170.650	76	0	76	0,00	
	08.2023		1.381	PEN 5.041	6	0	6	0,00	
	09.2023	CNH	66.947	\$ 9.395	135	0	135	0,00	
	09.2023	KRW	68.029.122	52.906	1.058	0	1.058	0,03	
	09.2023	\$	2.764	THB 95.153	0	(60)	(60)	0,00	
	10.2023		14	CLP 11.090	0	0	0	0,00	
	11.2023	ILS	63.106	\$ 18.857	1.739	0	1.739	0,05	
	FAR GLM	07.2023	\$	786	CLP 624.125	0	(9)	(9)	0,00
		07.2023	BRL	86.425	\$ 17.899	0	(17)	(17)	0,00
		07.2023	NOK	292.134	27.103	0	(165)	(165)	0,00
		07.2023	\$	15.994	BRL 86.151	1.864	0	1.864	0,06
		08.2023	CNH	66.533	\$ 9.532	352	0	352	0,01
		08.2023	\$	27.103	NOK 291.846	165	0	165	0,01
		09.2023	TWD	275.377	\$ 9.048	188	0	188	0,01
		09.2023	\$	17.899	BRL 87.382	14	0	14	0,00
		09.2023		16.105	SGD 21.536	0	(146)	(146)	0,00
09.2023			5.321	THB 183.133	0	(117)	(117)	0,00	
07.2023		SGD	5.876	\$ 4.448	104	0	104	0,00	
07.2023		\$	2.833	AUD 4.333	51	0	51	0,00	
07.2023			1.071	CAD 1.421	3	0	3	0,00	
07.2023			3.366	¥ 481.344	0	(35)	(35)	0,00	
07.2023			272	SGD 359	0	(6)	(6)	0,00	
08.2023		CNH	29.416	\$ 4.126	69	0	69	0,00	
08.2023		CNY	2.194	321	17	0	17	0,00	
08.2023		¥	4.655.478	33.642	1.178	0	1.178	0,04	
08.2023		\$	825	CNH 5.703	0	(39)	(39)	0,00	
08.2023			506	HUF 174.852	1	(2)	(1)	0,00	
09.2023		IDR	9.170	\$ 1	0	0	0	0,00	
09.2023		ILS	2.616	736	30	0	30	0,00	
09.2023		KRW	25.286.558	19.528	256	0	256	0,01	
09.2023		PEN	26.331	7.151	0	(69)	(69)	0,00	
09.2023		\$	1.499	IDR 22.550.990	0	(1)	(1)	0,00	
09.2023			14	KRW 18.517	0	0	0	0,00	
09.2023			1.656	SGD 2.215	0	(15)	(15)	0,00	
09.2023			3.353	THB 114.991	0	(86)	(86)	0,00	
10.2023			221	MXN 3.875	1	0	1	0,00	
12.2023			15.647	INR 1.291.210	0	(6)	(6)	0,00	
10.2024	¥	4.060.000	\$ 32.677	2.563	0	2.563	0,08		
MBC	07.2023	AUD	2.337	1.542	0	(14)	(14)	0,00	
	07.2023	€	17.442	18.868	16	(177)	(161)	0,00	
	07.2023	£	85.166	105.917	88	(2.449)	(2.361)	(0,07)	
	07.2023	¥	17.230.000	131.929	12.378	0	12.378	0,37	
	07.2023	SGD	394	293	2	0	2	0,00	
	07.2023	\$	30.705	CAD 40.857	193	(22)	171	0,01	
	07.2023		3.763	€ 3.516	73	0	73	0,00	
	07.2023		5.867	£ 4.708	118	0	118	0,00	
	08.2023	CNH	128.902	\$ 18.114	336	0	336	0,01	
	08.2023	¥	20.330.000	148.815	7.145	0	7.145	0,21	
	09.2023		2.760.000	20.105	808	0	808	0,02	
	09.2023	\$	5	KRW 6.461	0	0	0	0,00	
	10.2023	DKK	178.828	\$ 26.437	90	0	90	0,00	
	03.2024	¥	4.110.103	33.566	4.001	0	4.001	0,12	
	10.2024		2.760.000	22.134	1.663	0	1.663	0,05	
	MYI	07.2023	CHF	164	184	1	0	1	0,00
		07.2023	€	7.808	8.511	0	(7)	(7)	0,00
		07.2023	£	2.650	3.296	0	(73)	(73)	0,00
07.2023		IDR	14.211.310	950	2	0	2	0,00	
07.2023		MYR	372	81	1	0	1	0,00	
07.2023		NZD	355	215	0	(3)	(3)	0,00	
07.2023		\$	3.265	AUD 4.877	0	(18)	(18)	0,00	
07.2023			10	CHF 9	0	0	0	0,00	
07.2023			18.336	DKK 125.075	0	(9)	(9)	0,00	
07.2023			3.513	£ 2.771	13	(3)	10	0,00	
07.2023			946	IDR 14.211.310	2	0	2	0,00	
08.2023		DKK	124.866	\$ 18.336	10	0	10	0,00	
08.2023		TWD	192.093	6.334	165	0	165	0,00	
09.2023		\$	4.703	IDR 70.272.753	0	(35)	(35)	0,00	
09.2023			1.531	THB 52.416	0	(41)	(41)	0,00	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	04.2024	DKK	\$	86.200	12.983	\$ 136	0,00
RBC	07.2023	\$	CAD	1.307	1.718	0	0,00
	08.2023		MXN	24	412	0	0,00
RYL	07.2023	NOK	\$	20.615	1.938	14	0,00
	04.2024	DKK		55.000	8.260	63	0,00
SCX	07.2023	AUD		4.877	3.237	0	0,00
	07.2023	CHF		230	256	0	0,00
	07.2023	MYR		5.445	1.185	16	0,00
	07.2023	NZD		13.931	8.459	0	0,00
	07.2023	\$	AUD	3.997	6.116	75	0,00
	07.2023		CAD	2.773	3.767	73	0,00
	07.2023		£	151	120	1	0,00
	08.2023	CNH	\$	39	5	0	0,00
	08.2023	CNY		5.826	853	47	0,00
	08.2023	\$	AUD	3.240	4.877	9	0,00
	08.2023		CNH	393	2.703	0	0,00
	09.2023	CNH	\$	23.105	3.238	42	0,00
	09.2023	IDR		9.080.446	611	8	0,00
	09.2023	TWD		296.912	9.739	186	0,01
	09.2023	\$	IDR	4.547	68.245.498	0	0,00
	09.2023		PEN	862	3.174	9	0,00
	09.2023		THB	7.994	275.894	0	0,00
SSB	07.2023	CLP	\$	625.020	778	0	0,00
	07.2023	¥		4.390.000	33.289	2.797	0,08
	08.2023			8.170.000	61.547	4.678	0,14
	08.2023	\$	CLP	778	626.825	0	0,00
TOR	07.2023	AUD	\$	6.001	3.964	0	0,00
	07.2023	¥		163.900	1.173	39	0,00
	07.2023	\$	AUD	2.574	3.935	46	0,00
	07.2023		CAD	2.658	3.518	2	0,00
	07.2023		£	100.015	78.708	51	0,00
	07.2023		¥	6.472	932.039	0	0,00
	07.2023		NZD	14.664	24.079	88	0,00
	08.2023	CAD	\$	3.516	2.658	2	0,00
	08.2023	£		78.708	100.037	0	0,00
	08.2023	¥		928.086	6.472	24	0,00
	08.2023	NZD		24.079	14.663	0	0,00
	08.2023	\$	AUD	3.967	6.001	31	0,00
	08.2023		HUF	43	15.108	1	0,00
	09.2023	¥	\$	5.540.000	39.318	498	0,02
UAG	07.2023	AUD		9.565	6.387	33	0,00
	07.2023	¥		11.610.000	88.565	8.180	0,24
	07.2023	\$	AUD	6.529	9.671	10	0,00
	07.2023		NOK	13.550	149.935	445	0,01
	08.2023	¥	\$	2.890.000	21.321	1.227	0,04
	08.2023	\$	AUD	6.392	9.565	13	0,00
	09.2023	CNH	THB	22.152	107.282	0	0,00
	09.2023	ILS	\$	2.264	632	21	0,00
	09.2023	SGD		16.778	12.554	121	0,00
	09.2023	\$	INR	8.177	675.966	40	0,00
						\$ 74.815	1,71
						\$ (17.549)	
						\$ 57.266	

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	\$	21.400	14.201	\$ (44)	0,00
	07.2023	\$	AUD	27.340	41.777	0	0,01
	08.2023			14.212	21.400	44	0,00
BOA	07.2023			83.801	128.959	2.044	0,06
BPS	07.2023	AUD	\$	111.692	73.962	0	(0,01)
	07.2023	\$	AUD	573	856	2	0,00
	08.2023			72.713	109.690	361	0,01
CBK	07.2023			18.100	27.689	352	0,01
JPM	07.2023			26.415	40.404	480	0,01
MYI	07.2023			283	423	0	0,00
RBC	07.2023			1.202	1.811	16	0,00
SCX	07.2023	AUD	\$	37.749	25.059	0	0,00
	07.2023	\$	AUD	21.031	32.184	393	0,01
	08.2023			25.079	37.749	68	0,00
TOR	07.2023	AUD	\$	65.910	43.534	0	(0,01)
	07.2023	\$	AUD	44.551	68.116	790	0,02
	08.2023			43.569	65.910	339	0,01
UAG	07.2023	AUD	\$	136.580	90.811	270	0,00
	07.2023	\$	AUD	32.533	49.695	547	0,02
	08.2023			84.539	127.220	373	0,01
						\$ 6.547	0,15
						\$ (1.414)	
						\$ 5.133	

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 1.498	CHF 1.341	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BPS	07.2023	CHF 186.865	\$ 208.940	70	0	70	0,00
	07.2023	\$ 270.701	CHF 244.893	3.029	0	3.029	0,09
	08.2023	208.940	186.334	0	(71)	(71)	0,00
MBC	07.2023	3.086	2.776	16	0	16	0,00
MYI	07.2023	CHF 2.562	\$ 2.830	0	(33)	(33)	0,00
	07.2023	\$ 2.190	CHF 1.977	20	0	20	0,00
RBC	07.2023	301	269	0	(1)	(1)	0,00
RYL	07.2023	390	351	2	0	2	0,00
SCX	07.2023	198.215	178.112	871	0	871	0,03
UAG	07.2023	CHF 193.036	\$ 215.342	0	(425)	(425)	(0,01)
	07.2023	\$ 179.536	CHF 161.317	777	0	777	0,02
	08.2023	215.342	192.486	424	0	424	0,01
				\$ 5.210	\$ (530)	\$ 4.680	0,14

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend und Institutional GBP (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CLP 548	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	DKK 5	1	0	0	0	0,00
	07.2023	HUF 313	1	0	0	0	0,00
	07.2023	PEN 2	0	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN 6	1	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK 31	3	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 7	AUD 11	0	0	0	0,00
	07.2023	23	CAD 31	1	0	1	0,00
	07.2023	0	CHF 0	0	0	0	0,00
	07.2023	1	CLP 548	0	0	0	0,00
	07.2023	1	CNY 4	0	0	0	0,00
	07.2023	1	COP 2.479	0	0	0	0,00
	07.2023	1	DKK 10	0	0	0	0,00
	07.2023	178	€ 166	3	0	3	0,00
	07.2023	97	¥ 13.439	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	0	KRW 241	0	0	0	0,00
	07.2023	0	NOK 3	0	0	0	0,00
	07.2023	1	NZD 2	0	0	0	0,00
	07.2023	1	PEN 5	0	0	0	0,00
	07.2023	0	SEK 0	0	0	0	0,00
	07.2023	4	THB 128	0	0	0	0,00
	08.2023	THB 128	\$ 4	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 1	CLP 548	0	0	0	0,00
	08.2023	1	DKK 5	0	0	0	0,00
	08.2023	1	HUF 316	0	0	0	0,00
	08.2023	0	PEN 2	0	0	0	0,00
	08.2023	1	PLN 6	0	0	0	0,00
	08.2023	3	SEK 31	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	€ 166	\$ 180	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	MXN 47	3	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 2	AUD 3	0	0	0	0,00
	07.2023	2	CNY 14	0	0	0	0,00
	07.2023	0	COP 419	0	0	0	0,00
	07.2023	0	DKK 0	0	0	0	0,00
	07.2023	32	£ 25	1	0	1	0,00
	07.2023	0	¥ 21	0	0	0	0,00
	07.2023	3	MXN 47	0	0	0	0,00
	07.2023	0	NOK 0	0	0	0	0,00
	07.2023	0	NZD 0	0	0	0	0,00
	07.2023	3	SEK 30	0	0	0	0,00
	08.2023	181	€ 166	1	0	1	0,00
	08.2023	3	MXN 47	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	COP 2.898	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR 80	0	0	0	0	0,00
	07.2023	MYR 14	3	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK 5	0	0	0	0	0,00
	07.2023	PEN 3	1	0	0	0	0,00
	07.2023	THB 128	4	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 1	CHF 1	0	0	0	0,00
	07.2023	1	¥ 112	0	0	0	0,00
	07.2023	3	MYR 14	0	0	0	0,00
	07.2023	1	PLN 6	0	0	0	0,00
	07.2023	0	RON 2	0	0	0	0,00
	07.2023	0	SGD 0	0	0	0	0,00
	08.2023	1	COP 2.898	0	0	0	0,00
	08.2023	3	MYR 14	0	0	0	0,00
	08.2023	0	NOK 5	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	AUD 18	\$ 12	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	CHF 4	\$ 4	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	ILS 4	1	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 3	AUD 4	0	0	0	0,00
	07.2023	0	CAD 0	0	0	0	0,00
	07.2023	3	CHF 3	0	0	0	0,00
	07.2023	73	CNY 512	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	1	CZK 26	0	0	0	0,00
	07.2023	1	HUF 313	0	0	0	0,00
	07.2023	4	IDR 56.540	0	0	0	0,00
	07.2023	1	ILS 4	0	0	0	0,00
	07.2023	9	KRW 11.944	0	0	0	0,00
	07.2023	0	NOK 3	0	0	0	0,00
	07.2023	0	RON 0	0	0	0	0,00
	07.2023	2	SGD 2	0	0	0	0,00
	08.2023	12	AUD 18	0	0	0	0,00
	08.2023	4	CHF 4	0	0	0	0,00
	08.2023	1	ILS 4	0	0	0	0,00
				\$ 6	\$ (7)	\$ (1)	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 1.003	\$ 1.092	\$ 1	\$ (3)	\$ (2)	0,00
	07.2023	\$ 362.446	€ 337.252	5.495	0	5.495	0,16
BPS	07.2023	€ 324.064	\$ 355.076	1.522	0	1.522	0,05
	07.2023	\$ 369.879	€ 343.954	5.384	(10)	5.374	0,16
	08.2023	355.295	323.808	0	(1.535)	(1.535)	(0,05)
CBK	07.2023	€ 374.130	\$ 405.991	0	(2.185)	(2.185)	(0,07)
	07.2023	\$ 2.967	€ 2.747	30	(1)	29	0,00
	08.2023	347.432	319.116	1.200	0	1.200	0,04
JPM	07.2023	€ 325.951	\$ 355.906	293	0	293	0,01
	07.2023	\$ 364.302	€ 340.734	7.439	0	7.439	0,22
	08.2023	356.403	325.951	0	(304)	(304)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 2.698	\$ 2.890	0	(54)	(54)	0,00
	07.2023	\$ 770	€ 716	12	(1)	11	0,00
SCX	07.2023	9.670	9.036	188	0	188	0,01
				\$ 21.564	\$ (4.093)	\$ 17.471	0,52

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 1.078	\$ 1.370	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
BPS	07.2023	278	346	1	(8)	(7)	0,00
	07.2023	\$ 122.460	£ 99.007	3.412	0	3.412	0,10
BRC	07.2023	£ 1.485	\$ 1.880	1	(9)	(8)	0,00
	07.2023	\$ 338	£ 273	8	0	8	0,00
CBK	07.2023	£ 10.059	\$ 12.781	1	(9)	(8)	0,00
	07.2023	\$ 2.397	£ 1.911	33	0	33	0,00
JPM	07.2023	£ 94.765	\$ 119.821	0	(659)	(659)	(0,02)
	08.2023	\$ 119.847	£ 94.765	657	0	657	0,02
MBC	07.2023	£ 229	\$ 293	2	0	2	0,00
	07.2023	\$ 122.876	£ 99.258	3.315	0	3.315	0,10
MYI	07.2023	122.052	98.202	2.798	0	2.798	0,09
TOR	07.2023	£ 94.962	\$ 120.668	0	(62)	(62)	0,00
	08.2023	\$ 120.694	£ 94.962	60	0	60	0,00
				\$ 10.288	\$ (748)	\$ 9.540	0,29

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	NOK 1.767	\$ 166	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2023	\$ 247.051	NOK 2.734.562	8.196	(4)	8.192	0,25
BPS	07.2023	NOK 1.545.613	\$ 143.765	0	(501)	(501)	(0,01)
	07.2023	\$ 354	NOK 3.886	9	0	9	0,00
	08.2023	143.765	1.544.092	506	0	506	0,02
	07.2023	122.445	1.373.378	5.744	0	5.744	0,17
CBK	07.2023	NOK 1.634.758	\$ 151.669	0	(919)	(919)	(0,03)
GLM	08.2023	\$ 151.669	NOK 1.633.151	924	0	924	0,03
MBC	07.2023	5.529	60.386	107	0	107	0,00
MYI	07.2023	183	1.980	2	0	2	0,00
RYL	07.2023	1.746	18.810	10	0	10	0,00
SCX	07.2023	1.123	12.123	9	0	9	0,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
TOR	07.2023	\$ 3.566	NOK 39.483	\$ 119	\$ 0	\$ 119	0,00
UAG	07.2023	154.376	1.708.238	5.071	0	5.071	0,15
				\$ 20.698	\$ (1.424)	\$ 19.274	0,58

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 12.158	NZD 20.039	\$ 119	\$ 0	\$ 119	0,00
BRC	07.2023	NZD 22.129	\$ 13.456	0	(101)	(101)	0,00
	07.2023	\$ 8.950	NZD 14.909	183	0	183	0,01
	08.2023	13.455	22.129	101	0	101	0,00
CBK	07.2023	NZD 302	\$ 182	0	(3)	(3)	0,00
MYI	07.2023	\$ 9.796	NZD 16.186	120	0	120	0,00
RYL	07.2023	1	1	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	9.349	15.398	85	0	85	0,00
				\$ 608	\$ (104)	\$ 504	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK 187.093	\$ 17.421	\$ 100	\$ (1)	\$ 99	0,00
	07.2023	\$ 97	SEK 1.056	1	0	1	0,00
	08.2023	4.636	49.970	0	(4)	(4)	0,00
BRC	07.2023	SEK 79.891	\$ 7.475	79	0	79	0,00
	07.2023	\$ 304	SEK 3.255	0	(3)	(3)	0,00
CBK	07.2023	SEK 51.306	\$ 4.768	18	0	18	0,00
	07.2023	\$ 10.071	SEK 110.001	113	0	113	0,01
GLM	07.2023	SEK 93	\$ 9	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 33	SEK 357	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	9.500	102.313	0	(28)	(28)	0,00
MYI	07.2023	SEK 101.359	\$ 9.404	20	0	20	0,00
	07.2023	\$ 14.104	SEK 151.418	0	(86)	(86)	0,00
	08.2023	4.636	49.991	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2023	SEK 1.845	\$ 171	1	(1)	0	0,00
	07.2023	\$ 9.535	SEK 103.135	13	0	13	0,00
				\$ 345	\$ (125)	\$ 220	0,01

Summe Freiverkehrsfinauzderivate

\$ 112.365 3,36

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2038	\$ 29.000	\$ (25.701)	(0,77)
2,000 % fällig am 01.08.2053	114.550	(93.578)	(2,79)
4,000 % fällig am 01.08.2053	5.300	(4.978)	(0,15)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (124.257)	(3,71)
Summe Anlagen		\$ 3.836.752	114,71
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (491.918)	(14,71)
Nettovermögen		\$ 3.344.834	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 78.239 USD (31. Dezember 2022: 78.217 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 370 USD (31. Dezember 2022: 44.770 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.663.012	\$ 81	\$ 3.663.093
Pensionsgeschäfte	0	206.285	0	206.285
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	5.612	86.019	0	91.631
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(124.257)	0	(124.257)
<b>Summen</b>	<b>\$ 5.612</b>	<b>\$ 3.831.059</b>	<b>\$ 81</b>	<b>\$ 3.836.752</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.913.880	\$ 0	\$ 2.913.880
Investmentfonds	5.649	0	0	5.649
Pensionsgeschäfte	0	1.157.847	0	1.157.847
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	10.275	(67.767)	0	(57.492)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(119.122)	0	(119.122)
<b>Summen</b>	<b>\$ 15.924</b>	<b>\$ 3.884.838</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 3.900.762</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 510	\$ (370)	\$ 140	\$ 569	\$ (270)	\$ 299
BOA	15.557	(11.790)	3.767	(19.412)	16.030	(3.382)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	68	0	68
BPS	4.605	(3.010)	1.595	(119)	70	(49)
BRC	10.201	(9.860)	341	511	(350)	161
BSH	21	0	21	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	10.820	(10.210)	610	21.756	(21.180)	576
FAR	(100)	320	220	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	1.253	(1.200)	53	(1.813)	1.600	(213)
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(6)	0	(6)
GST	13	0	13	(69)	70	1
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(2)	0	(2)
JPM	11.895	(10.640)	1.255	634	(560)	74
MBC	27.618	(27.110)	508	(11.665)	10.830	(835)
MYC	(198)	50	(148)	(127)	50	(77)
MYI	2.978	(2.070)	908	(1.837)	1.310	(527)
RBC	(6)	0	(6)	128	0	128
RYL	89	0	89	(29)	0	(29)
SCX	1.713	(1.100)	613	9.488	(8.580)	908
SSB	7.475	(7.620)	(145)	488	(420)	68
TOR	1.493	(1.050)	443	(8.559)	7.570	(989)
UAG	16.428	(14.040)	2.388	(8.383)	7.240	(1.143)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	60,44	34,52
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	49,07	58,42
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,85
Investmentfonds	k. A.	0,18
Pensionsgeschäfte	6,17	37,28
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,20	0,30
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,82)	(1,56)
Freiverkehrsfinanzderivate	3,36	(0,59)
Leerverkaufte Wertpapiere	(3,71)	(3,83)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	19,46	15,77
Kommunalanleihen und Wechsel	0,11	0,00
US-Regierungsbehörden	34,82	16,84
US-Schatzobligationen	6,40	3,33
Non-Agency-MBS	3,23	3,93
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,61	8,18
Staatsemissionen	16,49	10,32
Vorzugswertpapiere	k. A.	0,00
Kurzfristige Instrumente	21,39	35,42
Investmentfonds	k. A.	0,18
Pensionsgeschäfte	6,17	37,28
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,21	0,30
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps — Basiswaps	k. A.	0,00
Zinsswaps	(0,82)	(1,56)
Freiverkehrsinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,02	0,03
Optionen auf Wertpapiere	0,03	0,03
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,12)	(0,15)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	0,02	(0,01)
Devisenterminkontrakte	1,71	(1,97)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,70	1,48
Leerverkaufte Wertpapiere	(3,71)	(3,83)
Sonstige Aktiva und Passiva	(14,71)	(25,57)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>				
<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
Pepper SPARKZ Trust				
5,160 % fällig am 17.08.2028	AUD	368	\$ 245	0,03
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				
RESIMAC Bastille Trust				
6,093 % fällig am 05.09.2057	\$	134	134	0,02
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>Australia Government International Bond</b>				
0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD	12.200	7.268	0,99
1,000 % fällig am 21.12.2030		1.100	592	0,08
1,000 % fällig am 21.11.2031		1.200	629	0,09
1,250 % fällig am 21.05.2032		900	476	0,06
1,750 % fällig am 21.06.2051		1.300	504	0,07
2,500 % fällig am 21.05.2030		800	485	0,07
4,500 % fällig am 21.04.2033		3.900	2.695	0,37
			12.649	1,73
Summe Australien			13.028	1,78
<b>BELGIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
KBC Group NV				
5,796 % fällig am 19.01.2029	\$	800	795	0,11
<b>KANADA</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % fällig am 29.03.2028	€	1.600	1.572	0,21
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>Canada Government International Bond</b>				
1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD	1.050	586	0,08
2,000 % fällig am 01.12.2051		650	389	0,05
2,750 % fällig am 01.12.2048		400	282	0,04
<b>Canadian Government Real Return Bond</b>				
1,500 % fällig am 01.12.2044	(d)	947	716	0,10
Ontario Teachers' Finance Trust				
0,900 % fällig am 20.05.2041	€	700	500	0,07
1,850 % fällig am 03.05.2032		3.300	3.137	0,43
Province of Ontario				
0,010 % fällig am 25.11.2030		2.300	1.966	0,27
			7.576	1,04
Summe Kanada			9.148	1,25
<b>CAYMAN INSELN</b>				
<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
Apidos CLO				
6,260 % fällig am 20.04.2031	\$	2.400	2.377	0,33
BlueMountain CLO Ltd.				
6,340 % fällig am 15.07.2031		2.000	1.974	0,27
Catamaran CLO Ltd.				
6,373 % fällig am 22.04.2030		2.293	2.280	0,31
CBAM Ltd.				
6,280 % fällig am 17.04.2031		2.000	1.977	0,27
LCM LP				
6,290 % fällig am 20.10.2027		276	277	0,04
Regatta Funding Ltd.				
6,510 % fällig am 17.10.2030		992	988	0,13
TIAA CLO Ltd.				
6,450 % fällig am 20.07.2031		2.200	2.173	0,30
Venture CLO Ltd.				
6,140 % fällig am 15.04.2027		243	242	0,03
6,300 % fällig am 20.07.2030		2.409	2.386	0,33
Voya CLO Ltd.				
6,458 % fällig am 15.10.2030		1.646	1.641	0,22
			16.315	2,23
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Gaci First Investment Co.				
4,750 % fällig am 14.02.2030		1.400	1.380	0,19
4,875 % fällig am 14.02.2035		1.500	1.440	0,20
5,125 % fällig am 14.02.2053		700	631	0,09
KSA Sukuk Ltd.				
5,268 % fällig am 25.10.2028	\$	600	613	0,08

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>QNB Finance Ltd.</b>				
1,375 % fällig am 26.01.2026		200	181	0,02
<b>Sands China Ltd.</b>				
5,625 % fällig am 08.08.2025		500	488	0,07
5,900 % fällig am 08.08.2028		900	859	0,12
<b>U.S. Capital Funding Ltd.</b>				
6,049 % fällig am 01.08.2034		66	65	0,01
			5.657	0,78
Summe Cayman Inseln			21.972	3,01
<b>CHINA</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
China Development Bank				
4,040 % fällig am 10.04.2027	CNY	1.580	229	0,03
<b>China Government International Bond</b>				
2,370 % fällig am 20.01.2027		25.000	3.442	0,47
2,440 % fällig am 15.10.2027		149.740	20.639	2,83
3,010 % fällig am 13.05.2028		13.300	1.882	0,26
3,190 % fällig am 15.04.2053		1.100	157	0,02
3,530 % fällig am 18.10.2051		29.100	4.339	0,59
Summe China			30.688	4,20
<b>DÄNEMARK</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	39.574	3.969	0,54
1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.07.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		2.084	216	0,03
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
<b>Nordea Kredit Realkreditaktieselskab</b>				
1,500 % fällig am 01.10.2050		37.949	3.846	0,53
1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		5.962	658	0,09
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
<b>Nykredit Realkredit A/S</b>				
1,000 % fällig am 01.04.2024		7.300	1.050	0,14
1,000 % fällig am 01.10.2050		40.406	4.236	0,58
1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		23.189	2.440	0,33
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2036		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
<b>Realkredit Danmark A/S</b>				
1,000 % fällig am 01.10.2050		13.491	1.421	0,20
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2036		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2047		0	0	0,00
Summe Dänemark			17.836	2,44
<b>FRANKREICH</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Societe Generale S.A.				
1,488 % fällig am 14.12.2026	\$	700	616	0,08
2,797 % fällig am 19.01.2028		700	621	0,09
3,337 % fällig am 21.01.2033		2.100	1.683	0,23
			2.920	0,40
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Agence Francaise de Developpement				
1,125 % fällig am 02.03.2037	€	2.900	2.365	0,32
<b>France Government International Bond</b>				
0,500 % fällig am 25.05.2072		900	387	0,05
0,750 % fällig am 25.05.2052		8.100	4.819	0,66
2,000 % fällig am 25.05.2048		11.500	9.925	1,36
3,250 % fällig am 25.05.2045		200	219	0,03
			17.715	2,42
Summe Frankreich			20.635	2,82
<b>DEUTSCHLAND</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>Deutsche Bank AG</b>				
0,050 % fällig am 20.11.2024	€	4.900	\$ 5.059	0,69
1,000 % fällig am 19.11.2025		100	103	0,01
1,375 % fällig am 03.09.2026		3.400	3.410	0,47
1,375 % fällig am 17.02.2032		1.500	1.214	0,17
1,625 % fällig am 20.01.2027		3.300	3.202	0,44
1,750 % fällig am 19.11.2030		1.000	863	0,12
3,729 % fällig am 14.01.2032				
(g)	\$	300	227	0,03
3,961 % fällig am 26.11.2025		900	859	0,12
<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b>				
5,000 % fällig am 19.03.2024	AUD	100	67	0,01
<b>Landwirtschaftliche Rentenbank</b>				
5,375 % fällig am 23.04.2024	NZD	1.100	671	0,09
Summe Deutschland			15.675	2,15
<b>UNGARN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>Hungary Government International Bond</b>				
5,000 % fällig am 22.02.2027	€	200	220	0,03
6,250 % fällig am 22.09.2032	\$	1.000	1.027	0,14
Summe Ungarn			1.247	0,17
<b>IRLAND</b>				
<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
Accunia European CLO DAC				
4,127 % fällig am 15.07.2030	€	568	612	0,08
Armada Euro CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.07.2031		800	853	0,12
Aurium CLO DAC				
3,907 % fällig am 16.01.2031		2.097	2.244	0,31
Black Diamond CLO DAC				
4,303 % fällig am 15.05.2032		2.400	2.562	0,35
BNPP AM Euro CLO DAC				
4,031 % fällig am 22.07.2032		2.200	2.345	0,32
Cairn CLO DAC				
3,842 % fällig am 30.04.2031		1.577	1.686	0,23
3,957 % fällig am 15.10.2031		850	909	0,12
Carlyle Euro CLO DAC				
3,877 % fällig am 15.01.2031		1.493	1.595	0,22
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				
4,137 % fällig am 20.01.2033		1.900	2.009	0,27
Dryden Euro CLO DAC				
3,837 % fällig am 15.04.2033		1.200	1.281	0,17
4,183 % fällig am 15.05.2034		1.200	1.281	0,17
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
4,100 % fällig am 20.01.2032		2.000	2.128	0,29
Griffith Park CLO DAC				
4,103 % fällig am 21.11.2031		1.000	1.070	0,15
Harvest CLO DAC				
3,880 % fällig am 20.10.2031		1.000	1.069	0,15
3,937 % fällig am 15.07.2031		2.100	2.236	0,31
4,027 % fällig am 15.01.2032		2.100	2.242	0,31
Jubilee CLO DAC				
3,777 % fällig am 15.04.2030		1.200	1.279	0,17
3,827 % fällig am 15.04.2031		800	852	0,12
4,326 % fällig am 15.12.2029		176	190	0,03
Laurelin DAC				
3,920 % fällig am 20.10.2031		2.100	2.250	0,31
Madison Park Euro Funding DAC				
3,977 % fällig am 15.07.2032		2.200	2.341	0,32
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,940 % fällig am 20.10.2031		2.200	2.337	0,32
Palmer Square European Loan Funding DAC				
3,897 % fällig am 15.10.2031		2.392	2.558	0,35
Sculptor European CLO DAC				
3,916 % fällig am 14.01.2032		2.100	2.251	0,31
Segovia European CLO DAC				
4,080 % fällig am 20.07.2032		2.000	2.126	0,29
Toro European CLO DAC				
4,133 % fällig am 15.02.2034		2.200	2.336	0,32
			44.642	6,11

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
AerCap Ireland Capital DAC	\$ 600	\$ 590	0,08	
1,150 % fällig am 29.10.2023				
1,650 % fällig am 29.10.2024	500	470	0,06	
1,750 % fällig am 29.10.2024	500	470	0,06	
		1.530	0,20	
Summe Irland		46.172	6,31	
<b>ISRAEL</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Israel Government International Bond				
0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS 13.100	3.517	0,48	
1,500 % fällig am 30.11.2023	11.000	2.927	0,40	
2,000 % fällig am 31.03.2027	7.600	1.916	0,26	
4,500 % fällig am 17.01.2033	\$ 500	493	0,07	
Summe Israel		8.853	1,21	
<b>ITALIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
AMCO - Asset Management Co. SpA				
1,500 % fällig am 17.07.2023	€ 777	847	0,12	
4,625 % fällig am 06.02.2027	1.100	1.193	0,16	
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
0,875 % fällig am 08.10.2027	200	195	0,03	
2,000 % fällig am 29.01.2024	2.200	2.369	0,32	
2,625 % fällig am 28.04.2025	100	102	0,01	
UniCredit SpA				
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 2.800	2.817	0,39	
		7.523	1,03	
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Cassa Depositi e Prestiti SpA				
5,750 % fällig am 05.05.2026	1.100	1.086	0,15	
Italy Government International Bond				
6,000 % fällig am 04.08.2028	£ 100	124	0,02	
		1.210	0,17	
Summe Italien		8.733	1,20	
<b>JAPAN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Mizuho Financial Group, Inc.				
3,922 % fällig am 11.09.2024	\$ 1.000	995	0,14	
6,540 % fällig am 11.09.2024	1.500	1.502	0,21	
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
0,409 % fällig am 07.11.2029	€ 1.800	1.602	0,22	
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
0,010 % fällig am 15.10.2027	2.000	1.854	0,25	
		5.953	0,82	
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Japan Government International Bond				
0,005 % fällig am 01.03.2024	¥ 620.000	4.294	0,59	
0,005 % fällig am 01.04.2024	690.000	4.780	0,66	
0,005 % fällig am 01.05.2024	310.000	2.147	0,29	
0,005 % fällig am 01.10.2024	1.320.000	9.148	1,25	
0,100 % fällig am 10.03.2028				
(d)	1.024.212	7.469	1,02	
0,500 % fällig am 20.03.2049	976.000	5.723	0,78	
0,700 % fällig am 20.12.2048	1.188.000	7.353	1,01	
0,700 % fällig am 20.09.2051	660.000	3.972	0,54	
Tokyo Metropolitan Government				
0,750 % fällig am 16.07.2025	\$ 800	730	0,10	
		45.616	6,24	
Summe Japan		51.569	7,06	
<b>LUXEMBURG</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Aroundtown S.A.				
0,000 % fällig am 16.07.2026	€ 700	586	0,08	
(b)				
0,375 % fällig am 15.04.2027	100	78	0,01	

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				
CPI Property Group S.A.				
2,750 % fällig am 12.05.2026	2.100	1.865	0,26	
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % fällig am 19.11.2025	500	471	0,07	
Logicor Financing SARL				
0,625 % fällig am 17.11.2025	€ 1.400	\$ 1.340	0,18	
		4.340	0,60	
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				
Miravet SARL				
4,265 % fällig am 26.05.2065	900	967	0,13	
Summe Luxemburg		5.307	0,73	
<b>MALAYSIA</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Petronas Capital Ltd.				
2,480 % fällig am 28.01.2032	\$ 400	334	0,04	
3,500 % fällig am 21.04.2030	400	370	0,05	
4,550 % fällig am 21.04.2050	300	276	0,04	
4,800 % fällig am 21.04.2060	300	283	0,04	
		1.263	0,17	
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Malaysia Government International Bond				
2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR 2.157	425	0,06	
3,885 % fällig am 15.08.2029	10.179	2.198	0,30	
Malaysia Government Investment Issue				
3,465 % fällig am 15.10.2030	3.002	629	0,09	
		3.252	0,45	
Summe Malaysia		4.515	0,62	
<b>MEXIKO</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Mexico Government International Bond				
4,000 % fällig am 15.03.2115	€ 400	323	0,04	
<b>MULTINATIONAL</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Preferred Term Securities Ltd.				
5,914 % fällig am 23.06.2035	\$ 849	798	0,11	
<b>NIEDERLANDE</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Cooperatieve Rabobank UA				
3,758 % fällig am 06.04.2033	600	522	0,07	
CTP NV				
0,625 % fällig am 27.09.2026	€ 600	529	0,07	
0,875 % fällig am 20.01.2026	900	839	0,12	
1,500 % fällig am 27.09.2031	600	457	0,06	
ING Groep NV				
2,125 % fällig am 23.05.2026	400	416	0,06	
		2.763	0,38	
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				
Jubilee Place BV				
4,177 % fällig am 17.10.2057	887	967	0,13	
Summe Niederlande		3.730	0,51	
<b>NEUSEELAND</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
New Zealand Government International Bond				
1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD 1.300	636	0,09	
<b>NORWEGEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Kommunalbanken A/S				
1,900 % fällig am 19.01.2027	AUD 1.600	968	0,13	
Norway Government International Bond				
1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK 6.300	565	0,08	
Summe Norwegen		1.533	0,21	
<b>PERU</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 2.400	635	0,09	

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Peru Government International Bond				
6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN 100	\$ 26	0,00	
Summe Peru		661	0,09	
<b>POLEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Poland Government International Bond				
3,875 % fällig am 14.02.2033	€ 900	975	0,13	
4,250 % fällig am 14.02.2043	200	215	0,03	
4,875 % fällig am 04.10.2033	\$ 500	492	0,07	
5,500 % fällig am 16.11.2027	200	205	0,03	
5,500 % fällig am 04.04.2053	400	404	0,05	
Summe Polen		2.291	0,31	
<b>PORTUGAL</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Banco Espirito Santo S.A.				
4,000 % fällig am 21.01.2019	€ 400	107	0,01	
4,750 % fällig am 15.01.2018	700	187	0,03	
EDP - Energias de Portugal S.A.				
2,375 % fällig am 27.11.2023	800	867	0,12	
Summe Portugal		1.161	0,16	
<b>KATAR</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
QatarEnergy				
2,250 % fällig am 12.07.2031	\$ 400	336	0,05	
<b>RUMÄNIEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Romania Government International Bond				
1,375 % fällig am 02.12.2029	€ 630	534	0,07	
1,750 % fällig am 13.07.2030	1.000	834	0,11	
2,000 % fällig am 28.01.2032	600	481	0,07	
2,000 % fällig am 14.04.2033	700	541	0,07	
2,124 % fällig am 16.07.2031	400	332	0,05	
2,625 % fällig am 02.12.2040	600	400	0,05	
2,875 % fällig am 13.04.2042	800	538	0,07	
3,750 % fällig am 07.02.2034	800	707	0,10	
5,000 % fällig am 27.09.2026	1.700	1.864	0,26	
Summe Rumänien		6.231	0,85	
<b>SAUDI-ARABIEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Saudi Arabia Government International Bond				
3,250 % fällig am 22.10.2030	\$ 400	363	0,05	
4,750 % fällig am 18.01.2028	1.900	1.886	0,26	
4,875 % fällig am 18.07.2033	2.200	2.201	0,30	
Summe Saudi-Arabien		4.450	0,61	
<b>SERBIEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Serbia Government International Bond				
1,000 % fällig am 23.09.2028	€ 600	508	0,07	
2,050 % fällig am 23.09.2036	900	604	0,08	
Summe Serbien		1.112	0,15	
<b>SINGAPUR</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.				
4,650 % fällig am 19.05.2030	\$ 600	593	0,08	
<b>SLOWENIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 700	739	0,10	
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030	1.000	927	0,13	
Summe Slowenien		1.666	0,23	









BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
4,000 % fällig am 15.11.2052	\$ 200	\$ 205	0,03	5,450 % fällig am 24.07.2023				(0,173) % fällig am 19.09.2023 (b)(c)	1.300.000	8.997	1,23
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				Global Payments, Inc.	\$ 500	\$ 498	0,07	(0,172) % fällig am 19.09.2023 (b)(c)	430.000	2.976	0,41
0,125 % fällig am 15.04.2025	5.578	5.307	0,73	5,930 % fällig am 28.07.2023		5.221	0,72			138.808	19,01
0,125 % fällig am 15.07.2031	2.942	2.610	0,36					Summe kurzfristige Instrumente		146.397	20,05
0,125 % fällig am 15.01.2032	1.204	1.060	0,14	<b>HUNGARY TREASURY BILLS</b>				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 880.157	120,47	
0,250 % fällig am 15.01.2025	6.019	5.770	0,79	16,220 % fällig am 06.07.2023 (b)(c)	HUF 608.000	1.775	0,24				
0,500 % fällig am 15.01.2028	6.517	6.098	0,83					<b>AKTIEN</b>			
0,625 % fällig am 15.07.2032	418	384	0,05	<b>ISRAEL TREASURY BILLS</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
1,125 % fällig am 15.01.2033	5.397	5.174	0,71	1,716 % fällig am 05.07.2023 (b)(c)	ILS 2.200	593	0,08	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
1,750 % fällig am 15.01.2028	579	573	0,08					<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)</b>	4.454.619	44.360	6,07
2,375 % fällig am 15.01.2027	752	756	0,10	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>				<b>PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (e)</b>	402.852	5.249	0,72
2,500 % fällig am 15.01.2029	5.086	5.240	0,72	(0,202) % fällig am 18.07.2023 (b)(c)	¥5.730.000	39.646	5,43			49.609	6,79
3,875 % fällig am 15.04.2029	1.661	1.835	0,25	(0,202) % fällig am 28.08.2023 (b)(c)	377.000	2.609	0,36				
U.S. Treasury Notes				(0,200) % fällig am 24.07.2023 (b)(c)	3.250.000	22.488	3,08				
3,500 % fällig am 15.02.2033	600	585	0,08	(0,200) % fällig am 28.08.2023 (b)(c)	570.000	3.944	0,54				
		35.846	4,90	(0,197) % fällig am 31.07.2023 (b)(c)	397.000	2.747	0,37				
Summe USA		347.969	47,63	(0,189) % fällig am 28.08.2023 (b)(c)	343.000	2.374	0,32				
<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				(0,184) % fällig am 04.09.2023 (b)(c)	6.390.000	44.219	6,06	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
<b>COMMERCIAL PAPER</b>				(0,183) % fällig am 10.07.2023 (b)(c)	1.160.000	8.026	1,10	<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)</b>	4.450	471	0,06
AT+T, Inc.				(0,178) % fällig am 31.07.2023 (b)(c)	¥ 113.000	\$ 782	0,11	Summe Investmentfonds	\$ 50.080	6,85	
5,700 % fällig am 19.03.2024	2.750	2.632	0,36								
Electricité de France S.A.											
5,510 % fällig am 04.08.2023	1.300	1.293	0,18								
Enel Finance America LLC											
5,450 % fällig am 06.07.2023	400	400	0,06								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 1.874	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (1.911)	\$ 1.874	\$ 1.874	0,26
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.911)	\$ 1.874	\$ 1.874	0,26

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	171	\$ 446	0,06
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	73	26	0,00
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	73	(16)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	56	22	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	62	25	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	26	(6)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	378	728	0,10
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	96	98	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	192	204	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	29	40	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	15	33	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	266	293	0,04
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	98	22	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	32	130	0,02
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	47	138	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	410	851	0,12
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	22	(23)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	79	107	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	3	0	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	9	(18)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	117	150	0,02
				\$ 3.250	0,45

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	5	\$ (2)	\$ (2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	5	(2)	0	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	13	(11)	(1)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	13	(12)	(61)	(0,01)
				\$ (27)	\$ (64)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 3.186	0,44

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ (1)	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	€ 500	(28)	0,00
				\$ (29)	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 10-Year Index	(1,000) %	20.06.2033	\$ 89.000	\$ (977)	(0,13)
iTraxx Europe Main 39 10-Year Index	(1,000)	20.06.2033	€ 5.600	(78)	(0,01)
				\$ (1.055)	(0,14)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 2.800	\$ 23	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	69.000	525	0,07
				\$ 548	0,07

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		3,250 %	20.09.2053	£ 2.100	\$ (195)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		3,500	20.09.2033	52.900	(2.643)	(0,36)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		3,750	20.09.2028	13.600	(868)	(0,12)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		4,000	20.09.2025	2.800	(103)	(0,01)
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS		6,250	16.03.2032	INR 116.100	(102)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS		6,500	15.03.2028	182.510	18	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,000	15.12.2023	¥ 2.430.000	(24)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,000	15.12.2026	970.000	24	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,000	15.12.2028	10.000	(1)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,000	17.03.2031	610.000	(106)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,050	15.12.2031	851.000	(10)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,400	19.06.2039	540.000	335	0,05
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,400	15.12.2051	80.000	(74)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,450	15.12.2051	170.000	47	0,01
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,800	15.06.2052	640.000	42	0,01
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS		3,000	15.03.2028	SGD 5.920	(112)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		0,000	15.07.2023	\$ 24.600	333	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		0,000	25.08.2023	10.200	(142)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		0,000	31.08.2023	11.650	(162)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		0,000	15.09.2023	35.400	(494)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		0,400	15.01.2028	24.600	(2.812)	(0,39)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		0,750	16.06.2031	15.710	1.989	0,27
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,000	15.06.2027	16.900	1.291	0,18
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,000	15.06.2029	26.260	(1.886)	(0,26)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,249	31.08.2024	11.650	815	0,11
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,250	15.12.2026	28.000	2.983	0,41
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,250	15.12.2026	35.400	4.134	0,57
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,298	25.08.2024	10.200	729	0,10
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,500	15.12.2028	19.300	(2.561)	(0,35)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,518	20.01.2029	1.500	(185)	(0,03)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630 %	20.01.2029	\$ 4.400	\$ (520)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,695	15.11.2031	30	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	9.600	122	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	21.830	112	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	1.980	71	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	2.010	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,906	16.09.2052	2.300	(152)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.06.2024	15.900	(366)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	27.900	1.404	0,19
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,968	30.06.2024	15.900	(366)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	3.400	67	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	2.890	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,048	15.11.2032	10.200	479	0,07
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	500	(22)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,070	15.11.2032	4.000	179	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,083	15.11.2032	6.500	284	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,086	15.11.2032	4.700	156	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,089	15.11.2032	6.600	284	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	2.100	(84)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,106	15.11.2032	3.200	134	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,139	15.11.2032	4.500	176	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,150	13.05.2025	73.700	720	0,10
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,165	03.10.2053	1.000	3	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,173	15.11.2032	3.300	121	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,174	15.11.2032	3.500	127	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,200	13.05.2025	4.600	52	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,225	30.09.2029	2.800	(95)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,240	03.10.2053	1.000	17	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	4.800	77	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	3.500	7	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,445	03.10.2038	3.200	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	5.400	(96)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	1.100	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	1.800	(16)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	200	2	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	2.462	(19)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	700	(10)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,533	03.10.2038	3.200	(31)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	14.800	239	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	17.007	147	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,752	03.10.2028	4.100	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	1.200	(10)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,850	03.10.2028	4.100	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,898	30.06.2029	5.000	29	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,159	31.03.2025	35.100	568	0,08
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	58.651	311	0,04
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024	15.000	(189)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024	15.000	196	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024	7.400	(60)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024	7.400	33	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 6.900	(414)	(0,06)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	9.600	(508)	(0,07)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	9.200	(819)	(0,11)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	16.06.2051	250	(34)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029	2.100	(192)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	24.500	(2.226)	(0,31)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2028	9.640	346	0,05
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2033	4.900	178	0,02
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033	9.500	41	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	10.05.2025	101.700	(623)	(0,09)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF 900	(61)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	8.500	(550)	(0,08)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	1.900	(125)	(0,02)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	CNY 61.000	123	0,02
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.12.2027	90.900	216	0,03
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	21.06.2028	64.900	32	0,00
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,000	23.11.2024	€ 17.300	(320)	(0,04)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2028	KRW 40.562.187	(577)	(0,08)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033	3.184.165	7	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.09.2033	4.463.160	10	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD 650	(12)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	9.400	(124)	(0,02)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	32.500	(284)	(0,04)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month NZD-BBR	4,750	20.03.2025	22.600	(78)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month NZD-BBR	5,000	20.03.2025	24.900	(29)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK 56.200	(257)	(0,04)
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB 108.160	36	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.07.2023	\$ 24.600	(330)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	25.08.2023	10.200	141	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	31.08.2023	11.650	163	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.09.2023	35.400	502	0,07

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750 %	16.09.2023	\$ 15.710	\$ 196	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.09.2023	28.000	310	0,04
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023	19.300	(201)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023	1.500	(9)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.07.2023	4.400	(23)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023	15.000	32	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023	15.000	(32)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.07.2023	7.400	(2)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.09.2023	7.400	16	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 5.100	504	0,07
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	6.600	(397)	(0,05)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033	7.900	(219)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	1.900	(8)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	17.700	(448)	(0,06)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	39.100	81	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK 24.300	(164)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€ 450	116	0,02
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	1.000	356	0,05
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	900	(40)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	2.400	(255)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	1.800	(187)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	1.400	(147)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	2.200	(206)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	1.300	(122)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	6.500	(102)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	14.700	(230)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	4.000	(68)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	1.600	(22)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	2.200	(33)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	2.100	(31)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	8.950	(827)	(0,11)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042	1.260	(200)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	21.200	(153)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027	30.530	(203)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	121.700	(285)	(0,04)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033	13.460	(39)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	107.000	229	0,03
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	38.200	(260)	(0,04)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	20.03.2024	HUF 342.600	(113)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	4,870	07.07.2025	MXN 86.100	(247)	(0,03)
					\$ (4.866)	(0,67)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (5.402)</b>	<b>(0,74)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180 %	11.01.2024	3.600	\$ 103	\$ 369	0,05

##### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	1.600	\$ 121	\$ 668	0,09

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettövermö- gens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	1.900	\$ (6)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	1.900	(6)	(26)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310	11.01.2024	31.500	(102)	(762)	(0,11)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	600	(4)	(2)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	600	(4)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	400	(3)	(2)	0,00
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	400	(3)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	360	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	360	(1)	0	0,00
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	1.600	(121)	(613)	(0,09)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	600	(4)	0	0,00
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	1.100	(7)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	1.100	(7)	(24)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	2.800	(22)	(4)	0,00
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	2.800	(22)	(49)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	800	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	800	(5)	(17)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	800	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	800	(5)	(16)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	900	(6)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	900	(6)	(17)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	800	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	800	(6)	(15)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	900	(6)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	900	(6)	(17)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	1.100	(8)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	1.100	(8)	(23)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	800	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	800	(5)	(17)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	500	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	500	(4)	(10)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	1.700	(11)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	1.700	(11)	(35)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	3.000	(11)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	3.000	(11)	(39)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	1.500	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	1.500	(5)	(21)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	1.400	(4)	0	0,00
Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	1.400	(4)	(18)	0,00	
Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	3.400	(27)	(4)	0,00	
Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	3.400	(27)	(62)	(0,01)	
Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	900	(7)	(1)	0,00	
Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	900	(7)	(16)	0,00	
Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	8.700	(61)	(9)	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	400	(1)	0	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	400	(1)	0	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	1.200	(4)	(2)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	1.200	(4)	(5)	0,00	
Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	700	(5)	0	0,00	
Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	700	(5)	(15)	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	340	(1)	0	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	340	(1)	0	0,00	
							\$ (619)	\$ (1.843)	(0,25)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettövermö- gens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 1.500	\$ (37)	\$ 55	\$ 18	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.000	(24)	36	12	0,00
					\$ (61)	\$ 91	\$ 30	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 5.900	\$ 4.445	\$ 29	\$ (17)	\$ 12	0,00
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	7.100	4.899	(2)	11	9	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	7.000	4.830	(14)	12	(2)	0,00
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	2.000	1.437	9	(5)	4	0,00
						\$ 22	\$ 1	\$ 23	0,00

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 33.519	\$ (13)	\$ 63	\$ 50	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	8.180	(2)	20	18	0,00
BPS	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	7.817	(3)	15	12	0,00
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	8.126	0	10	10	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,635	05.04.2024	10.508	(3)	2	(1)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	3.483	7	1	8	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	17.760	(6)	32	26	0,01
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	4.750	(14)	10	(4)	0,00
						\$ (34)	\$ 153	\$ 119	0,02

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A. 1,084 %	\$ 5.400	20.09.2023	\$ 42	\$ (60)	\$ (18)	0,00
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A. 1,084	4.645	20.09.2023	36	(72)	(36)	(0,01)
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A. 1,084	14.200	20.03.2024	169	(279)	(110)	(0,01)
MYC	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A. 1,084	1.700	20.03.2024	21	(21)	0	0,00
						\$ 268	\$ (432)	\$ (164)	(0,02)

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu zahlende Betrag	Zu erhaltende Währung	Zu erhaltende Betrag	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	337	\$	220	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	07.2023	\$	1.015	AUD	1.530	3	0	3	0,00
	08.2023	AUD	1.530	\$	1.016	0	(3)	(3)	0,00
BOA	07.2023		2.708		1.768	0	(34)	(34)	0,00
	07.2023	CAD	8.047		5.914	0	(167)	(167)	(0,02)
	07.2023	DKK	29.635		4.279	0	(63)	(63)	(0,01)
	07.2023	NZD	1.606		974	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	\$	7.912	DKK	53.792	0	(30)	(30)	0,00
	07.2023		522	€	478	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		1.789	£	1.415	9	0	9	0,00
	07.2023		3.752	NOK	41.246	98	0	98	0,01
	07.2023		184	PEN	673	2	0	2	0,00
	08.2023	CNH	23.387	\$	3.342	117	0	117	0,02
	08.2023	DKK	53.703		7.912	30	0	30	0,00
	08.2023	¥	828.579		6.009	229	0	229	0,03
	09.2023	CLP	502.008		614	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	IDR	136.167		9	0	0	0	0,00
	09.2023	¥	8.120.000		59.097	2.353	0	2.353	0,32
	09.2023	KRW	5.070.228		4.002	138	0	138	0,02
	09.2023	TWD	83.288		2.744	64	0	64	0,01
	09.2023	\$	1.667	INR	137.917	9	0	9	0,00
	09.2023		455	PEN	1.669	3	0	3	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CAD	877	\$ 656	\$ 0	\$ (7)	0,00
	07.2023	DKK	105	15	0	0	0,00
	07.2023	€	1.215	1.331	5	0	0,00
	07.2023	ILS	1.057	332	47	0	0,01
	07.2023	¥	2.102.167	15.131	586	0	0,08
	07.2023	MYR	7.458	1.625	24	0	0,00
	07.2023	NOK	9.647	897	0	(3)	0,00
	07.2023	\$	724	AUD 1.094	4	0	0,00
	07.2023		130.741	€ 119.313	1	(571)	(0,08)
	08.2023	AUD	1.094	\$ 725	0	(4)	0,00
	08.2023	CNH	102.230	14.670	570	0	0,08
	08.2023	€	115.147	126.344	546	0	0,07
	08.2023	TWD	41.688	1.365	27	0	0,00
	08.2023	\$	897	NOK 9.637	3	0	0,00
	09.2023	THB	4	\$ 0	0	0	0,00
BRC	07.2023	£	523	649	0	(16)	0,00
	07.2023	¥	5.730.000	44.301	4.580	0	0,63
	07.2023	\$	792	€ 640	22	0	0,00
	09.2023	IDR	41.220	\$ 3	0	0	0,00
	09.2023	ILS	2.793	781	26	0	0,00
	09.2023	\$	145	PEN 532	1	0	0,00
	04.2024	¥	690.018	\$ 5.644	656	0	0,09
	05.2024		310.000	2.507	256	0	0,03
BSH	07.2023	\$	572	PEN 2.107	8	0	0,00
CBK	07.2023	AUD	1.169	\$ 763	0	(15)	0,00
	07.2023	ILS	6.406	1.894	167	0	0,02
	07.2023	NZD	1.289	791	1	0	0,00
	07.2023	\$	630	CLP 509.551	5	0	0,00
	07.2023		2.121	€ 1.969	28	(1)	0,00
	07.2023		1.112	£ 875	0	0	0,00
	07.2023		160	NOK 1.796	8	0	0,00
	07.2023		833	PEN 3.052	8	0	0,00
	08.2023	¥	461.421	\$ 3.348	129	0	0,02
	08.2023	TWD	43.402	1.422	28	0	0,00
	08.2023	\$	217	CNH 1.496	0	(11)	0,00
	09.2023	CNH	15.978	\$ 2.242	32	0	0,00
	09.2023	\$	39	KRW 49.702	0	(1)	0,00
	09.2023		2.363	THB 81.767	3	(42)	(0,01)
	10.2023		2	CLP 1.914	0	0	0,00
	11.2023	ILS	10.830	\$ 3.236	298	0	0,04
CLY	07.2023	DKK	87.094	12.571	0	(190)	(0,03)
	08.2023	CNH	4.097	578	13	0	0,00
DUB	07.2023	ILS	7.554	2.157	120	0	0,02
	07.2023	\$	3.613	BRL 19.578	445	0	0,06
	09.2023		167	PEN 612	1	0	0,00
GLM	07.2023	BRL	17.840	\$ 3.695	0	(3)	0,00
	07.2023	NOK	59.496	5.520	0	(33)	0,00
	07.2023	PEN	3.826	1.048	0	(7)	0,00
	08.2023	CNH	13.283	1.903	70	0	0,01
	08.2023	\$	5.520	NOK 59.438	34	0	0,00
	08.2023		472	PEN 1.722	1	0	0,00
	09.2023		3.695	BRL 18.038	3	0	0,00
	09.2023		576	PEN 2.119	5	0	0,00
	09.2023		3.364	SGD 4.498	0	(31)	0,00
	09.2023		1	THB 34	0	0	0,00
JPM	07.2023	AUD	2.602	\$ 1.701	0	(31)	0,00
	07.2023	KRW	11.031.641	8.641	262	0	0,04
	07.2023	SGD	1.107	838	20	0	0,00
	07.2023	\$	4.758	¥ 680.400	0	(50)	(0,01)
	08.2023	CNH	53.553	\$ 7.745	359	0	0,05
	08.2023	¥	677.508	4.758	50	0	0,01
	08.2023	\$	84	HUF 28.991	0	0	0,00
	09.2023	IDR	56.949	\$ 4	0	0	0,00
	09.2023	ILS	2.680	754	30	0	0,00
	09.2023	PEN	13.317	3.617	0	(35)	0,00
	09.2023	\$	1	IDR 12.251	0	0	0,00
	09.2023		198	INR 16.355	0	0	0,00
	09.2023		746	THB 25.578	0	(19)	0,00
	12.2023		3.625	INR 299.140	0	(1)	0,00
	10.2024	¥	330.000	\$ 2.646	199	0	0,03
MBC	07.2023	€	1.805	1.939	0	(30)	0,00
	07.2023	£	34.946	43.387	23	(1.065)	(0,14)
	07.2023	¥	3.250.000	24.885	2.336	0	0,32
	07.2023	SGD	63	47	0	0	0,00
	07.2023	\$	3.027	CAD 4.013	10	(5)	0,00
	07.2023		1.574	€ 1.467	26	0	0,00
	07.2023		2.461	£ 1.975	50	0	0,01
	07.2023		735	¥ 104.200	0	(14)	0,00
	08.2023		13.635	\$ 440	2	0	0,00
	09.2023	KRW	9.398.733	7.370	207	0	0,03
	03.2024	¥	620.016	5.070	610	0	0,08
	10.2024		730.000	5.853	439	0	0,06



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
MYI	07.2023	£	920	\$ 1.143	\$ 0	\$ (26)	0,00	
	07.2023	IDR	35.891	\$ 2	0	0	0,00	
	07.2023	NZD	107	\$ 65	0	(1)	0,00	
	07.2023	\$	1.415	AUD 2.114	0	(8)	0,00	
	07.2023		7.033	DKK 47.973	0	(4)	0,00	
	07.2023		2	IDR 35.891	0	0	0,00	
	08.2023	DKK	47.893	\$ 7.033	4	0	0,00	
	08.2023	TWD	56.185	1.851	46	0	46	0,01
	09.2023	IDR	35.922	2	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	10.562.658	8.254	204	0	204	0,03
	09.2023	\$	849	IDR 12.681.287	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023		43	INR 3.533	0	0	0	0,00
	09.2023		341	THB 11.659	0	(9)	(9)	0,00
	10.2024	¥	260.000	\$ 2.126	198	0	198	0,03
	RBC	07.2023	\$	783	CAD 1.050	10	0	10
07.2023			61	MXN 1.172	7	0	7	0,00
08.2023		MXN	2.340	\$ 135	0	0	0	0,00
RYL	04.2024	DKK	7.300	1.096	8	0	8	0,00
	07.2023	AUD	3.672	2.400	0	(45)	(45)	(0,01)
SCX	07.2023	MYR	7.459	1.623	22	0	22	0,00
	07.2023	NZD	4.183	2.540	0	(23)	(23)	0,00
	07.2023	\$	1.492	AUD 2.247	4	0	4	0,00
	08.2023	AUD	2.247	\$ 1.493	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	CNH	120.329	17.518	923	0	923	0,13
	08.2023	TWD	8.929	292	6	0	6	0,00
	09.2023	CNH	3.589	503	7	0	7	0,00
	09.2023	TWD	69.614	2.283	43	0	43	0,01
	09.2023	\$	1.845	IDR 27.573.000	0	(13)	(13)	0,00
	09.2023		124	INR 10.229	0	0	0	0,00
	09.2023		1.523	KRW 1.940.075	0	(44)	(44)	(0,01)
	09.2023		308	PEN 1.138	4	0	4	0,00
	09.2023		1.586	THB 54.723	0	(31)	(31)	0,00
	07.2023	AUD	2.223	\$ 1.455	0	(25)	(25)	0,00
	SOG	07.2023	€	120.207	129.311	0	(1.835)	(1.835)
07.2023		CLP	510.282	635	0	0	0	0,00
SSB	07.2023	¥	510.000	3.867	325	0	325	0,04
	08.2023	\$	635	CLP 511.755	0	0	0	0,00
TOR	09.2023	KRW	4.702.968	\$ 3.626	42	0	42	0,01
	07.2023	AUD	1.176	769	0	(14)	(14)	0,00
	07.2023	\$	1.826	AUD 2.765	14	0	14	0,00
	07.2023		2.918	CAD 3.862	2	(2)	0	0,00
	07.2023		40.007	£ 31.484	20	0	20	0,00
	07.2023		9.149	¥ 1.317.476	0	(34)	(34)	0,00
	07.2023		4.376	NZD 7.185	26	0	26	0,00
	08.2023	AUD	2.765	\$ 1.828	0	(14)	(14)	0,00
	08.2023	CAD	3.860	2.918	2	(2)	0	0,00
	08.2023	£	31.484	40.015	0	(20)	(20)	0,00
UAG	08.2023	¥	1.311.888	9.149	34	0	34	0,00
	08.2023	NZD	7.185	4.375	0	(26)	(26)	0,00
	07.2023	AUD	269	176	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	BRL	1.794	364	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	¥	1.160.000	8.849	817	0	817	0,11
	07.2023	\$	2.943	AUD 4.407	6	(15)	(9)	0,00
	07.2023		2.607	NOK 28.851	86	0	86	0,01
	08.2023	AUD	4.407	\$ 2.945	15	(6)	9	0,00
	09.2023	CNH	4.818	THB 23.334	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	ILS	2.319	\$ 648	21	0	21	0,00
09.2023	SGD	4.075	3.049	29	0	29	0,00	
09.2023	\$	1.578	INR 130.474	8	0	8	0,00	
				\$ 19.372	\$ (4.725)	\$ 14.647	2,01	

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2023	€	1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	
	07.2023	\$	7.823	€ 7.279	118	0	118	0,02
BPS	07.2023	€	7.560	\$ 8.284	36	0	36	0,00
	07.2023	\$	7.938	€ 7.382	116	0	116	0,02
CBK	08.2023		8.295	7.560	0	(36)	(36)	(0,01)
	07.2023	€	7.476	\$ 8.128	0	(28)	(28)	0,00
	07.2023	\$	589	€ 545	6	0	6	0,00
JPM	08.2023		8.140	7.476	28	0	28	0,00
	07.2023	€	7.559	\$ 8.254	7	0	7	0,00
MBC	08.2023	\$	8.265	€ 7.559	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	€	15	\$ 16	0	0	0	0,00
SOG	07.2023	\$	148	€ 139	3	0	3	0,00
	07.2023		7.817	7.266	111	0	111	0,02
				\$ 425	\$ (71)	\$ 354	0,05	

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse E Class USD (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
AZD	07.2023	AUD	\$	289	192	\$	0	(1)	0,00	
	07.2023	\$	AUD	105	161	\$	2	2	0,00	
BOA	08.2023			192	289		1	1	0,00	
	07.2023	CLP	\$	38.151	47		0	0	0,00	
	07.2023	DKK		706	104		0	0	0,00	
	07.2023	PEN		278	77		0	0	0,00	
	07.2023	SEK		4.274	396		0	0	0,00	
	07.2023	THB		12.906	363	(1)	(1)	(1)	0,00	
	07.2023	\$	AUD	419	643	9	9	9	0,00	
	07.2023		CAD	2.908	3.957	82	82	82	0,01	
	07.2023		CLP	47	38.151	1	1	1	0,00	
	07.2023		DKK	221	1.528	3	3	3	0,00	
	07.2023		€	4.250	3.955	64	64	64	0,01	
	07.2023		HUF	117	40.985	2	2	2	0,00	
	07.2023		¥	60	8.358	0	(2)	(2)	0,00	
	07.2023		KRW	4	5.019	0	0	0	0,00	
	07.2023		NOK	57	631	1	1	1	0,00	
	07.2023		NZD	51	84	1	0	1	0,00	
	07.2023		PEN	75	278	2	0	2	0,00	
	07.2023		SEK	3	29	0	0	0	0,00	
	08.2023	CNY	\$		725	100	0	0	0,00	
	08.2023	\$	CLP		47	38.151	0	0	0,00	
08.2023		DKK		104	705	0	0	0,00		
08.2023		PEN		76	278	0	0	0,00		
08.2023		SEK		396	4.269	0	0	0,00		
08.2023		THB		364	12.906	1	1	0,00		
BPS	07.2023	AUD	\$	96	63	(1)	(1)	(1)	0,00	
	07.2023	CHF		489	547	0	0	0	0,00	
	07.2023	CNY		66.515	9.207	42	42	42	0,01	
	07.2023	€		17.592	19.276	84	84	84	0,01	
	07.2023	NOK		154	14	0	0	0	0,00	
	07.2023	TWD		475	16	0	0	0	0,00	
	07.2023	\$	CHF		3	2	0	0	0,00	
	07.2023		CZK		161	3.542	2	2	0,00	
	07.2023		€		18.791	17.479	281	281	0,04	
	07.2023		¥		12.304	1.710.247	0	(472)	(472)	(0,07)
	07.2023		NZD		5	8	0	0	0	0,00
	08.2023		CHF		547	488	0	0	0	0,00
	08.2023		CNY		9.207	66.421	0	(24)	(24)	0,00
	08.2023		€		19.259	17.552	0	(84)	(84)	(0,01)
	08.2023		NOK		14	154	0	0	0	0,00
	BRC	07.2023	KRW	\$	1.517.793	1.150	(2)	(2)	(2)	0,00
		07.2023	\$	PLN	196	827	8	8	8	0,00
	CBK	08.2023		KRW	1.150	1.515.884	2	2	2	0,00
		07.2023	€	\$	3.842	4.174	(18)	(18)	(18)	0,00
	GLM	07.2023	ILS		403	111	2	2	2	0,00
07.2023		MXN		5.932	345	(1)	(1)	(1)	0,00	
07.2023		\$	AUD	182	278	4	4	4	0,00	
07.2023			CNY	185	1.316	(4)	(4)	(4)	0,00	
07.2023			MXN	330	5.932	16	16	16	0,00	
07.2023			NOK	5	56	0	0	0	0,00	
07.2023			TWD	15	476	0	0	0	0,00	
08.2023		TWD	\$	476	15	0	0	0	0,00	
08.2023		\$	€	3.915	3.596	14	14	14	0,00	
08.2023			ILS	111	402	(3)	(3)	(3)	0,00	
08.2023			MXN	343	5.932	1	1	1	0,00	
MBC		07.2023	NOK	\$	950	88	(1)	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$	MYR	412	1.847	(16)	(16)	(16)	0,00	
MYI	07.2023		THB	374	12.906	(10)	(10)	(10)	0,00	
	08.2023		NOK	88	950	1	1	1	0,00	
	07.2023	£	\$	121	151	(3)	(3)	(3)	0,00	
	07.2023	\$	CAD	2	2	0	0	0	0,00	
	07.2023		CNY	64	456	(1)	(1)	(1)	0,00	
	07.2023		£	4.201	3.394	115	115	115	0,01	
	07.2023		SEK	5	54	0	0	0	0,00	
	07.2023		SGD	246	332	0	0	0	0,00	
	07.2023	CZK	\$	3.547	163	1	1	1	0,00	
	07.2023	DKK		630	92	0	0	0	0,00	
07.2023	IDR		7.012.427	465	(2)	(2)	(2)	0,00		
07.2023	MYR		1.847	398	2	2	2	0,00		
07.2023	PLN		827	204	1	1	1	0,00		
07.2023	SGD		344	255	0	0	0	0,00		
07.2023	\$	CHF		4	4	0	0	0	0,00	
07.2023		DKK		1	5	0	0	0	0,00	
07.2023		ILS		108	402	0	0	0	0,00	
07.2023		SEK		390	4.186	(2)	(2)	(2)	0,00	
08.2023		CZK		163	3.551	(1)	(1)	(1)	0,00	
08.2023		DKK		92	629	0	0	0	0,00	
08.2023		IDR		465	7.015.079	1	1	1	0,00	
08.2023		MYR		399	1.847	(2)	(2)	(2)	0,00	
08.2023		PLN		204	829	(1)	(1)	(1)	0,00	
08.2023		SGD		255	344	0	0	0	0,00	

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
RBC	07.2023	CNY	280	\$ 39	\$ 1	\$ 1	0,00	
SCX	07.2023	AUD	425	282	0	(1)	0,00	
	07.2023	IDR	9.895	1	0	0	0,00	
	07.2023	\$	390	AUD 597	7	7	0,00	
	07.2023		530	CHF 476	2	2	0,00	
	07.2023		133	NZD 220	1	1	0,00	
	08.2023		282	AUD 425	1	0	0,00	
TOR	07.2023	AUD	522	\$ 345	0	(3)	0,00	
	07.2023	CAD	2.806	2.114	0	(6)	0,00	
	07.2023	£	3.272	4.158	0	(2)	0,00	
	07.2023	HUF	41.067	122	1	1	0,00	
	07.2023	NZD	312	190	0	(1)	0,00	
	07.2023	\$	368	AUD 563	7	7	0,00	
	08.2023		345	522	3	3	0,00	
	08.2023		2.114	CAD 2.805	6	6	0,00	
	08.2023		4.159	£ 3.272	2	2	0,00	
	08.2023		122	HUF 41.377	0	(1)	0,00	
	08.2023		190	NZD 312	1	1	0,00	
UAG	07.2023	AUD	1.039	\$ 693	3	1	0,00	
	07.2023	CHF	24	27	0	0	0,00	
	07.2023	\$	84	AUD 129	1	1	0,00	
	07.2023		35	CHF 31	0	0	0,00	
	07.2023		9.275	CNY 65.202	0	(292)	(0,04)	
	07.2023		0	CZK 5	0	0	0,00	
	07.2023		465	IDR 6.985.798	0	0	0,00	
	07.2023		1.145	KRW 1.510.095	1	1	0,00	
	07.2023		42	NOK 461	1	1	0,00	
	07.2023		22	SGD 29	0	0	0,00	
	08.2023		693	AUD 1.039	2	(3)	0,00	
	08.2023		27	CHF 24	0	0	0,00	
					\$ 786	\$ (963)	\$ (177)	(0,03)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 14.026	1,92	

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2038	\$ 13.300	\$ (11.787)	(1,61)
2,000 % fällig am 01.08.2053	75.650	(61.800)	(8,46)
2,500 % fällig am 01.07.2053	3.300	(2.799)	(0,38)
3,000 % fällig am 01.08.2053	2.700	(2.380)	(0,33)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (78.766)	(10,78)
Summe Anlagen		\$ 865.155	118,42
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (134.579)	(18,42)
Nettovermögen		\$ 730.576	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,76 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	3,290 %	17.03.2026	10.03.2022	\$ 2.200	\$ 2.105	0,29
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	22.01.2021	301	227	0,03
				\$ 2.501	\$ 2.332	0,32

Barmittel in Höhe von 25.310 USD (31. Dezember 2022: 25.647 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.610 USD (31. Dezember 2022: 12.800 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 880.107	\$ 50	\$ 880.157
Investmentfonds	50.080	0	0	50.080
Pensionsgeschäfte	0	1.874	0	1.874
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.739	10.071	0	11.810
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(78.766)	0	(78.766)
<b>Summen</b>	<b>\$ 51.819</b>	<b>\$ 813.286</b>	<b>\$ 50</b>	<b>\$ 865.155</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 737.412	\$ 0	\$ 737.412
Investmentfonds	46.863	459	0	47.322
Pensionsgeschäfte	0	1.625	0	1.625
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.705	(29.777)	0	(28.072)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(76.200)	0	(76.200)
<b>Summen</b>	<b>\$ 48.568</b>	<b>\$ 633.519</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 682.087</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 10	\$ 20	\$ 30	\$ 27	\$ 0	\$ 27
BOA	2.647	(2.280)	367	(4.371)	3.760	(611)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	(9)	0	(9)
BPS	1.093	(1.080)	13	633	(530)	103
BRC	5.551	(5.420)	131	488	(400)	88
BSH	8	0	8	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	675	(550)	125	979	(680)	299
CLY	(177)	0	(177)	(11)	0	(11)
DUB	489	(440)	49	(252)	280	28
GLM	(300)	290	(10)	(593)	420	(173)
GST	26	0	26	(35)	0	(35)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
IND	k. A.	k. A.	k. A.	193	(330)	(137)
JPM	768	(720)	48	165	0	165
MBC	2.703	(2.850)	(147)	(4.349)	3.720	(629)
MYC	(11)	10	(1)	15	10	25
MYI	394	(270)	124	(894)	490	(404)
RBC	18	0	18	(1)	0	(1)
RYL	8	(10)	(2)	(3)	0	(3)
SCX	855	(840)	15	(688)	600	(88)
SOG	(1.749)	1.290	(459)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	367	(290)	77	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(7)	0	(7)	(3.747)	3.130	(617)
UAG	658	(670)	(12)	(553)	390	(163)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	73,15	51,35
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,31	51,26
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	0,37
Investmentfonds	6,85	6,61
Pensionsgeschäfte	0,26	0,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,44	0,23
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,74)	(2,33)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,92	(1,82)
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,78)	(10,64)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,78	1,91
Belgien	0,11	k. A.
Brasilien	k. A.	0,21
Kanada	1,25	1,68
Cayman Inseln	3,01	2,86
China	4,20	2,16
Dänemark	2,44	2,57
Frankreich	2,82	3,25
Deutschland	2,15	2,47
Hongkong	k. A.	0,08
Ungarn	0,17	0,03
Irland	6,31	6,51
Israel	1,21	1,22
Italien	1,20	1,29
Japan	7,06	4,87
Luxemburg	0,73	0,71
Malaysia	0,62	0,92
Mexiko	0,04	0,04
Multinational	0,11	0,11
Niederlande	0,51	0,77
Neuseeland	0,09	0,09
Norwegen	0,21	0,22
Peru	0,09	1,21
Polen	0,31	0,03
Portugal	0,16	0,14
Katar	0,05	0,05
Rumänien	0,85	0,55
Saudi-Arabien	0,61	k. A.
Serbien	0,15	0,26
Singapur	0,08	k. A.
Slowenien	0,23	0,22
Südkorea	3,93	2,27
Spanien	1,11	1,50
Supranational	0,50	0,51
Schweden	0,09	0,09
Schweiz	1,23	0,95
Thailand	k. A.	0,51
Vereinigte Arabische Emirate	0,07	0,07
Großbritannien	7,31	9,28
Vereinigte Staaten	47,63	30,13
Kurzfristige Instrumente	20,05	21,24
Investmentfonds	6,85	6,61
Pensionsgeschäfte	0,26	0,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,45	0,24
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,14)	(0,13)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,07	k. A.
Zinsswaps – Basiswaps	k. A.	0,01
Zinsswaps	(0,67)	(2,19)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,05	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,09	0,09
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,25)	(0,28)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	0,02	(0,02)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,02)	0,07
Devisenterminkontrakte	2,01	(2,07)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,02	0,35
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,78)	(10,64)
Sonstige Aktiva und Passiva	(18,42)	4,74
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>US-SCHATZ OblIGATIONEN</b>				<b>Atlas Senior Loan Fund Ltd.</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>U.S. Treasury Bonds</b>				6,160 % fällig am 17.11.2027				
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				1,375 % fällig am 15.11.2040				Cairn CLO DAC				
Avolon Holdings Funding Ltd.	\$	216	0,03	4,000 % fällig am 15.11.2042	3,040	3,022	0,45	3,971 % fällig am 25.04.2032	€	200	214	0,03
Bank of America Corp.				4,000 % fällig am 15.11.2052	2,290	2,353	0,35	4,212 % fällig am 20.10.2028		16	17	0,00
5,875 % fällig am 15.03.2028				<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)</b>				Catamaran CLO Ltd.				
(f)	602	551	0,08	1,125 % fällig am 15.01.2033	40,425	38,756	5,80	6,373 % fällig am 22.04.2030	\$	1,147	1,140	0,17
DAE Sukuk Dfvc Ltd.								Centex Home Equity Loan Trust				
3,750 % fällig am 15.02.2026	700	666	0,10					6,200 % fällig am 25.10.2035				
Ford Motor Credit Co. LLC								CIT Mortgage Loan Trust				
3,810 % fällig am 09.01.2024	200	197	0,03					6,500 % fällig am 25.10.2037				
5,584 % fällig am 18.03.2024	600	596	0,09					Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
Kaisa Group Holdings Ltd.								5,585 % fällig am 25.11.2036				
9,375 % fällig am 30.06.2024	650	43	0,01					6,050 % fällig am 25.01.2036				
9,750 % fällig am 28.09.2023	1,100	74	0,01					Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
11,700 % fällig am 11.11.2025	250	17	0,00					3,820 % fällig am 25.12.2034				
Sunac China Holdings Ltd.								5,380 % fällig am 25.05.2037				
8,350 % fällig am 19.04.2023	800	118	0,02					5,410 % fällig am 25.12.2036				
UniCredit SpA								7,100 % fällig am 25.08.2035				
7,830 % fällig am 04.12.2023	7,350	7,394	1,11					Ellington Loan Acquisition Trust				
Ursa Re Ltd.								6,250 % fällig am 25.05.2037				
9,208 % fällig am 07.12.2027	1,150	1,146	0,17					First Franklin Mortgage Loan Trust				
VICI Properties LP								5,270 % fällig am 25.11.2036				
3,875 % fällig am 15.02.2029	800	703	0,10					5,855 % fällig am 25.11.2036				
Yango Justice International Ltd.								6,050 % fällig am 25.07.2035				
7,500 % fällig am 15.04.2024	1,300	27	0,00					6,095 % fällig am 25.06.2034				
		11,714	1,75					Fremont Home Loan Trust				
								5,300 % fällig am 25.10.2036				
								GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
								4,100 % fällig am 20.01.2032				
								€				
								300				
								319				
								0,05				
								GSAMP Trust				
								5,825 % fällig am 25.11.2035				
								\$				
								416				
								394				
								0,06				
								Harvest CLO DAC				
								4,027 % fällig am 15.01.2032				
								€				
								800				
								854				
								0,13				
								Home Equity Asset Trust				
								3,883 % fällig am 25.02.2036				
								\$				
								2,915				
								2,801				
								0,42				
								Invesco Euro CLO DAC				
								3,827 % fällig am 15.07.2031				
								€				
								500				
								532				
								0,08				
								JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
								3,982 % fällig am 25.03.2047				
								\$				
								1,206				
								749				
								0,11				
								3,360 % fällig am 25.10.2036				
								47				
								46				
								0,01				
								5,450 % fällig am 25.03.2037				
								1,000				
								898				
								0,13				
								Jubilee CLO DAC				
								4,326 % fällig am 15.12.2029				
								€				
								127				
								136				
								0,02				
								Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust				
								7,170 % fällig am 15.04.2040				
								\$				
								794				
								571				
								0,09				
								Long Beach Mortgage Loan Trust				
								5,750 % fällig am 25.01.2036				
								2,257				
								2,029				
								0,30				
								6,425 % fällig am 25.02.2035				
								510				
								492				
								0,07				
								Man GLG Euro CLO DAC				
								4,047 % fällig am 15.01.2030				
								€				
								176				
								190				
								0,03				
								MASTR Asset-Backed Securities Trust				
								5,360 % fällig am 25.05.2037				
								\$				
								724				
								682				
								0,10				
								Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
								6,080 % fällig am 25.07.2035				
								647				
								625				
								0,09				
								Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
								5,260 % fällig am 25.03.2037				
								1,354				
								597				
								0,09				
								5,280 % fällig am 25.10.2036				
								83				
								74				
								0,01				
								5,290 % fällig am 25.10.2036				
								1,071				
								466				
								0,07				
								5,450 % fällig am 25.06.2036				
								253				
								214				
								0,03				
								6,400 % fällig am 25.07.2037				
								800				
								671				
								0,10				
								Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.				
								6,290 % fällig am 20.04.2031				
								250				
								247				
								0,04				
								OCP Euro CLO DAC				
								3,997 % fällig am 15.01.2032				
								€				
								1,086				
								1,169				
								0,18				
								4,091 % fällig am 22.09.2034				
								1,100				
								1,169				
								0,18				
								Option One Mortgage Loan Trust				
								5,885 % fällig am 25.05.2035				
								\$				
								500				
								466				
								0,07				
								6,020 % fällig am 25.05.2035				
								1,151				
								938				
								0,14				
								OZLM Ltd.				
								6,400 % fällig am 20.01.2031				
								286				
								283				
								0,04				
								Palmer Square European Loan Funding DAC				
								3,897 % fällig am 15.10.2031				
								€				
								2,064				
								2,207				
								0,33				
								3,957 % fällig am 15.04.2031				
								650				
								697				
								0,10				
								Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				
								5,645 % fällig am 25.07.2036				
								\$				
								268				
								251				
								0,04				

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Residential Asset Mortgage Products Trust 5,500 % fällig am 25.10.2036 \$	534	\$ 500	0,08
Residential Asset Securities Corp. Trust 5,400 % fällig am 25.11.2036 ^	2.983	2.582	0,39
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 5,500 % fällig am 25.05.2037	127	93	0,01
5,930 % fällig am 25.02.2034	282	274	0,04
Segovia European CLO DAC 4,080 % fällig am 20.07.2032 €	700	744	0,11
Sound Point CLO Ltd. 6,412 % fällig am 18.04.2031 \$	800	786	0,12
Structured Asset Investment Loan Trust 5,770 % fällig am 25.01.2036	436	402	0,06
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,720 % fällig am 25.10.2036	188	182	0,03
5,945 % fällig am 25.02.2036	200	189	0,03
6,155 % fällig am 25.11.2035	1.000	983	0,15
Toro European CLO DAC 3,995 % fällig am 12.01.2032 €	300	321	0,05
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust 5,460 % fällig am 25.08.2036 \$	500	468	0,07
		<u>55.987</u>	<u>8,37</u>
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Argentina Government International Bond 0,500 % fällig am 09.07.2030	994	273	0,04
1,500 % fällig am 09.07.2035	653	188	0,03
China Government International Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027 CNY	139.660	19.987	2,99
Colombian TES 7,750 % fällig am 18.09.2030 COP	25.722.500	5.490	0,82
Japan Government International Bond 1,700 % fällig am 20.09.2044 ¥	600.000	4.668	0,70
Peru Government International Bond 1,862 % fällig am 01.12.2032 \$	1.800	1.390	0,21
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026 ZAR	71.750	3.944	0,59
Spain Government International Bond 0,700 % fällig am 30.04.2032 €	5.000	4.382	0,65
United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.10.2050 £	3.000	1.551	0,23
		<u>41.873</u>	<u>6,26</u>

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>STAMMAKTIE FINANZWERTE</b>			
Bank of America Corp.	95.800	\$ 2.749	0,41
Citigroup, Inc.	61.100	2.813	0,42
JPMorgan Chase & Co.	21.000	3.054	0,46
Wells Fargo & Co.	71.700	3.060	0,46
		<u>11.676</u>	<u>1,75</u>
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>			
Nationwide Building Society 10,250 %	1.490	218	0,03
<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>			
Agree Realty Corp.	41.327	2.702	0,40
American Tower Corp.	9.856	1.912	0,29
Apartment Income REIT Corp.	62.213	2.245	0,34
Equinix, Inc.	2.871	2.251	0,34
Equity LifeStyle Properties, Inc.	30.425	2.035	0,30
Equity Residential	39.817	2.627	0,39
First Industrial Realty Trust, Inc.	62.470	3.288	0,49
Gaming and Leisure Properties, Inc.	48.445	2.348	0,35
Host Hotels & Resorts, Inc.	135.801	2.286	0,34
Invitation Homes, Inc.	104.896	3.608	0,54
Life Storage, Inc.	10.431	1.387	0,21
National Storage Affiliates Trust	25.381	884	0,13
Prologis, Inc.	42.264	5.183	0,78
Public Storage	4.700	1.372	0,21
RLJ Lodging Trust	138.744	1.425	0,21
SBA Communications Corp.	9.092	2.107	0,32
Simon Property Group, Inc.	22.810	2.634	0,39
Sun Communities, Inc.	13.938	1.818	0,27
Sunstone Hotel Investors, Inc.	56.900	576	0,09
VICI Properties, Inc.	77.162	2.425	0,36
		<u>45.113</u>	<u>6,75</u>

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
(28,578) % fällig am 18.10.2023 (c)(d)	ARS	38.226	\$ 75 0,01
(12,549) % fällig am 23.11.2023 (c)(d)		75.134	152 0,02
		<u>227</u>	<u>0,03</u>
<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
(0,202) % fällig am 18.07.2023 (c)(d)	¥	8.387.000	58.031 8,68
(0,199) % fällig am 11.09.2023 (c)(d)		2.060.000	14.256 2,13
(0,184) % fällig am 04.09.2023 (c)(d)		9.458.000	65.452 9,79
(0,179) % fällig am 11.09.2023 (c)(d)		460.000	3.183 0,48
		<u>140.922</u>	<u>21,08</u>
Summe kurzfristige Instrumente		<u>141.149</u>	<u>21,11</u>
Summe Übertragbare Wertpapiere		<u>\$ 524.174</u>	<u>78,41</u>
<b>AKTIEN</b>			
<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
<b>PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (g)</b>			
		725.222	7.586 1,13
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)</b>			
		13.273.152	132.173 19,77
		<u>139.759</u>	<u>20,90</u>
<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)</b>			
		978.412	97.186 14,54
Summe Investmentfonds		<u>\$ 236.945</u>	<u>35,44</u>

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 18.513	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (18.883)	\$ 18.513	\$ 18.514	2,77
Summe Pensionsgeschäfte						<u>\$ (18.883)</u>	<u>\$ 18.513</u>	<u>\$ 18.514</u>	<u>2,77</u>

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Long	09.2023	74	\$ (30)	(0,01)
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	15	(6)	0,00
CAC 40 Index July Futures	Long	07.2023	29	36	0,01
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	41	(55)	(0,01)
DAX Index September Futures	Long	09.2023	3	3	0,00
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2023	1.151	6.994	1,04
Euro STOXX 50 September Futures	Short	09.2023	91	(84)	(0,01)
Euro STOXX 600 September Futures	Long	09.2023	2.665	169	0,02
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	36	(62)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	46	47	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	147	209	0,03
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	2	4	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	33	25	0,00



Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
FTSE 100 Index September Futures	Short	09.2023	6	\$ (3)	0,00
FTSE/MIB Index September Futures	Long	09.2023	10	48	0,01
IBEX 35 Index July Futures	Long	07.2023	1	3	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	23	95	0,01
Mini MSCI Emerging Markets Index September Futures	Long	09.2023	6	(3)	0,00
Nikkei 225 Yen-Denominated September Futures	Long	09.2023	60	290	0,04
OMXS30 Index July Futures	Long	07.2023	6	(1)	0,00
S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures	Long	09.2023	67	198	0,03
SPI 200 Index September Futures	Long	09.2023	67	61	0,01
Topix Index September Futures	Long	09.2023	117	639	0,09
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	29	(85)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	347	(691)	(0,10)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	164	308	0,05
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	408	468	0,07
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	128	35	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	42	(83)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2023	10	(11)	0,00
				\$ 8.518	1,27

## VERKAUFSoPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	\$ 123,000	21.07.2023	29	\$ (11)	\$ (4)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	29	(15)	(6)	0,00
				\$ (26)	\$ (10)	0,00

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ 8.508 1,27

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 100	\$ (1)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	100	1	0,00
				\$ 0	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2028	\$ 12.600	\$ (82)	(0,01)
iTraxx Crossover 37 5-Year Index	(5,000)	20.06.2027	€ 100	0	0,00
				\$ (82)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000 %	20.06.2028	\$ 600	\$ 20	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	5.500	104	0,02
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	€ 200	2	0,00
				\$ 126	0,02

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 1.500	\$ 134	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	4.300	(311)	(0,05)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	1.900	(121)	(0,02)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,260	15.09.2026	INR 38.400	1	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	21.09.2027	157.780	(11)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2026	¥ 1.090.000	15	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	690.000	(55)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	300.000	(154)	(0,02)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	15.03.2053	520.000	253	0,04

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	1,250 %	15.12.2026	SGD	7.140	\$ (74)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,250	16.03.2024	\$	14.500	(16)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029		800	14	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032		14.300	438	0,07
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052		4.000	(127)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052		3.100	218	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,385	08.06.2032		6.100	501	0,07
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053		7.400	(15)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033		700	23	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034		23.920	(8)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028		12.900	326	0,05
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,308	21.02.2029		21.700	(195)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	02.04.2026		50.600	(30)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030		15.300	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030		1.600	(22)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025		48.700	673	0,10
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028		4.504	(37)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,575	04.01.2027	BRL	39.700	380	0,06
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,250	21.09.2052	CAD	2.600	(195)	(0,03)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	21.12.2027	CNY	16.100	19	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	15.12.2026		77.410	120	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,920	26.08.2026	COP	21.200.000	483	0,07
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,925	26.08.2026		20.900.000	(336)	(0,05)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,215	09.02.2027		7.022.570	(91)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,620	18.09.2030		29.000.000	(75)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,585	26.11.2025		21.088.900	34	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,590	26.11.2025		22.207.400	35	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,930	18.09.2030		2.700.000	(52)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,280	26.11.2025		24.084.000	(50)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,270	17.11.2027		16.699.000	356	0,05
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,580	10.01.2028		14.369.470	(231)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,840	02.12.2025		74.238.900	784	0,12
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,960	21.11.2025		11.115.900	(120)	(0,02)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,215	11.02.2027	ILS	24.750	(32)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,268	17.03.2031	KRW	2.741.200	(41)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,336	17.03.2031		1.600.000	(24)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,500	16.03.2027		6.799.000	(65)	(0,01)
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB	37.400	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,980	21.12.2026	ZAR	151.000	155	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,690	04.11.2026		133.520	(62)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,850	14.01.2027	CLP	4.026.240	(58)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,045	11.02.2027		454.450	2	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,225	29.07.2027	CZK	86.860	(92)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,081	15.02.2031	€	24.400	(3.141)	(0,48)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053		4.700	107	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028		7.100	17	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033		14.200	122	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025		17.400	8	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	3,700	08.11.2026	HUF	1.841.500	(233)	(0,04)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	11,070	02.09.2027		450.700	179	0,03
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	2,983	08.11.2026	PLN	9.840	37	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,745	11.02.2027	MXN	37.430	21	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,480	24.01.2028		188.200	59	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,700	05.11.2027		63.500	30	0,00
						\$ (546)	(0,09)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ (502)</b>	<b>(0,08)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## VERKAUFSOPTIONEN

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	8.200	\$ (374)	\$ (461)	(0,07)
JPM	Cap - OTC CPURNSA	234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	1.500	(10)	0	0,00
						\$ (384)	\$ (461)	(0,07)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060 %	14.07.2023	1.942	\$ (14)	\$ (9)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	1.942	(14)	(4)	0,00
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	1.963	(13)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	1.963	(13)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	1.681	(6)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	1.681	(5)	(8)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.546	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.546	(6)	(9)	0,00
FAR	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	2.524	(17)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	2.524	(17)	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	4.759	(16)	(10)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	4.759	(16)	(23)	(0,01)
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.546	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.546	(6)	(9)	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	5.493	(19)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	5.493	(19)	(23)	(0,01)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	3.880	(13)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	3.880	(13)	(16)	0,00
							\$ (219)	\$ (138)	(0,02)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 2.900	\$ (86)	\$ 74	\$ (12)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	12.200	(403)	353	(50)	(0,02)
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.200	(5)	(19)	(24)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	5.100	(148)	127	(21)	0,00
					\$ (642)	\$ 535	\$ (107)	(0,02)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,750 %	15.12.2026	MYR 2.450	\$ (6)	\$ (9)	\$ (15)	0,00
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	16.03.2027	40.990	(184)	(15)	(199)	(0,03)
CBK	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,430	01.07.2029	KRW 100	0	0	0	0,00
						\$ (190)	\$ (24)	\$ (214)	(0,03)

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	DWRTFT Index	1.880	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 20.857	23.08.2023	\$ 0	\$ (970)	\$ (970)	(0,14)
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,084 %	100	20.12.2023	(1)	2	1	0,00
	Zahlung	IXITR Index	2.419	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	9.187	21.02.2024	0	(209)	(209)	(0,03)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/Erhalt Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Zahlung NDUEACWF Index	40.416	1-Month USD-LIBOR less a specified spread	\$ 13.822	06.09.2023	\$ 0	\$ (747)	\$ (747)	(0,11)
	Zahlung DWRTFT Index	453	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.018	21.02.2024	0	(242)	(242)	(0,04)
MBC	Receive NDUEEGF Index	24.335	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	11.953	06.12.2023	0	403	403	0,06
	Receive NDUEEGF Index	24.335	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	11.953	17.01.2024	0	404	404	0,06
	Receive NDUEEGF Index	24.335	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	11.953	06.03.2024	0	405	405	0,06
MYI	Receive NDUEEGF Index	24.335	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	12.419	08.05.2024	0	(53)	(53)	(0,01)
SOG	Zahlung DWRTFT Index	1.252	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	13.886	03.04.2024	0	(650)	(650)	(0,10)
						\$ (1)	\$ (1.657)	\$ (1.658)	(0,25)

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	\$ 1.401	930	\$ 0	\$ (3)	0,00
	07.2023	\$	AUD 226	345	4	0	0,00
	08.2023		931	1.401	3	0	0,00
BOA	07.2023	DKK	\$ 342	50	0	0	0,00
	07.2023	NZD	1.616	980	0	(10)	0,00
	07.2023	SEK	2.505	231	0	0	0,00
	07.2023	\$	1.433	2.195	28	0	0,00
	07.2023		10.903	CAD 14.836	308	0	0,05
	07.2023		86	DKK 597	1	0	0,00
	07.2023		5.431	ILS 18.604	0	(419)	(0,06)
	07.2023		4.914	MXN 90.475	348	0	0,05
	07.2023		1.124	NOK 12.358	29	0	0,00
	07.2023		98	SEK 1.060	0	0	0,00
	08.2023	CNY	\$ 333	49	2	0	0,00
	08.2023	SEK	1.059	98	0	0	0,00
	08.2023	\$	245	CNY 1.753	0	(2)	0,00
	08.2023		50	DKK 341	0	0	0,00
	08.2023		3.014	ILS 10.304	0	(235)	(0,03)
	09.2023	IDR	291.840	\$ 19	0	0	0,00
	09.2023	TWD	50.832	1.674	39	0	0,01
	09.2023	\$	194	CLP 157.827	1	0	0,00
	09.2023		1.009	HKD 7.888	0	(1)	0,00
	09.2023		297	KRW 381.649	0	(6)	0,00
BPS	07.2023	AUD	1.002	\$ 663	0	(3)	0,00
	07.2023	CHF	667	746	0	0	0,00
	07.2023	CZK	241	11	0	0	0,00
	07.2023	DKK	1.610	232	0	(4)	0,00
	07.2023	€	48.875	53.552	230	0	0,03
	07.2023	ILS	11.722	3.679	520	0	0,08
	07.2023	NOK	2.883	268	0	(1)	0,00
	07.2023	\$	24.932	¥ 3.465.815	0	(954)	(0,14)
	08.2023	CNH	80.072	\$ 11.588	545	0	0,08
	08.2023	CNY	392	57	3	0	0,00
	08.2023	TWD	25.443	833	16	0	0,00
	08.2023	\$	664	AUD 1.002	3	0	0,00
	08.2023		746	CHF 665	0	0	0,00
	08.2023		53.627	€ 48.875	0	(232)	(0,03)
	08.2023		268	NOK 2.880	1	0	0,00
	08.2023	ZAR	39.221	\$ 2.108	40	0	0,01
	09.2023	THB	14	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	£	148	188	0	0	0,00
	07.2023	¥	8.387.000	64.844	6.704	0	1,01
	07.2023	\$	13	MYR 60	0	0	0,00
	08.2023	CNY	6.672	\$ 953	30	0	0,00
	08.2023	COP	48.730.586	11.438	0	(88)	(0,01)
	08.2023	ZAR	47.456	2.568	66	0	0,01
	09.2023	¥	9.458.000	68.464	2.400	0	0,36
	09.2023	\$	170	ILS 608	0	(6)	0,00
	10.2023	MXN	55.614	\$ 2.968	0	(212)	(0,03)
CBK	07.2023	€	2.748	3.006	8	0	0,00
	07.2023	ILS	6.893	2.151	294	0	0,04
	07.2023	\$	3.595	CLP 2.909.470	28	0	0,00
	07.2023		44	NOK 485	2	0	0,00
	08.2023	CLP	3.210.667	\$ 3.912	0	(65)	(0,01)
	08.2023	CNH	220	32	1	0	0,00
	08.2023	ILS	10.315	3.192	410	0	0,06
	08.2023	TWD	34.655	1.136	23	0	0,00
	08.2023	\$	4.364	CNY 30.650	0	(124)	(0,02)
	09.2023	KRW	1.181	\$ 1	0	0	0,00
	09.2023	MXN	8.169	441	0	(27)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CLY	07.2023	\$ 253	DKK 1.755	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
DUB	07.2023	5.418	BRL 29.357	667	0	667	0,10
	08.2023	106	ZAR 2.038	2	0	2	0,00
FAR	07.2023	5	CLP 3.986	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	BRL 29.447	\$ 6.094	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	NOK 17.783	1.650	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	\$ 319	CNY 2.198	0	(15)	(15)	0,00
	08.2023	1.650	NOK 17.765	10	0	10	0,00
	09.2023	SGD 2.357	\$ 1.764	17	0	17	0,00
	09.2023	\$ 5.898	BRL 28.794	5	0	5	0,00
	09.2023	348	COP 1.472.799	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	920	TWD 27.985	0	(19)	(19)	0,00
JPM	07.2023	¥ 1.180.269	\$ 8.253	87	0	87	0,01
	07.2023	\$ 1.378	AUD 2.108	25	0	25	0,00
	07.2023	1.130	SGD 1.493	0	(26)	(26)	0,00
	08.2023	CNH 64.275	\$ 9.301	437	0	437	0,07
	08.2023	CNY 414	60	3	0	3	0,00
	08.2023	\$ 1.363	HUF 475.800	12	0	12	0,00
	08.2023	8.253	¥ 1.175.254	0	(87)	(87)	(0,01)
	08.2023	247	TWD 7.550	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	ZAR 3.516	\$ 181	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	IDR 122.083	8	0	0	0	0,00
	09.2023	INR 44.392	539	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	PEN 1.675	455	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	\$ 5	IDR 78.757	0	0	0	0,00
	09.2023	164	ILS 583	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023	2.336	THB 80.101	0	(60)	(60)	(0,01)
	10.2023	MXN 26.988	\$ 1.537	0	(6)	(6)	0,00
MBC	07.2023	CHF 592	657	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	£ 3.233	4.002	0	(108)	(108)	(0,02)
	09.2023	¥ 2.520.000	18.357	738	0	738	0,11
	09.2023	\$ 227	INR 18.794	1	0	1	0,00
	09.2023	175	KRW 223.406	0	(5)	(5)	0,00
MYI	07.2023	AUD 521	\$ 349	2	0	2	0,00
	07.2023	£ 96	119	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	IDR 76.925	5	0	0	0	0,00
	07.2023	NZD 107	65	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 3.999	COP 16.859.264	13	0	13	0,00
	07.2023	118	€ 108	0	0	0	0,00
	07.2023	39	£ 31	0	0	0	0,00
	07.2023	5	IDR 76.925	0	0	0	0,00
	07.2023	135	SEK 1.446	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	TWD 27.379	\$ 903	24	0	24	0,00
	08.2023	\$ 2	TWD 72	0	0	0	0,00
	08.2023	560	ZAR 10.502	4	(11)	(7)	0,00
	09.2023	IDR 76.992	\$ 5	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS 193	54	2	0	2	0,00
	09.2023	INR 9.588	116	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 196	KRW 251.072	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023	1.066	THB 36.512	0	(29)	(29)	0,00
RBC	07.2023	CAD 857	\$ 649	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 3.063	MXN 58.943	367	0	367	0,06
	08.2023	MXN 63.121	\$ 3.642	0	(8)	(8)	0,00
	09.2023	ZAR 30.034	1.668	91	0	91	0,01
RYL	07.2023	\$ 2.206	NZD 3.553	0	(29)	(29)	0,00
SCX	07.2023	AUD 2.058	\$ 1.366	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	NZD 4.208	2.555	0	(23)	(23)	0,00
	07.2023	\$ 2.055	AUD 3.145	38	0	38	0,01
	07.2023	1.350	CHF 1.213	6	0	6	0,00
	08.2023	CNH 30.465	\$ 4.428	226	0	226	0,03
	08.2023	CNY 1.098	161	9	0	9	0,00
	08.2023	\$ 1.367	AUD 2.058	4	0	4	0,00
	09.2023	INR 27.764	\$ 337	0	0	0	0,00
	09.2023	TWD 42.475	1.393	27	0	27	0,00
	09.2023	\$ 5.245	IDR 77.991.713	0	(65)	(65)	(0,01)
	09.2023	2.400	THB 82.892	0	(45)	(45)	(0,01)
	09.2023	1.149	ZAR 19.983	0	(99)	(99)	(0,01)
SOG	07.2023	1.490	AUD 2.277	26	0	26	0,00
	07.2023	55.533	€ 51.623	788	0	788	0,12
SSB	07.2023	CLP 2.605.728	\$ 3.244	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 3.244	CLP 2.613.253	0	0	0	0,00
	09.2023	BRL 6.702	\$ 1.322	0	(52)	(52)	(0,01)
TOR	07.2023	AUD 2.533	1.673	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	CAD 9.906	7.464	0	(22)	(22)	0,00
	07.2023	\$ 788	AUD 1.205	14	0	14	0,00
	07.2023	4.418	£ 3.477	2	0	2	0,00
	07.2023	1.448	NZD 2.378	9	0	9	0,00
	08.2023	£ 3.477	\$ 4.419	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	NZD 2.378	1.448	0	(9)	(9)	0,00
	08.2023	\$ 1.674	AUD 2.533	13	0	13	0,00
	08.2023	7.464	CAD 9.902	22	0	22	0,00
	08.2023	861	HUF 301.368	10	0	10	0,00
UAG	07.2023	AUD 4.036	\$ 2.695	14	(6)	8	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	\$ 181	AUD 276	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07.2023	88	CHF 79	0	0	0	0,00
	07.2023	781	NOK 8.645	26	0	26	0,00
	08.2023	2.697	AUD 4.036	6	(14)	(8)	0,00
	09.2023	90	ILS 322	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	569	ZAR 10.051	0	(41)	(41)	(0,01)
				\$ 15.842	\$ (3.253)	\$ 12.589	1,89

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 266	\$ 174	\$ 0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	\$ 672	AUD 1.013	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD 1.013	\$ 673	0	(2)	(2)	0,00
BOA	07.2023	1.694	1.106	0	(22)	(22)	0,00
	07.2023	CAD 12.264	9.013	0	(256)	(256)	(0,04)
	07.2023	CLP 144.422	178	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	DKK 3.711	536	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	€ 2.002	2.186	3	(1)	2	0,00
	07.2023	HUF 60.219	173	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	¥ 75.749	545	21	0	21	0,00
	07.2023	KRW 17.816	13	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK 2.493	227	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	NZD 109	66	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	SEK 186	17	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 5	BRL 25	0	0	0	0,00
	07.2023	179	CLP 144.422	1	0	1	0,00
	07.2023	991	DKK 6.736	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	137.943	€ 128.354	2.093	0	2.093	0,31
	07.2023	854	THB 30.392	3	0	3	0,00
	08.2023	CLP 144.422	\$ 178	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	DKK 6.725	991	4	0	4	0,00
	08.2023	THB 30.392	856	0	(3)	(3)	0,00
BPS	07.2023	BRL 0	0	0	0	0	0,00
	07.2023	CHF 83	92	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CZK 3.195	145	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	DKK 13	2	0	0	0	0,00
	07.2023	€ 143.429	157.156	675	0	675	0,10
	07.2023	¥ 2.121.726	15.271	593	0	593	0,09
	07.2023	NZD 10	6	0	0	0	0,00
	07.2023	TWD 158.157	5.164	87	0	87	0,01
	07.2023	\$ 1.008	AUD 1.533	13	0	13	0,00
	07.2023	7.374	CHF 6.595	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	1.741	CNY 12.580	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	154.756	€ 143.957	2.302	0	2.302	0,35
	07.2023	57	NOK 608	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD 724	\$ 480	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	CHF 6.576	7.374	2	0	2	0,00
	08.2023	CNY 12.562	1.741	5	0	5	0,00
	08.2023	NOK 608	57	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 156.997	€ 143.083	0	(680)	(680)	(0,10)
BRC	07.2023	PLN 1.320	\$ 313	0	(12)	(12)	0,00
	07.2023	\$ 4.082	KRW 5.388.015	7	0	7	0,00
	08.2023	KRW 5.381.238	\$ 4.082	0	(7)	(7)	0,00
CBK	07.2023	€ 122.100	132.751	18	(479)	(461)	(0,07)
	07.2023	INR 138	2	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN 15.257	848	0	(42)	(42)	(0,01)
	07.2023	NOK 222	20	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 1.827	BRL 8.735	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	219	ILS 796	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	888	MXN 15.257	2	0	2	0,00
	07.2023	5.091	TWD 158.638	2	0	2	0,00
	08.2023	BRL 8.735	\$ 1.817	15	0	15	0,00
	08.2023	ILS 795	219	5	0	5	0,00
	08.2023	MXN 15.257	883	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	TWD 158.640	5.091	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 123.117	€ 113.082	425	0	425	0,06
CLY	07.2023	DKK 10.906	\$ 1.574	0	(24)	(24)	0,00
	07.2023	\$ 185	CHF 167	1	0	1	0,00
	08.2023	CHF 166	\$ 185	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2023	BRL 8.760	1.749	0	(67)	(67)	(0,01)
	07.2023	MYR 3.191	711	28	0	28	0,00
	07.2023	THB 30.392	880	23	0	23	0,00
	07.2023	\$ 348	NOK 3.753	2	0	2	0,00
	08.2023	NOK 3.749	\$ 348	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07.2023	AUD 1.627	1.064	0	(19)	(19)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
	07.2023	€	143.271	\$	156.438	\$	129	0,02	
	07.2023	INR	360.848		4.357	(41)	(41)	(0,01)	
	07.2023	\$	4.399	INR	361.160	3	3	0,00	
	07.2023		5.233	¥	748.341	0	(55)	(0,01)	
	07.2023		41	SGD	55	0	0	0,00	
	07.2023	ZAR	13.394	\$	675	0	(34)	(0,01)	
	08.2023	INR	361.490		4.399	0	(2)	0,00	
	08.2023	¥	745.161		5.233	55	55	0,01	
	08.2023	SGD	55		41	0	0	0,00	
	08.2023	\$	156.656	€	143.271	0	(135)	(0,02)	
MBC	07.2023	CNY	88	\$	12	0	0	0,00	
	07.2023	€	5.409		5.873	14	(43)	0,00	
	07.2023	£	9.360		11.586	0	(314)	(0,05)	
	07.2023	SEK	346		32	0	0	0,00	
	07.2023	SGD	1.062		786	1	0	0,00	
	07.2023	\$	795	CAD	1.078	19	19	0,00	
	07.2023		63	€	58	1	1	0,00	
MYI	07.2023		1.229	£	986	25	25	0,00	
	07.2023	CHF	0	\$	0	0	0	0,00	
	07.2023	ILS	794		213	0	(1)	0,00	
	07.2023	PHP	30.827		552	0	(7)	0,00	
	07.2023	SEK	26.711		2.488	15	15	0,00	
	07.2023	\$	147	CZK	3.195	0	(1)	0,00	
	07.2023		881	DKK	6.007	0	0	0,00	
	07.2023		952	IDR	14.342.248	4	4	0,00	
	07.2023		688	MYR	3.191	0	(4)	0,00	
	07.2023		326	PLN	1.321	0	(1)	0,00	
	07.2023		2.527	SEK	27.285	0	(1)	0,00	
	07.2023		814	SGD	1.100	0	(1)	0,00	
	07.2023	ZAR	14.424	\$	732	0	(32)	0,00	
	08.2023	CZK	3.199		147	1	1	0,00	
	08.2023	DKK	5.997		881	0	0	0,00	
	08.2023	IDR	14.347.672		952	0	(2)	0,00	
	08.2023	MYR	3.191		689	4	4	0,00	
	08.2023	PLN	1.323		326	1	1	0,00	
	08.2023	SEK	27.251		2.527	1	1	0,00	
	08.2023	SGD	1.099		814	1	1	0,00	
SCX	07.2023	AUD	2.296		1.501	0	(28)	0,00	
	07.2023	CHF	6.426		7.151	0	(31)	0,00	
	07.2023	NZD	284		172	0	(2)	0,00	
	07.2023	\$	988	AUD	1.488	3	3	0,00	
	07.2023		1	IDR	20.238	0	0	0,00	
	08.2023	AUD	1.488	\$	988	0	(3)	0,00	
SOG	07.2023		1.757		1.150	0	(20)	0,00	
	07.2023	HKD	65.217		8.332	10	10	0,00	
	07.2023	\$	154.765	€	143.868	2.197	0	0,33	
	07.2023		1.491	ZAR	27.856	0	(16)	0,00	
TOR	08.2023	ZAR	27.934	\$	1.491	16	16	0,00	
	07.2023	AUD	930		608	0	(11)	0,00	
	07.2023	\$	1.209	AUD	1.831	9	9	0,00	
	07.2023		8.455	CAD	11.187	6	(6)	0,00	
	07.2023		10.640	£	8.374	5	5	0,00	
	07.2023		179	HUF	60.339	0	(2)	0,00	
	07.2023		10.063	¥	1.449.033	0	(37)	(0,01)	
	07.2023		245	NZD	402	1	1	0,00	
	08.2023	AUD	1.831	\$	1.210	0	(9)	0,00	
	08.2023	CAD	11.183		8.455	6	(6)	0,00	
	08.2023	£	8.374		10.643	0	(5)	0,00	
	08.2023	HUF	60.795		179	2	2	0,00	
	08.2023	¥	1.442.888		10.063	38	38	0,01	
	08.2023	NZD	402		245	0	(1)	0,00	
UAG	07.2023	AUD	213		139	0	(2)	0,00	
	07.2023	CHF	418		466	0	(2)	0,00	
	07.2023	CNY	12.526		1.782	56	0	0,01	
	07.2023	IDR	14.287.784		952	0	0	0,00	
	07.2023	KRW	5.360.687		4.065	0	(4)	0,00	
	07.2023	NOK	1.820		164	0	(5)	0,00	
	07.2023	SGD	94		69	0	0	0,00	
	07.2023	\$	1.948	AUD	2.918	4	(10)	0,00	
	07.2023		181	CHF	162	0	0	0,00	
	07.2023		557	PHP	30.861	2	2	0,00	
	08.2023	AUD	2.918	\$	1.950	10	(4)	0,00	
	08.2023	CHF	162		181	0	0	0,00	
	08.2023	PHP	30.878		557	0	(1)	0,00	
						\$ 8.971	\$ (2.564)	\$ 6.407	0,96



## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
AZD	07.2023	AUD	\$	3	\$	0	0,00		
	07.2023	\$	AUD	9		0	0,00		
BOA	08.2023	AUD	\$	6		0	0,00		
	07.2023			9		0	0,00		
	07.2023	CAD		5		0	0,00		
	07.2023	100		74		(2)	0,00		
	07.2023	CLP	2.256		3		0	0,00	
	07.2023	1		0		0	0,00		
	07.2023	34		5		0	0,00		
	07.2023	728		2		0	0,00		
	07.2023	¥	1.574		11		0	0,00	
	07.2023	KRW	126		0		0	0,00	
	07.2023	NOK	30		3		0	0,00	
	07.2023	NZD	1		1		0	0,00	
	07.2023	SEK	4		0		0	0,00	
	07.2023	\$		BRL	0		0	0,00	
	07.2023	3		CLP	2.256		0	0,00	
	07.2023	9		DKK	62		0	0,00	
	07.2023	20		SEK	212		0	0,00	
	07.2023	8		THB	302		0	0,00	
	08.2023	CLP	2.256	\$	3		0	0,00	
	08.2023	DKK	62		9		0	0,00	
08.2023	SEK	212		20		0	0,00		
08.2023	THB	302		9		0	0,00		
BPS	07.2023	BRL		0		0	0,00		
	07.2023	CHF		1		0	0,00		
	07.2023	CZK	38		2		0	0,00	
	07.2023	DKK	0		0		0	0,00	
	07.2023	¥	17.100		123		5	0,00	
	07.2023	NZD	0		0		0	0,00	
	07.2023	TWD	1.187		39		1	0,00	
	07.2023	\$	4	AUD	6		0	0,00	
	07.2023	60	CHF	54		0	0	0,00	
	07.2023	14	CNY	101		0	0	0,00	
	07.2023	205	€	187		(1)	(1)	0,00	
	07.2023	1.217	£	984	34		34	0,01	
	07.2023	1	NOK	7		0	0	0,00	
	08.2023	AUD	6	\$	4		0	0,00	
	08.2023	CHF	54		60		0	0,00	
	08.2023	CNY	101		14		0	0,00	
	08.2023	€	184		202	1	1	0,00	
	08.2023	NOK	7		1		0	0,00	
	BRC	07.2023	£		48		62	0	0,00
		07.2023	PLN	16		4		0	0,00
07.2023		\$	29	KRW	38.167		0	0,00	
08.2023		KRW	38.119	\$	29		0	0,00	
07.2023		INR	1		0		0	0,00	
07.2023		MXN	171		10		0	0,00	
07.2023		NOK	3		0		0	0,00	
07.2023		\$	14	BRL	69		0	0,00	
07.2023		5	€	4		0	0	0,00	
07.2023		3	ILS	12		0	0	0,00	
07.2023		10	MXN	171		0	0	0,00	
07.2023		38	TWD	1.191		0	0	0,00	
08.2023		BRL	69	\$	14		0	0,00	
08.2023		ILS	12		3		0	0,00	
08.2023		MXN	171		10		0	0,00	
08.2023		TWD	1.191		38		0	0,00	
CLY		07.2023	DKK	100		14		0	0,00
		07.2023	\$	2	CHF	1		0	0,00
GLM		08.2023	CHF	1	\$	2		0	0,00
		07.2023	BRL	69		14		(1)	0,00
JPM	07.2023	MYR	22		5		0	0,00	
	07.2023	THB	302		9		0	0,00	
	07.2023	\$	4	NOK	45		0	0,00	
	08.2023	NOK	45	\$	4		0	0,00	
	07.2023	£	1.064		1.345		(7)	(0,01)	
	07.2023	INR	2.769		33		0	0,00	
	07.2023	\$	34	INR	2.772		0	0,00	
	07.2023	44	¥	6.359		(1)	(1)	0,00	
	07.2023	0	SGD	1		0	0	0,00	
	08.2023	INR	2.774	\$	34		0	0,00	
	08.2023	¥	6.332		44		0	0,00	
	08.2023	SGD	1		0		0	0,00	
	08.2023	\$	1.345	£	1.064		7	0,00	
	07.2023	CAD	0	\$	0		0	0,00	
	07.2023	£	17		21		0	0,00	
	07.2023	SGD	10		8		0	0,00	
	07.2023	\$	1.355	£	1.094		36	0,01	
	MYI	07.2023	ILS	12	\$	3		0	0,00
		07.2023	PHP	147		3		0	0,00
		07.2023	SEK	208		19		0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2023	\$	2	CZK	39	\$	0	0,00
	07.2023		8	DKK	55		0	0,00
	07.2023		1.318	£	1.060		30	0,00
	07.2023		6	IDR	87.612		0	0,00
	07.2023		5	MYR	22		0	0,00
	07.2023		4	PLN	16		0	0,00
	07.2023		8	SGD	11		0	0,00
	07.2023	ZAR	191	\$	10		0	0,00
	08.2023	CZK	39		2		0	0,00
	08.2023	DKK	55		8		0	0,00
	08.2023	IDR	87.645		6		0	0,00
	08.2023	MYR	22		5		0	0,00
	08.2023	PLN	16		4		0	0,00
	08.2023	SGD	11		8		0	0,00
SCX	07.2023	AUD	18		12		0	0,00
	07.2023	CHF	52		58		0	0,00
	07.2023	NZD	3		2		0	0,00
	07.2023	\$	9	AUD	13		0	0,00
	07.2023		0	IDR	124		0	0,00
	08.2023	AUD	13	\$	9		0	0,00
SOG	07.2023		27		18		0	0,00
	07.2023	€	192		206	(3)	(3)	0,00
	07.2023	HKD	554		71		0	0,00
	07.2023	\$	10	ZAR	191		0	0,00
	08.2023	ZAR	192	\$	10		0	0,00
TOR	07.2023	AUD	14		9		0	0,00
	07.2023	£	1.064		1.353	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$	11	AUD	16		0	0,00
	07.2023		76	CAD	100		0	0,00
	07.2023		2	HUF	730		0	0,00
	07.2023		86	¥	12.314		0	0,00
	07.2023		3	NZD	5		0	0,00
	08.2023	AUD	16	\$	11		0	0,00
	08.2023	CAD	100		76		0	0,00
	08.2023	HUF	735		2		0	0,00
	08.2023	¥	12.262		86		0	0,00
	08.2023	NZD	5		3		0	0,00
	08.2023	\$	1.353	£	1.064		1	0,00
UAG	07.2023	AUD	3	\$	2		0	0,00
	07.2023	CHF	3		4		0	0,00
	07.2023	CNY	101		14		0	0,00
	07.2023	CZK	0		0		0	0,00
	07.2023	IDR	87.279		6		0	0,00
	07.2023	KRW	37.973		29		0	0,00
	07.2023	NOK	22		2		0	0,00
	07.2023	SGD	1		1		0	0,00
	07.2023	\$	17	AUD	26		0	0,00
	07.2023		1	CHF	1		0	0,00
	07.2023		3	PHP	147		0	0,00
	08.2023	AUD	26	\$	17		0	0,00
	08.2023	CHF	1		1		0	0,00
	08.2023	PHP	148		3		0	0,00
						\$	115	
						\$	(16)	
						\$	99	0,01
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$	16.517	2,47
Summe Anlagen						\$	804.155	120,28
Sonstige Aktiva und Passiva						\$	(135.568)	(20,28)
Nettovermögen						\$	668.587	100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (g) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von 28.492 USD (31. Dezember 2022: 35.607 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 900 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 56.789	\$ 467.029	\$ 356	\$ 524.174
Investmentfonds	236.945	0	0	236.945
Pensionsgeschäfte	0	18.513	0	18.513
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	8.565	15.958	0	24.523
<b>Summen</b>	<b>\$ 302.299</b>	<b>\$ 501.500</b>	<b>\$ 356</b>	<b>\$ 804.155</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 94.207	\$ 379.228	\$ 0	\$ 473.435
Investmentfonds	151.214	100.275	0	251.489
Pensionsgeschäfte	0	18.536	0	18.536
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(15.794)	1.026	0	(14.768)
<b>Summen</b>	<b>\$ 229.627</b>	<b>\$ 499.065</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 728.692</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 1	\$ 0	\$ 1	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	701	(410)	291	(3.503)	1.500	(2.003)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
BPS	2.978	(2.580)	398	485	(1.380)	(895)
BRC	8.857	(8.250)	607	(222)	450	228
BSH	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
CBK	472	(300)	172	4.514	(4.480)	34
CLY	(20)	0	(20)	(53)	0	(53)
DUB	669	(500)	169	13	0	13
GLM	(550)	120	(430)	(829)	420	(409)
GST	(12)	10	(2)	15	(20)	(5)
JPM	(755)	590	(165)	(36)	(590)	(626)
MBC	1.572	(1.510)	62	1.039	(1.100)	(61)
MEI	k. A.	k. A.	k. A.	7	(440)	(433)
MYC	(73)	180	107	(27)	180	153
MYI	(51)	0	(51)	(55)	780	725
RBC	451	(320)	131	(57)	0	(57)
RYL	(29)	0	(29)	(21)	0	(21)
SAL	(24)	0	(24)	(18)	0	(18)
SCX	13	0	13	4.106	(3.980)	126
SOG	2.348	(1.670)	678	(81)	(280)	(361)
SSB	(53)	0	(53)	(463)	590	127
TOR	14	0	14	(838)	690	(148)
UAG	8	0	8	(549)	420	(129)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	31,35	25,87
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,06	35,98
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	1,28
Investmentfonds	35,44	33,53
Pensionsgeschäfte	2,77	2,47
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	1,27	(2,13)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,08)	(0,30)
Freiverkehrsfinanzderivate	2,47	0,45

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	3,30	3,39
Wandelanleihen & Wechsel	0,14	0,12
US-Regierungsbehörden	21,74	4,77
US-Schatzobligationen	7,17	1,20
Non-Agency-MBS	1,79	1,66
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,37	7,95
Staatsemissionen	6,26	7,97
Stammaktien	1,75	6,88
Vorzugswertpapiere	0,03	0,16
Real Estate Investment Trusts	6,75	5,86
Kurzfristige Instrumente	21,11	23,17
Investmentfonds	35,44	33,53
Pensionsgeschäfte	2,77	2,47
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	1,27	(2,13)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,02	0,07
Zinsswaps	(0,09)	(0,36)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,07)	(0,06)
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,02)	(0,01)
Zinsswaps	(0,03)	(0,04)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,25)	0,05
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	0,02
Devisenterminkontrakte	1,89	(0,87)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,97	1,37
Sonstige Aktiva und Passiva	(20,28)	2,85
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global High Yield Bond Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
<b>BELGIEN</b>				<b>FRANKREICH</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>				
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>PAR (000S)</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>MARKT-WERT (000S)</b>				
Ontex Group NV				Intesa Sanpaolo SpA				4,198 % fällig am 01.06.2032	\$ 1.000	\$	746	0,02
3,500 % fällig am 15.07.2026	€ 7.500	\$ 7.222	0,24	Altice France S.A.	€ 7.000	\$ 5.593	0,18	4,950 % fällig am 01.06.2042	2.000		1.319	0,04
<b>BERMUDAS</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>NETTO-VERMÖGENS</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>NETTO-VERMÖGENS</b>				
NCL Corp. Ltd.				3,375 % fällig am 15.01.2028	€ 7.000	\$ 5.593	0,18	5,710 % fällig am 15.01.2026	5.000		4.763	0,16
5,875 % fällig am 15.03.2026	\$ 2.850	2.669	0,09	4,000 % fällig am 15.07.2029	3.000	2.357	0,08	5,875 % fällig am 01.09.2031 (e)(g)	€ 5.000		4.354	0,14
5,875 % fällig am 15.02.2027	1.875	1.827	0,06	4,125 % fällig am 15.01.2029	3.000	2.383	0,08	7,700 % fällig am 17.09.2025 (e)(g)	\$ 7.000		6.589	0,21
8,375 % fällig am 01.02.2028	3.000	3.138	0,10	5,500 % fällig am 15.01.2028	\$ 20.100	15.202	0,49	7,750 % fällig am 11.01.2027 (e)(g)	€ 4.000		4.227	0,14
Valaris Ltd.				5,500 % fällig am 15.10.2029	5.000	3.581	0,12	Italmatch Chemicals SpA				
8,375 % fällig am 30.04.2030	3.100	3.113	0,10	CAB SELAS				9,098 % fällig am 06.02.2028	2.147		2.217	0,07
Viking Cruises Ltd.				3,375 % fällig am 01.02.2028	€ 11.000	9.809	0,32	10,000 % fällig am 06.02.2028	500		533	0,02
5,875 % fällig am 15.09.2027	4.000	3.681	0,12	Chrome Bidco SASU				Mundys SpA				
13,000 % fällig am 15.05.2025	2.000	2.101	0,07	3,500 % fällig am 31.05.2028	15.300	14.083	0,46	1,625 % fällig am 03.02.2025	2.000		2.086	0,07
VOC Escrow Ltd.				Chrome Holdco SASU				1,875 % fällig am 13.07.2027	10.000		9.677	0,32
5,000 % fällig am 15.02.2028	4.000	3.674	0,12	5,000 % fällig am 15.01.2029	3.850	3.161	0,10	1,875 % fällig am 12.02.2028	12.500		11.661	0,38
Summe Bermudas		20.203	0,66	Electricite de France S.A.				Nexi SpA				
<b>KANADA</b>				<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Air Canada				Elmor Group S.A.				1,625 % fällig am 30.04.2026	8.000		7.975	0,26
3,875 % fällig am 15.08.2026	3.250	3.015	0,10	3,750 % fällig am 15.07.2026	€ 2.900	2.626	0,08	2,125 % fällig am 30.04.2029 (i)	21.200		19.336	0,63
4,625 % fällig am 15.08.2029	CAD 3.000	2.045	0,07	Eramet S.A.				Shiba BidCo SpA				
B.C. Unlimited Liability Co.				7,000 % fällig am 22.05.2028	3.500	3.929	0,13	4,500 % fällig am 31.10.2028	5.000		4.848	0,16
3,500 % fällig am 15.02.2029	\$ 4.000	3.512	0,11	Renault S.A.				Telecom Italia SpA				
4,000 % fällig am 15.10.2030	10.000	8.570	0,28	2,500 % fällig am 01.04.2028	2.900	2.812	0,09	1,625 % fällig am 18.01.2029	5.000		4.201	0,14
4,375 % fällig am 15.01.2028	2.500	2.311	0,08	Rexel S.A.				5,303 % fällig am 30.05.2024	\$ 2.000		1.946	0,06
Bausch Health Cos., Inc.				2,125 % fällig am 15.12.2028	2.600	2.494	0,08	UniCredit SpA				
4,875 % fällig am 01.06.2028	3.500	2.088	0,07	Summe Frankreich		95.580	3,11	3,875 % fällig am 03.06.2027 (e)(g)	€ 4.000		3.301	0,11
5,500 % fällig am 01.11.2025	3.000	2.655	0,09	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,459 % fällig am 30.06.2035	\$ 14.000		11.892	0,39
5,750 % fällig am 15.08.2027	2.500	1.535	0,05	Chepharm Arzneimittel GmbH				Summe Italien			129.083	4,20
Bombardier, Inc.				3,500 % fällig am 11.02.2027	3.000	2.980	0,10	<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				
7,125 % fällig am 15.06.2026	6.000	5.966	0,19	4,375 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.008	0,16	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
7,500 % fällig am 15.03.2025	1.253	1.257	0,04	7,500 % fällig am 15.05.2030	950	1.043	0,03	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
7,500 % fällig am 01.02.2029	4.000	3.958	0,13	CT Investment GmbH				Adient Global Holdings Ltd.				
7,875 % fällig am 15.04.2027	3.000	2.996	0,10	5,500 % fällig am 15.04.2026	8.700	8.833	0,29	3,500 % fällig am 15.08.2024	€ 747		801	0,03
Garda World Security Corp.				Ctec GmbH				4,875 % fällig am 15.08.2026	\$ 1.000		951	0,03
7,750 % fällig am 15.02.2028	1.200	1.192	0,04	5,250 % fällig am 15.02.2030	12.000	10.883	0,36	G City Europe Ltd.				
GFL Environmental, Inc.				HO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 2.000		1.909	0,06
3,500 % fällig am 01.09.2028	5.000	4.455	0,14	3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	4.000	4.083	0,13	Summe Jersey, Kanalinseln			3.661	0,12
4,000 % fällig am 01.08.2028	3.000	2.686	0,09	HO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)				<b>LIBERIA</b>				
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.				3,875 % fällig am 15.05.2027 (b)	2.000	1.976	0,06	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
6,000 % fällig am 15.09.2028	800	681	0,02	HO Verwaltungs GmbH (4,750 % bar oder 5,500 % PIK)				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Strathcona Resources Ltd.				4,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	\$ 5.000	4.618	0,15	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
6,875 % fällig am 01.08.2026	875	767	0,02	Nidda Healthcare Holding GmbH				Royal Caribbean Cruises Ltd.				
Summe Kanada		49.689	1,62	7,500 % fällig am 21.08.2026	€ 22.250	24.213	0,79	4,250 % fällig am 01.07.2026	\$ 5.000		4.594	0,15
<b>CAYMAN INSELN</b>				<b>IRLAND</b>				<b>LUXEMBURG</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % bar oder 9,000 % PIK)				Motion Bondco DAC				5,375 % fällig am 15.07.2027	5.400		5.055	0,16
9,000 % fällig am 22.04.2027 (b)(h)	66	64	0,00	4,500 % fällig am 15.11.2027	3.000	2.874	0,09	5,500 % fällig am 31.08.2026	10.000		9.491	0,31
9,000 % fällig am 22.04.2027 (b)	18	17	0,00	6,625 % fällig am 15.11.2027	\$ 5.000	4.582	0,15	5,500 % fällig am 01.04.2028	7.800		7.282	0,24
Spirit Loyalty Cayman Ltd.				Summe Deutschland		104.259	3,40	7,250 % fällig am 15.01.2030	3.000		3.041	0,10
8,000 % fällig am 20.09.2025	5.000	5.042	0,16	<b>ITALIEN</b>				11,500 % fällig am 01.06.2025	2.867		3.044	0,10
Transocean, Inc.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Liberia			32.507	1,06
8,750 % fällig am 15.02.2030	2.250	2.286	0,08	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
UPCB Finance Ltd.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
3,625 % fällig am 15.06.2029	€ 8.500	7.984	0,26	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Wynn Macau Ltd.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
5,500 % fällig am 01.10.2027	\$ 4.000	3.565	0,12	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Summe Cayman Inseln		18.958	0,62	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
EP Infrastructure A/S				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				Albion Financing SARL				
1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 28.500	21.854	0,71	7,677 % fällig am 18.01.2028	€ 2.000	1.839	0,06	6,125 % fällig am 15.10.2026	6.125		5.764	0,19
				8,000 % fällig am 22.01.2030	2.000	1.962	0,06	Altice Financing S.A.				
				10,500 % fällig am 23.07.2029	3.000	3.255	0,11	3,000 % fällig am 15.01.2028	€ 6.000		5.083	0,17
				FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA				5,750 % fällig am 15.08.2029	\$ 5.000		3.879	0,13
				5,625 % fällig am 01.08.2027	5.800	5.669	0,18	Altice France Holding S.A.				
				IMA Industria Macchine Automatiche SpA				4,000 % fällig am 15.02.2028	€ 4.000		2.163	0,07
				3,750 % fällig am 15.01.2028	12.000	11.514	0,37	Aramark International Finance SARL				
				Inter Media and Communication SpA				3,125 % fällig am 01.04.2025	5.000		5.269	0,17
				6,750 % fällig am 09.02.2027	3.000	3.173	0,10	BK LC Lux Finco SARL				
								5,250 % fällig am 30.04.2029	5.000		5.140	0,17
								Camelot Finance S.A.				
								4,500 % fällig am 01.11.2026	\$ 4.750		4.479	0,15
								Cidron Aida Finco SARL				
								5,000 % fällig am 01.04.2028	€ 17.500		17.327	0,56
								Cirsa Finance International SARL				
								4,500 % fällig am 15.03.2027	14.000		14.017	0,46
								Herens Holdco SARL				
								4,750 % fällig am 15.05.2028	\$ 2.100		1.630	0,05
								Herens Midco SARL				
								5,250 % fällig am 15.05.2029	€ 11.800		7.473	0,24
								InPost S.A.				
								2,250 % fällig am 15.07.2027	2.925		2.782	0,09
								LHMC Finco 2 SARL (7,250 % bar oder 8,000 % PIK)				
								7,250 % fällig am 02.10.2025 (b)	3.796		4.097	0,13

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>Loarre Investments SARL</b> 6,500 % fällig am 15.05.2029	€ 5.000	\$ 5.193	0,17
<b>Monitchem HoldCo 3 S.A.</b> 8,750 % fällig am 01.05.2028	700	756	0,03
<b>Summer BC Holdco SARL</b> 5,750 % fällig am 31.10.2026 9,250 % fällig am 31.10.2027	4.000 3.154	3.892 2.843	0,13 0,09
<b>Telecom Italia Capital S.A.</b> 6,375 % fällig am 15.11.2033 7,200 % fällig am 18.07.2036	\$ 7.000 3.000	5.945 2.582	0,19 0,08
Summe Luxemburg		100.314	3,27
<b>MULTINATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Allied Universal Holdco LLC</b> 3,625 % fällig am 01.06.2028 4,875 % fällig am 01.06.2028	€ 6.000 £ 4.250	5.259 4.219	0,17 0,14
<b>American Airlines, Inc.</b> 5,500 % fällig am 20.04.2026 5,750 % fällig am 20.04.2029	\$ 16.300 10.800	16.163 10.496	0,53 0,34
<b>Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC</b> 3,000 % fällig am 01.09.2029 3,250 % fällig am 01.09.2028 4,000 % fällig am 01.09.2029	€ 3.075 \$ 3.000 1.000	2.506 2.580 793	0,08 0,08 0,03
<b>Clarios Global LP</b> 4,375 % fällig am 15.05.2026	€ 10.000	10.431	0,34
<b>Connect Finco SARL</b> 6,750 % fällig am 01.10.2026	\$ 5.000	4.861	0,16
<b>Paysafe Finance PLC</b> 3,000 % fällig am 15.06.2029 4,000 % fällig am 15.06.2029	€ 1.875 \$ 4.500	1.590 3.542	0,05 0,11
Summe multinational		62.440	2,03
<b>NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Ashland Services BV</b> 2,000 % fällig am 30.01.2028	€ 15.000	13.942	0,45
<b>Axalta Coating Systems Dutch Holding BV</b> 3,750 % fällig am 15.01.2025	10.000	10.743	0,35
<b>Clear Channel International BV</b> 6,625 % fällig am 01.08.2025	\$ 3.000	2.989	0,10
<b>Diamond BC BV</b> 4,625 % fällig am 01.10.2029	12.000	12.113	0,40
<b>Dufry One BV</b> 2,000 % fällig am 15.02.2027 (i)	€ 14.250	13.602	0,44
<b>Energizer Gamma Acquisition BV</b> 3,500 % fällig am 30.06.2029	10.000 5.000	9.690	0,32
<b>IPD 3 BV</b> 8,000 % fällig am 15.06.2028	1.200	1.339	0,04
<b>LeasePlan Corp. NV</b> 7,375 % fällig am 29.05.2024 (e)(g)	7.000	7.508	0,25
<b>OI European Group BV</b> 6,250 % fällig am 15.05.2028	800	894	0,03
<b>Q-Park Holding BV</b> 1,500 % fällig am 01.03.2025 2,000 % fällig am 01.03.2027	4.000 7.000	4.196 6.551	0,14 0,21
<b>Sensata Technologies BV</b> 5,000 % fällig am 01.10.2025	\$ 1.000	980	0,03
<b>Triumph Packaging Finance BV</b> 3,750 % fällig am 15.08.2026	€ 5.000	5.050	0,16
<b>United Group BV</b> 3,125 % fällig am 15.02.2026 3,625 % fällig am 15.02.2028 4,000 % fällig am 15.11.2027	5.000 18.830 1.500	4.775 16.350 1.347	0,16 0,53 0,04
<b>UPC Holding BV</b> 3,875 % fällig am 15.06.2029	8.000	7.028	0,23
<b>ZF Europe Finance BV</b> 2,000 % fällig am 23.02.2026 3,000 % fällig am 23.10.2029	3.000 5.600	2.985 5.170	0,10 0,17
<b>Ziggo Bond Co. BV</b> 3,375 % fällig am 28.02.2030 6,000 % fällig am 15.01.2027	\$ 5.000 2.500	4.032 2.298	0,13 0,08
<b>Ziggo BV</b> 2,875 % fällig am 15.01.2030	€ 5.000	4.412	0,14
Summe Niederlande		142.406	4,64

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>NORWEGEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Adevinta ASA</b> 2,625 % fällig am 15.11.2025 3,000 % fällig am 15.11.2027	€ 7.000 2.750	\$ 7.340 2.797	0,24 0,09
Summe Norwegen		10.137	0,33
<b>PANAMA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Carnival Corp.</b> 4,000 % fällig am 01.08.2028 5,750 % fällig am 01.03.2027 6,000 % fällig am 01.05.2029 7,625 % fällig am 01.03.2026	\$ 7.000 10.000 2.000 3.000	6.212 9.215 1.788 2.941	0,20 0,30 0,06 0,10
Summe Panama		20.156	0,66
<b>SPANIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Cellnex Finance Co. S.A.</b> 2,000 % fällig am 15.09.2032 2,000 % fällig am 15.02.2033 3,875 % fällig am 07.07.2041	€ 10.000 3.000 \$ 2.400	8.607 2.554 1.761	0,28 0,08 0,06
<b>Cellnex Telecom S.A.</b> 1,000 % fällig am 20.04.2027 1,875 % fällig am 26.06.2029	€ 4.100 5.000	3.925 4.615	0,13 0,15
<b>Grifols Escrow Issuer S.A.</b> 3,875 % fällig am 15.10.2028	14.800	13.857	0,45
<b>Grifols S.A.</b> 2,250 % fällig am 15.11.2027 3,200 % fällig am 01.05.2025	5.000 6.500	4.951 6.918	0,16 0,23
<b>Kaixo Bondco Telecom S.A.</b> 5,125 % fällig am 30.09.2029	7.000	6.671	0,22
<b>Lorca Telecom Bondco S.A.</b> 4,000 % fällig am 18.09.2027	14.000	13.968	0,45
Summe Spanien		67.827	2,21
<b>SCHWEDEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Dometic Group AB</b> 2,000 % fällig am 29.09.2028	5.000	4.418	0,14
<b>Intrum AB</b> 3,000 % fällig am 15.09.2027 3,500 % fällig am 15.07.2026 9,250 % fällig am 15.03.2028 (i)	7.500 2.000 3.584	5.683 1.630 3.318	0,19 0,05 0,11
<b>Verisure Holding AB</b> 3,250 % fällig am 15.02.2027	10.000	9.720	0,32
<b>Verisure Midholding AB</b> 5,250 % fällig am 15.02.2029	2.650	2.513	0,08
Summe Schweden		27.282	0,89
<b>GROSSBRITANNIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>BCP Modular Services Finance PLC</b> 4,750 % fällig am 30.11.2028 6,750 % fällig am 30.11.2029	10.000 8.000	9.327 6.655	0,30 0,22
<b>Bellis Acquisition Co. PLC</b> 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 10.000	10.671	0,35
<b>Carnival PLC</b> 1,000 % fällig am 28.10.2029	€ 8.000	5.490	0,18
<b>Harbour Energy PLC</b> 5,500 % fällig am 15.10.2026	\$ 2.100	1.933	0,06
<b>Heathrow Finance PLC</b> 4,125 % fällig am 01.09.2029	£ 3.333	3.441	0,11
<b>INEOS Finance PLC</b> 2,875 % fällig am 01.05.2026	€ 5.000	5.015	0,16
<b>INEOS Quattro Finance PLC</b> 2,500 % fällig am 15.01.2026 3,750 % fällig am 15.07.2026	4.000 2.475	3.920 2.385	0,13 0,08
<b>International Game Technology PLC</b> 2,375 % fällig am 15.04.2028 6,500 % fällig am 15.02.2025	8.000 \$ 1.133	7.842 1.134	0,26 0,04
<b>Lloyds Banking Group PLC</b> 7,500 % fällig am 27.06.2024 (e)(g)	6.000	5.737	0,19

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>Market Bidco Finco PLC</b> 5,500 % fällig am 04.11.2027	£ 10.300	\$ 10.230	0,33
<b>Marks &amp; Spencer PLC</b> 3,750 % fällig am 19.05.2026	100	115	0,00
<b>PEU Fin PLC</b> 7,250 % fällig am 01.07.2028	€ 1.200	1.312	0,04
<b>Rolls-Royce PLC</b> 0,875 % fällig am 09.05.2024 4,625 % fällig am 16.02.2026 5,750 % fällig am 15.10.2027	3.000 2.500 £ 4.000	3.174 2.688 4.728	0,10 0,09 0,15
<b>Thames Water Kemble Finance PLC</b> 4,625 % fällig am 19.05.2026	850	562	0,02
<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b> 4,250 % fällig am 15.01.2030	20.000	20.072	0,65
<b>Vmed O2 UK Financing PLC</b> 3,250 % fällig am 31.01.2031 4,750 % fällig am 15.07.2031	€ 10.750 \$ 6.250	9.662 5.203	0,32 0,17
<b>Vodafone Group PLC</b> 7,000 % fällig am 04.04.2029	4.000	4.109	0,13
<b>Zenith Finco PLC</b> 6,800 % fällig am 30.06.2027	£ 3.000	2.912	0,10
Summe Großbritannien		128.317	4,18
<b>USA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Academy Ltd.</b> 6,000 % fällig am 15.11.2027	\$ 5.000	4.806	0,16
<b>Acadia Healthcare Co., Inc.</b> 5,000 % fällig am 15.04.2029	5.000	4.615	0,15
<b>AdaptHealth LLC</b> 5,125 % fällig am 01.03.2030 6,125 % fällig am 01.08.2028	1.000 2.000	811 1.735	0,03 0,06
<b>ADT Security Corp.</b> 4,875 % fällig am 15.07.2032	4.000	3.426	0,11
<b>Advantage Sales &amp; Marketing, Inc.</b> 6,500 % fällig am 15.11.2028	7.000	5.926	0,19
<b>Albertsons Cos., Inc.</b> 3,500 % fällig am 15.03.2029 4,625 % fällig am 15.01.2027 6,500 % fällig am 15.02.2028	5.000 2.000 5.000	4.333 1.897 5.014	0,14 0,06 0,16
<b>Allegiant Travel Co.</b> 7,250 % fällig am 15.08.2027	10.500	10.472	0,34
<b>Allison Transmission, Inc.</b> 3,750 % fällig am 30.01.2031 4,750 % fällig am 01.10.2027	2.000 2.000	1.691 1.886	0,06 0,06
<b>AMC Networks, Inc.</b> 4,250 % fällig am 15.02.2029 4,750 % fällig am 01.08.2025	7.000 8.300	3.771 7.267	0,12 0,24
<b>American Airlines Pass-Through Trust</b> 3,375 % fällig am 01.11.2028	300	270	0,01
<b>American Airlines, Inc.</b> 7,250 % fällig am 15.02.2028	900	896	0,03
<b>American Builders &amp; Contractors Supply Co., Inc.</b> 3,875 % fällig am 15.11.2029 4,500 % fällig am 15.01.2028	4.500 10.000	3.848 9.123	0,13 0,30
<b>Amsted Industries, Inc.</b> 4,625 % fällig am 15.05.2030	5.000	4.465	0,15
<b>AmWINS Group, Inc.</b> 4,875 % fällig am 30.06.2029	5.000	4.520	0,15
<b>ANGI Group LLC</b> 3,875 % fällig am 15.08.2028	2.000	1.635	0,05
<b>Antero Midstream Partners LP</b> 5,375 % fällig am 15.06.2029	5.000	4.651	0,15
<b>Antero Resources Corp.</b> 5,375 % fällig am 01.03.2030	4.000	3.707	0,12
<b>Apache Corp.</b> 4,875 % fällig am 15.11.2027	5.000	4.645	0,15
<b>API Group DE, Inc.</b> 4,750 % fällig am 15.10.2029	3.000	2.705	0,09
<b>Aramark Services, Inc.</b> 5,000 % fällig am 01.02.2028	3.000	2.832	0,09
<b>Ascent Resources Utica Holdings LLC</b> 5,875 % fällig am 30.06.2029	3.000	2.680	0,09
<b>ASP Unifrax Holdings, Inc.</b> 5,250 % fällig am 30.09.2028 7,500 % fällig am 30.09.2029	5.000 2.000	3.616 1.240	0,12 0,04

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Avantor Funding, Inc. 3,875 % fällig am 15.07.2028	€ 4.750	\$ 4.762	0,16	Cloud Software Group, Inc. 6,500 % fällig am 31.03.2029	8.000	7.131	0,23	6,500 % fällig am 01.09.2030	1.750	1.750	0,06
4,625 % fällig am 15.07.2028	\$ 2.500	2.320	0,08	Coinbase Global, Inc. 3,375 % fällig am 01.10.2028	\$ 1.000	\$ 670	0,02	EQM Midstream Partners LP 4,000 % fällig am 01.08.2024	\$ 1.871	\$ 1.832	0,06
Ball Corp. 1,500 % fällig am 15.03.2027	€ 5.000	4.892	0,16	6,875 % fällig am 01.10.2031	1.000	592	0,02	4,500 % fällig am 15.01.2029	10.550	9.421	0,31
2,875 % fällig am 15.08.2030	\$ 7.500	6.233	0,20	CommScope, Inc. 4,750 % fällig am 01.09.2029	7.500	5.920	0,19	4,750 % fällig am 15.01.2031	5.050	4.430	0,14
3,125 % fällig am 15.09.2031	4.000	3.295	0,11	6,000 % fällig am 01.03.2026	2.000	1.866	0,06	6,000 % fällig am 01.07.2025	735	728	0,02
Bath & Body Works, Inc. 6,625 % fällig am 01.10.2030	4.000	3.866	0,13	Community Health Systems, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2031	5.000	3.784	0,12	6,500 % fällig am 01.07.2027	2.000	1.975	0,06
6,875 % fällig am 01.11.2035	7.000	6.416	0,21	5,250 % fällig am 15.05.2030	5.000	3.944	0,13	6,500 % fällig am 15.07.2048	4.000	3.624	0,12
BCPE Empire Holdings, Inc. 7,625 % fällig am 01.05.2027	12.000	11.173	0,36	5,625 % fällig am 15.03.2027	8.000	7.058	0,23	7,500 % fällig am 01.06.2027	1.000	1.011	0,03
Black Knight InfoServ LLC 3,625 % fällig am 01.09.2028	5.000	4.488	0,15	6,000 % fällig am 15.01.2029	1.625	1.369	0,04	7,500 % fällig am 01.06.2030	2.000	2.026	0,07
Blue Racer Midstream LLC 7,625 % fällig am 15.12.2025	5.000	5.059	0,17	6,875 % fällig am 15.04.2029	3.000	1.877	0,06	First Student Bidco, Inc. 4,000 % fällig am 31.07.2029	5.000	4.241	0,14
Boxer Parent Co., Inc. 6,500 % fällig am 02.10.2025	€ 3.000	3.239	0,11	Comstock Resources, Inc. 5,875 % fällig am 15.01.2030	2.000	1.739	0,06	Ford Motor Co. 3,250 % fällig am 12.02.2032	6.125	4.824	0,16
Boyd Gaming Corp. 4,750 % fällig am 01.12.2027	\$ 2.000	1.897	0,06	6,750 % fällig am 01.03.2029	4.000	3.664	0,12	6,100 % fällig am 19.08.2032	4.250	4.123	0,13
4,750 % fällig am 15.06.2031	4.000	3.578	0,12	CoreLogic, Inc. 4,500 % fällig am 01.05.2028	7.000	5.651	0,18	Ford Motor Credit Co. LLC 2,700 % fällig am 10.08.2026	8.000	7.150	0,23
Boyne USA, Inc. 4,750 % fällig am 15.05.2029	5.000	4.510	0,15	Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 7.750	8.216	0,27	2,900 % fällig am 16.02.2028	5.000	4.287	0,14
Buckeye Partners LP 4,125 % fällig am 01.03.2025	3.000	2.857	0,09	5,000 % fällig am 15.04.2026	\$ 1.000	959	0,03	2,900 % fällig am 10.02.2029	4.000	3.314	0,11
4,500 % fällig am 01.03.2028	2.500	2.242	0,07	Covanta Holding Corp. 4,875 % fällig am 01.12.2029	3.000	2.599	0,09	3,375 % fällig am 13.11.2025	5.000	4.654	0,15
Builders FirstSource, Inc. 4,250 % fällig am 01.02.2032	3.000	2.614	0,09	5,000 % fällig am 01.09.2030	3.000	2.551	0,08	4,000 % fällig am 13.11.2030	12.000	10.266	0,33
5,000 % fällig am 01.03.2030	5.000	4.680	0,15	Credit Suisse AG AT1 Claim ^	4.900	196	0,01	4,125 % fällig am 17.08.2027	5.000	4.570	0,15
Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % fällig am 01.07.2031	5.650	5.622	0,18	Crestwood Midstream Partners LP 7,375 % fällig am 01.02.2031	4.000	3.947	0,13	4,134 % fällig am 04.08.2025	6.000	5.696	0,19
Caesars Entertainment, Inc. 4,625 % fällig am 15.10.2029	5.925	5.179	0,17	Cross, Inc. 4,125 % fällig am 15.08.2031	4.000	3.236	0,11	4,174 % fällig am 01.12.2024	€ 5.000	5.390	0,18
6,250 % fällig am 01.07.2025	5.000	4.981	0,16	Crown Americas LLC 4,250 % fällig am 30.09.2026	5.000	4.739	0,15	4,542 % fällig am 01.08.2026	\$ 3.000	2.823	0,09
7,000 % fällig am 15.02.2030	5.000	5.026	0,16	4,750 % fällig am 01.02.2026	2.000	1.940	0,06	6,950 % fällig am 10.06.2026	5.000	5.030	0,16
Callon Petroleum Co. 7,500 % fällig am 15.06.2030	3.000	2.834	0,09	CrownRock LP 5,000 % fällig am 01.05.2029	2.000	1.876	0,06	7,200 % fällig am 10.06.2030	5.000	5.051	0,16
Calpine Corp. 3,750 % fällig am 01.03.2031	2.000	1.622	0,05	5,625 % fällig am 15.10.2025	5.000	4.932	0,16	Fortrea Holdings, Inc. 7,500 % fällig am 01.07.2030	2.000	2.050	0,07
4,500 % fällig am 15.02.2028	4.000	3.625	0,12	CSC Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.02.2031	5.000	3.389	0,11	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 5,500 % fällig am 01.05.2028	2.950	2.703	0,09
4,625 % fällig am 01.02.2029	1.500	1.267	0,04	4,125 % fällig am 15.12.2030	5.000	3.502	0,11	6,500 % fällig am 01.10.2025	1.287	1.269	0,04
5,125 % fällig am 15.03.2028	4.000	3.575	0,12	5,500 % fällig am 15.04.2027	2.000	1.667	0,05	Frontier Communications Holdings LLC 5,000 % fällig am 01.05.2028	2.500	2.159	0,07
5,250 % fällig am 01.06.2026	663	641	0,02	Curo Group Holdings Corp. 7,500 % fällig am 01.08.2028	2.600	985	0,03	5,875 % fällig am 15.10.2027	3.000	2.756	0,09
Capstone Borrower, Inc. 8,000 % fällig am 15.06.2030	3.100	3.064	0,10	DaVita, Inc. 3,750 % fällig am 15.02.2031	7.000	5.606	0,18	6,750 % fällig am 01.05.2029	3.000	2.330	0,08
Catalent Pharma Solutions, Inc. 2,375 % fällig am 01.03.2028	€ 20.000	17.658	0,58	4,625 % fällig am 01.06.2030	12.000	10.315	0,34	Gap, Inc. 3,625 % fällig am 01.10.2029	3.500	2.477	0,08
5,000 % fällig am 15.07.2027	\$ 1.000	919	0,03	Diamond Offshore Drilling, Inc. 13,000 % fällig am 21.12.2026	44	43	0,00	3,875 % fällig am 01.10.2031	4.000	2.743	0,09
CCO Holdings LLC 4,250 % fällig am 01.02.2031	5.000	4.049	0,13	Diamond Sports Group LLC 5,375 % fällig am 15.08.2026 ^	6.000	206	0,01	Gartner, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2029	4.000	3.525	0,12
4,250 % fällig am 15.01.2034	7.000	5.298	0,17	Directv Financing LLC 5,875 % fällig am 15.08.2027	12.500	11.335	0,37	3,750 % fällig am 01.10.2030	2.000	1.744	0,06
4,500 % fällig am 15.08.2030	10.000	8.336	0,27	DISH DBS Corp. 5,250 % fällig am 01.12.2026	6.750	5.427	0,18	4,500 % fällig am 01.07.2028	2.000	1.870	0,06
4,500 % fällig am 01.05.2032	10.000	7.994	0,26	5,750 % fällig am 01.12.2028	5.000	3.728	0,12	Genesis Energy LP 6,250 % fällig am 15.05.2026	2.000	1.902	0,06
4,500 % fällig am 01.06.2033	5.000	3.932	0,13	5,875 % fällig am 15.11.2024	5.000	4.379	0,14	6,500 % fällig am 01.10.2025	2.000	1.972	0,06
4,750 % fällig am 01.03.2030	7.000	5.992	0,20	7,750 % fällig am 01.07.2026	5.000	3.072	0,10	8,875 % fällig am 15.04.2030	700	685	0,02
5,125 % fällig am 01.05.2027	9.000	8.390	0,27	DISH Network Corp. 11,750 % fällig am 15.11.2027	5.000	4.885	0,16	Go Daddy Operating Co. LLC 3,500 % fällig am 01.03.2029	5.000	4.289	0,14
5,375 % fällig am 01.06.2029	3.500	3.168	0,10	DT Midstream, Inc. 4,125 % fällig am 15.06.2029	5.000	4.393	0,14	GoTo Group, Inc. 5,500 % fällig am 01.09.2027	2.000	1.103	0,04
CDI Escrow Issuer, Inc. 5,750 % fällig am 01.04.2030	3.750	3.494	0,11	4,375 % fällig am 15.06.2031	4.000	3.451	0,11	Graphic Packaging International LLC 2,625 % fällig am 01.02.2029	€ 1.000	963	0,03
Central Garden & Pet Co. 4,125 % fällig am 30.04.2031	4.000	3.303	0,11	Edgewell Personal Care Co. 4,125 % fällig am 01.04.2029	4.000	3.495	0,11	3,500 % fällig am 01.03.2029	\$ 2.500	2.189	0,07
Charles River Laboratories International, Inc. 3,750 % fällig am 15.03.2029	2.000	1.762	0,06	5,500 % fällig am 01.06.2028	5.000	4.732	0,15	Greystar Real Estate Partners LLC 5,750 % fällig am 01.12.2025	6.000	5.864	0,19
4,000 % fällig am 15.03.2031	1.000	870	0,03	Elanco Animal Health, Inc. 6,650 % fällig am 28.08.2028	5.000	4.864	0,16	HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	5.400	4.845	0,16
Chesapeake Energy Corp. 5,500 % fällig am 01.02.2026	2.000	1.952	0,06	Element Solutions, Inc. 3,875 % fällig am 01.09.2028	5.000	4.367	0,14	3,750 % fällig am 15.09.2030	4.300	3.378	0,11
5,875 % fällig am 01.02.2029	1.500	1.426	0,05	Emerald Debt Merger Sub LLC 6,625 % fällig am 15.12.2030	6.425	6.377	0,21	HealthEquity, Inc. 4,500 % fällig am 01.10.2029	2.000	1.765	0,06
6,750 % fällig am 15.04.2029	12.000	11.918	0,39	Encino Acquisition Partners Holdings LLC 8,500 % fällig am 01.05.2028	2.184	1.984	0,06	Hertz Corp. 4,625 % fällig am 01.12.2026	1.000	903	0,03
Churchill Downs, Inc. 6,750 % fällig am 01.05.2031	5.000	4.950	0,16	Endeavor Energy Resources LP 5,750 % fällig am 30.01.2028	10.000	9.791	0,32	5,000 % fällig am 01.12.2029	3.000	2.484	0,08
Clarivate Science Holdings Corp. 3,875 % fällig am 01.07.2028	3.750	3.328	0,11	EnLink Midstream LLC 5,375 % fällig am 01.06.2029	7.500	7.152	0,23	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2032	2.000	1.669	0,05
4,875 % fällig am 01.07.2029	4.000	3.553	0,12	5,625 % fällig am 15.01.2028	1.000	969	0,03	3,750 % fällig am 01.05.2029	3.500	3.110	0,10
Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.01.2032	5.000	4.078	0,13	Hologic, Inc. 3,250 % fällig am 15.02.2029	4.000	3.503	0,11	4,000 % fällig am 01.05.2031	3.000	2.608	0,09
4,750 % fällig am 15.03.2028	2.000	1.847	0,06	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC 4,875 % fällig am 01.07.2031	5.000	4.200	0,14	5,750 % fällig am 01.05.2028	1.500	1.478	0,05
								Hilton Worldwide Finance LLC 4,875 % fällig am 01.04.2027	2.500	2.427	0,08



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Howard Hughes Corp. 4,125 % fällig am 01.02.2029 4,375 % fällig am 01.02.2031 5,375 % fällig am 01.08.2028	\$ 4.000 3.000 1.000	\$ 3.314 2.397 891	0,11 0,08 0,03	Moog, Inc. 4,250 % fällig am 15.12.2027	4.000	3.705	0,12	PDC Energy, Inc. 5,750 % fällig am 15.05.2026	2.000	1.994	0,07
Howard Midstream Energy Partners LLC 6,750 % fällig am 15.01.2027 8,875 % fällig am 15.08.2027 15.07.2028 (a)	450 5.775	429 5.811	0,01 0,19	MPH Acquisition Holdings LLC 5,500 % fällig am 01.09.2028 5,750 % fällig am 01.11.2028	\$ 5.000 5.000	\$ 4.268 3.769	0,14 0,12	PennyMac Financial Services, Inc. 4,250 % fällig am 15.02.2029 5,750 % fällig am 15.09.2031	\$ 7.500 2.000	\$ 6.031 1.633	0,20 0,05
Howmet Aerospace, Inc. 5,950 % fällig am 01.02.2037	3.000	3.058	0,10	MPT Operating Partnership LP 0,993 % fällig am 15.10.2026 2,500 % fällig am 24.03.2026	€ 3.300 £ 2.125	2.739 2.122	0,09 0,07	Performance Food Group, Inc. 4,250 % fällig am 01.08.2029 5,500 % fällig am 15.10.2027 6,875 % fällig am 01.05.2025	3.000 5.000 1.500	2.674 4.825 1.503	0,09 0,16 0,05
iHeartCommunications, Inc. 4,750 % fällig am 15.01.2028 5,250 % fällig am 15.06.2028	5.000 3.000	3.776 2.298	0,12 0,08	Nabors Industries, Inc. 7,375 % fällig am 15.05.2027	\$ 2.750	2.619	0,09	Permian Resources Operating LLC 5,375 % fällig am 15.01.2026 5,875 % fällig am 01.07.2029 6,875 % fällig am 01.04.2027	2.000 3.000 4.000	1.907 2.829 3.957	0,06 0,09 0,13
Imola Merger Corp. 4,750 % fällig am 15.05.2029	7.500	6.530	0,21	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.08.2028	5.000	4.386	0,14	PetSmart, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2028 7,750 % fällig am 15.02.2029	12.000 6.000	11.103 5.968	0,36 0,19
IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2028 2,250 % fällig am 15.03.2029 2,875 % fällig am 15.06.2028 5,000 % fällig am 15.05.2027	€ 10.000 5.900 7.000 \$ 2.000	9.653 5.515 6.898 1.926	0,31 0,18 0,23 0,06	NCR Corp. 5,000 % fällig am 01.10.2028 5,250 % fällig am 01.10.2030 5,750 % fällig am 01.09.2027 6,125 % fällig am 01.09.2029	4.000 2.500 3.750 2.000	3.574 2.177 3.754 2.003	0,12 0,07 0,12 0,07	Post Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 15.09.2031 4,625 % fällig am 15.04.2030 5,500 % fällig am 15.12.2029 5,625 % fällig am 15.01.2028	1.864 5.000 5.000 5.000	1.594 4.387 4.620 4.812	0,05 0,14 0,15 0,16
Jeld-Wen, Inc. 4,625 % fällig am 15.12.2025 4,875 % fällig am 15.12.2027 6,250 % fällig am 15.05.2025	1.000 2.000 2.000	970 1.774 2.019	0,03 0,06 0,07	Newell Brands, Inc. 5,875 % fällig am 01.04.2036 6,375 % fällig am 15.09.2027	1.525 1.250	1.277 1.200	0,04 0,04	Prime Security Services Borrower LLC 3,375 % fällig am 31.08.2027 5,250 % fällig am 15.04.2024 5,750 % fällig am 15.04.2026 6,250 % fällig am 15.01.2028	5.000 1.600 4.000 5.000	4.415 1.588 3.930 4.691	0,14 0,05 0,13 0,15
Kaiser Aluminum Corp. 4,500 % fällig am 01.06.2031 4,625 % fällig am 01.03.2028	2.000 4.000	1.597 3.504	0,05 0,11	Nexstar Media, Inc. 4,750 % fällig am 01.11.2028 5,625 % fällig am 15.07.2027	4.000 4.000	3.475 3.732	0,11 0,12	Radiate Holdco LLC 4,500 % fällig am 15.09.2026 6,500 % fällig am 15.09.2028	6.000 3.000	4.792 1.755	0,16 0,06
KFC Holding Co. 4,750 % fällig am 01.06.2027	3.500	3.382	0,11	NextEra Energy Operating Partners LP 4,250 % fällig am 15.07.2024 4,250 % fällig am 15.09.2024 4,500 % fällig am 15.09.2027	2.000 262 3.000	1.958 251 2.790	0,06 0,01 0,09	Range Resources Corp. 4,750 % fällig am 15.02.2030 8,250 % fällig am 15.01.2029	2.000 2.000	1.795 2.084	0,06 0,07
Kinetik Holdings LP 5,875 % fällig am 15.06.2030	3.000	2.854	0,09	NGL Energy Operating LLC 7,500 % fällig am 01.02.2026	4.500	4.437	0,14	RHP Hotel Properties LP 4,500 % fällig am 15.02.2029 4,750 % fällig am 15.10.2027	7.500 4.000	6.644 3.729	0,22 0,12
Kronos International, Inc. 3,750 % fällig am 15.09.2025	€ 8.200	8.185	0,27	Noble Finance LLC 8,000 % fällig am 15.04.2030	4.300	4.376	0,14	Ritchie Bros Holdings, Inc. 6,750 % fällig am 15.03.2028 7,750 % fällig am 15.03.2031	1.400 2.500	1.413 2.597	0,05 0,08
LABL, Inc. 5,875 % fällig am 01.11.2028 6,750 % fällig am 15.07.2026	\$ 2.500 5.000	2.278 4.921	0,07 0,16	Novelis Corp. 3,250 % fällig am 15.11.2026 3,875 % fällig am 15.08.2031 4,750 % fällig am 30.01.2030	3.000 8.000 7.000	2.719 6.592 6.228	0,09 0,22 0,20	RLJ Lodging Trust LP 4,000 % fällig am 15.09.2029	5.000	4.192	0,14
Lamb Weston Holdings, Inc. 4,125 % fällig am 31.01.2030 4,875 % fällig am 15.05.2028	2.000 2.000	1.789 1.917	0,06 0,06	NRG Energy, Inc. 3,375 % fällig am 15.02.2029 6,625 % fällig am 15.01.2027	4.250 1.067	3.480 1.060	0,11 0,03	Rockcliff Energy LLC 5,500 % fällig am 15.10.2029	5.000	4.617	0,15
Legacy LifePoint Health LLC 4,375 % fällig am 15.02.2027	4.000	3.100	0,10	NSG Holdings LLC 7,750 % fällig am 15.12.2025	482	480	0,02	Rocket Mortgage LLC 3,625 % fällig am 01.03.2029 3,875 % fällig am 01.03.2031 4,000 % fällig am 15.10.2033	1.750 3.000 2.000	1.473 2.435 1.566	0,05 0,08 0,05
Legends Hospitality Holding Co. LLC 5,000 % fällig am 01.02.2026	1.750	1.577	0,05	NuStar Logistics LP 5,750 % fällig am 01.10.2025 6,375 % fällig am 01.10.2030	2.500 2.000	2.440 1.910	0,08 0,06	Rockies Express Pipeline LLC 3,600 % fällig am 15.05.2025 4,800 % fällig am 15.05.2030 4,950 % fällig am 15.07.2029	1.500 2.000 4.000	1.419 1.750 3.664	0,05 0,06 0,12
Lehman Brothers Holdings, Inc. 0,000 % fällig am 25.05.2010 ^	14.200	32	0,00	Olympus Water U.S. Holding Corp. 3,875 % fällig am 01.10.2028 4,250 % fällig am 01.10.2028 5,375 % fällig am 01.10.2029 (j)	€ 10.000 \$ 2.000 € 10.000	8.637 1.583 7.644	0,28 0,05 0,25	Sabre GBLB, Inc. 7,375 % fällig am 01.09.2025 11,250 % fällig am 15.12.2027	2.000 2.280	1.778 1.934	0,06 0,06
Level 3 Financing, Inc. 3,625 % fällig am 15.01.2029 3,750 % fällig am 15.07.2029 4,250 % fällig am 01.07.2028	2.000 3.000 5.000	1.202 1.810 3.225	0,04 0,06 0,11	ON Semiconductor Corp. 3,875 % fällig am 01.09.2028	\$ 3.500	3.189	0,10	SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029 3,875 % fällig am 15.02.2027	7.000 7.000	5.940 6.455	0,19 0,21
LFS Topco LLC 5,875 % fällig am 15.10.2026	2.500	2.199	0,07	OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027 5,375 % fällig am 15.11.2029 6,125 % fällig am 15.03.2024 6,625 % fällig am 15.01.2028 6,875 % fällig am 15.03.2025 7,125 % fällig am 15.03.2026	5.000 5.000 3.000 2.000 5.000 2.000	4.295 4.256 2.992 1.889 4.955 1.967	0,14 0,14 0,10 0,06 0,16 0,06	SCIH Salt Holdings, Inc. 4,875 % fällig am 01.05.2028 6,625 % fällig am 01.05.2029	5.000 3.000	4.472 2.517	0,15 0,08
Madison IAQ LLC 4,125 % fällig am 30.06.2028	8.000	7.052	0,23	Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028 4,125 % fällig am 30.04.2028 5,125 % fällig am 30.04.2031	€ 7.500 \$ 3.000 6.000	7.122 2.666 4.958	0,23 0,09 0,16	SCIL LLC 9,500 % fällig am 15.07.2028 (a)	€ 2.475	2.700	0,09
Marriott Ownership Resorts, Inc. 4,500 % fällig am 15.06.2029	2.000	1.728	0,06	Outfront Media Capital LLC 4,250 % fällig am 15.01.2029 4,625 % fällig am 15.03.2030 5,000 % fällig am 15.08.2027 6,250 % fällig am 15.06.2025	2.500 2.000 3.000 2.000	2.104 1.669 2.727 1.995	0,07 0,05 0,09 0,07	Scripps Escrow, Inc. 5,875 % fällig am 15.07.2027	\$ 5.000	4.054	0,13
Mattel, Inc. 3,750 % fällig am 01.04.2029 5,875 % fällig am 15.12.2027	3.000 5.000	2.642 4.915	0,09 0,16	Owens & Minor, Inc. 6,625 % fällig am 01.04.2030	3.750	3.406	0,11	Select Medical Corp. 6,250 % fällig am 15.08.2026	2.000	1.968	0,06
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 7,875 % fällig am 15.08.2026	6.000	5.968	0,19	Owens-Brockway Glass Container, Inc. 7,250 % fällig am 15.05.2031	2.400	2.433	0,08	Sensata Technologies, Inc. 3,750 % fällig am 15.02.2031	6.000	5.138	0,17
Medline Borrower LP 3,875 % fällig am 01.04.2029 5,250 % fällig am 01.10.2029	13.500 18.500	11.745 16.071	0,38 0,52	Oxford Finance LLC 6,375 % fällig am 01.02.2027	5.300	4.937	0,16	Silgan Holdings, Inc. 2,250 % fällig am 01.06.2028	€ 5.750	5.417	0,18
MGM Resorts International 4,625 % fällig am 01.09.2026 5,750 % fällig am 15.06.2025	5.000 1.000	4.720 992	0,15 0,03	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC 4,375 % fällig am 15.10.2028	3.000	2.601	0,08	Sirius XM Radio, Inc. 3,875 % fällig am 01.09.2031 4,000 % fällig am 15.07.2028 5,000 % fällig am 01.08.2027	\$ 2.000 8.000 5.000	1.548 6.960 4.644	0,05 0,23 0,15
Michaels Cos., Inc. 5,250 % fällig am 01.05.2028	3.750	3.034	0,10	Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 4,000 % fällig am 15.10.2027	10.000	8.855	0,29	SM Energy Co. 6,500 % fällig am 15.07.2028 6,625 % fällig am 15.01.2027	2.000 2.000	1.922 1.944	0,06 0,06
Midcap Financial Issuer Trust 6,500 % fällig am 01.05.2028	4.000	3.565	0,12	Park Intermediate Holdings LLC 4,875 % fällig am 15.05.2029 7,500 % fällig am 01.06.2025	3.000 1.000	2.588 1.001	0,08 0,03	Southwestern Energy Co. 5,375 % fällig am 01.02.2029 5,375 % fällig am 15.03.2030	5.000 5.000	4.713 4.671	0,15 0,15

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
Spectrum Brands, Inc. 3,875 % fällig am 15.03.2031	\$ 3.000	\$ 2.463	0,08		Uber Technologies, Inc. 4,500 % fällig am 15.08.2029	\$ 7.000	\$ 6.456	0,21		ZoomInfo Technologies LLC 3,875 % fällig am 01.02.2029	5.000	4.305	0,14	
4,000 % fällig am 01.10.2026	€ 2.000	2.101	0,07		United Airlines, Inc. 4,375 % fällig am 15.04.2026	5.400	5.135	0,17				1.597.237	52,03	
5,000 % fällig am 01.10.2029	\$ 2.000	1.787	0,06		4,625 % fällig am 15.04.2029	11.900	10.854	0,35		<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
5,750 % fällig am 15.07.2025	480	480	0,02		Univision Communications, Inc. 4,500 % fällig am 01.05.2029	8.000	6.882	0,22		RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % fällig am 16.11.2025	\$ 4.327	\$ 4.018	0,13	
Spirit AeroSystems, Inc. 7,500 % fällig am 15.04.2025	6.700	6.629	0,22		5,125 % fällig am 15.02.2025	4.000	3.920	0,13		Team Health Holdings, Inc. 7,943 % fällig am 06.02.2024	8.743	7.775	0,25	
9,375 % fällig am 30.11.2029	3.000	3.215	0,11		6,625 % fällig am 01.06.2027	5.000	4.840	0,16		U.S. Renal Care, Inc. 10,192 % fällig am 26.06.2026	9.625	4.516	0,15	
SRS Distribution, Inc. 4,625 % fällig am 01.07.2028	7.000	6.259	0,20		Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 15.08.2029	3.250	2.842	0,09				16.309	0,53	
6,000 % fällig am 01.12.2029	2.500	2.161	0,07		3,875 % fällig am 01.11.2033	2.500	2.051	0,07		<b>NON-AGENCY-MBS</b>				
6,125 % fällig am 01.07.2029	5.000	4.325	0,14		4,125 % fällig am 15.08.2031	3.350	2.886	0,09		Bear Stearns ALT-A Trust 3,827 % fällig am 25.03.2036 ^	35	27	0,00	
Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 20.000	19.433	0,63		6,250 % fällig am 15.01.2030	10.000	9.929	0,32		Countrywide Alternative Loan Trust 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	1.101	664	0,02	
3,375 % fällig am 15.01.2031	\$ 4.000	3.225	0,11		Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	5.300	5.389	0,18		Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 5,467 % fällig am 19.10.2036 ^	347	212	0,01	
4,375 % fällig am 15.07.2030	\$ 2.500	2.167	0,07		8,375 % fällig am 01.06.2031	9.100	9.187	0,30		HarborView Mortgage Loan Trust 5,417 % fällig am 19.03.2037	76	68	0,00	
4,750 % fällig am 15.01.2028	5.000	4.661	0,15		ViaSat, Inc. 5,625 % fällig am 15.09.2025	3.000	2.910	0,10		Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 4,609 % fällig am 25.02.2036 ^	86	74	0,00	
Station Casinos LLC 4,500 % fällig am 15.02.2028	3.000	2.696	0,09		5,625 % fällig am 15.04.2027	825	771	0,03		Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 4,816 % fällig am 25.05.2047 ^	28	4	0,00	
Suburban Propane Partners LP 5,000 % fällig am 01.06.2031	5.000	4.193	0,14		6,500 % fällig am 15.07.2028	3.000	2.545	0,08		4,946 % fällig am 25.05.2046 ^	70	57	0,00	
Summer BC Bidco LLC 5,500 % fällig am 31.10.2026	5.000	4.213	0,14		White Cap Buyer LLC 6,875 % fällig am 15.11.2028	9.000	8.117	0,26				1.106	0,03	
Syneos Health, Inc. 3,625 % fällig am 15.01.2029	5.000	4.894	0,16		White Cap Parent (8,250 % bar oder 9,000 % PIK) 8,250 % fällig am 15.03.2026 (b)	3.000	2.877	0,09		<b>US-SCHATZOBIGLATIONEN</b>				
Tallgrass Energy Partners LP 5,500 % fällig am 15.01.2028	5.000	4.577	0,15		WMG Acquisition Corp. 2,250 % fällig am 15.08.2031	€ 3.500	3.041	0,10		U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025	30.000	29.194	0,95	
6,000 % fällig am 31.12.2030	1.000	882	0,03		3,875 % fällig am 15.07.2030	\$ 5.000	4.318	0,14		3,875 % fällig am 30.11.2027	35.700	35.200	1,15	
7,500 % fällig am 01.10.2025	2.000	1.998	0,07		WR Grace Holdings LLC 4,875 % fällig am 15.06.2027	5.000	4.643	0,15		4,125 % fällig am 31.10.2027	50.000	49.748	1,62	
Team Health Holdings, Inc. 6,375 % fällig am 01.02.2025	7.000	3.723	0,12		5,625 % fällig am 15.08.2029	3.000	2.461	0,08		4,250 % fällig am 15.10.2025	58.000	57.361	1,87	
TEGNA, Inc. 4,625 % fällig am 15.03.2028	3.000	2.659	0,09		WW International, Inc. 4,500 % fällig am 15.04.2029	2.000	1.184	0,04				171.503	5,59	
4,750 % fällig am 15.03.2026	2.000	1.912	0,06		Wyndham Hotels & Resorts, Inc. 4,375 % fällig am 15.08.2028	5.000	4.571	0,15		Summe USA		1.786.155	58,18	
5,000 % fällig am 15.09.2029	5.000	4.318	0,14		Wynn Las Vegas LLC 5,250 % fällig am 15.05.2027	5.000	4.742	0,15		<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				
Tenet Healthcare Corp. 4,375 % fällig am 15.01.2030	6.750	6.098	0,20		5,500 % fällig am 01.03.2025	2.000	1.970	0,06		<b>U.S. TREASURY BILLS</b>				
4,625 % fällig am 15.06.2028	5.000	4.675	0,15		Wynn Resorts Finance LLC 7,125 % fällig am 15.02.2031	2.500	2.487	0,08		5,150 % fällig am 03.08.2023 (c)(d)(j)	78.000	77.657	2,53	
4,875 % fällig am 01.01.2026	2.000	1.950	0,06		XPO, Inc. 7,125 % fällig am 01.06.2031	100	101	0,00		Summe kurzfristige Instrumente		77.657	2,53	
5,125 % fällig am 01.11.2027	5.000	4.779	0,16		Yum! Brands, Inc. 3,625 % fällig am 15.03.2031	5.000	4.324	0,14		Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	2.913.163	94,90	
6,125 % fällig am 01.10.2028	10.000	9.637	0,31		4,625 % fällig am 31.01.2032	1.000	905	0,03		<b>AKTIEN</b>				
6,125 % fällig am 15.06.2030	5.000	4.935	0,16		6,875 % fällig am 15.11.2037	2.000	2.161	0,07		<b>INVESTMENTFONDS</b>				
TerraForm Power Operating LLC 4,750 % fällig am 15.01.2030	1.500	1.325	0,04		Zayo Group Holdings, Inc. 4,000 % fällig am 01.03.2027	3.000	2.122	0,07		<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				
5,000 % fällig am 31.01.2028	6.500	5.991	0,20		ZF North America Capital, Inc. 6,875 % fällig am 14.04.2028	1.000	1.014	0,03		PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)	1.219.084	11.081	0,36	
TransDigm, Inc. 4,625 % fällig am 15.01.2029	8.000	7.126	0,23		7,125 % fällig am 14.04.2030	1.000	1.018	0,03		PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (f)	3.637.652	41.195	1,34	
5,500 % fällig am 15.11.2027	8.000	7.555	0,25							PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	7.889.225	78.561	2,56	
6,250 % fällig am 15.03.2026	6.000	5.976	0,20							Summe Investmentfonds	\$	130.837	4,26	
6,750 % fällig am 15.08.2028	2.000	2.010	0,07											
Travel + Leisure Co. 4,625 % fällig am 01.03.2030	5.000	4.236	0,14											
6,625 % fällig am 31.07.2026	4.000	3.973	0,13											
TriNet Group, Inc. 3,500 % fällig am 01.03.2029	5.000	4.352	0,14											
Triumph Group, Inc. 9,000 % fällig am 15.03.2028	5.125	5.239	0,17											
Twilio, Inc. 3,625 % fällig am 15.03.2029	4.000	3.407	0,11											
3,875 % fällig am 15.03.2031	3.000	2.501	0,08											
U.S. Foods, Inc. 4,625 % fällig am 01.06.2030	2.250	2.019	0,07											
4,750 % fällig am 15.02.2029	7.000	6.416	0,21											
6,250 % fällig am 15.04.2025	5.000	5.002	0,16											

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 3.895	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (3.973)	\$ 3.895	\$ 3.895	0,13
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (3.973)	\$ 3.895	\$ 3.895	0,13

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	1.726	\$ 2.312	0,08
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	816	(1.112)	(0,04)
				\$ 1.200	0,04
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 1.200	0,04

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Newell Brands, Inc.	1,000 %	20.06.2028	\$ 2.400	\$ 20	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000 %	20.06.2028	\$ 22.200	\$ 720	0,02
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ 740	0,02

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
JLN	Cellnex Telecom S.A.	5,000 %	20.06.2028	€ 200	\$ 30	\$ 2	\$ 32	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 4.885	\$ 5.292	\$ 2	\$ (39)	\$ (37)	0,00
BPS	07.2023	767.233	824.859	2	(12.196)	(12.194)	(0,40)
	07.2023	\$ 3.569	€ 3.267	0	(5)	(5)	0,00
CBK	07.2023	€ 8.759	\$ 9.468	8	(96)	(88)	0,00
	07.2023	\$ 5.166	€ 4.770	38	0	38	0,00
	08.2023	CAD 861	\$ 646	0	(5)	(5)	0,00
JPM	07.2023	£ 145	184	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 835.611	€ 765.282	0	(688)	(688)	(0,02)
	08.2023	CAD 1.416	\$ 1.059	0	(12)	(12)	0,00
	08.2023	€ 765.282	836.780	715	0	715	0,02
	08.2023	\$ 184	£ 145	1	0	1	0,00
MBC	07.2023	€ 7.738	\$ 8.414	24	(52)	(28)	0,00
	07.2023	£ 47.813	59.186	0	(1.601)	(1.601)	(0,05)
	07.2023	\$ 11.435	€ 10.595	124	0	124	0,00
MYI	07.2023	€ 58	\$ 63	0	0	0	0,00
	07.2023	£ 396	498	0	(6)	(6)	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	\$ 2.624	€ 2.451	\$ 50	\$ 0	\$ 50	0,00
	07.2023	\$ 5.438	€ 4.309	41	0	41	0,00
TOR	07.2023	60.934	£ 47.953	31	0	31	0,00
	08.2023	£ 47.953	\$ 60.948	0	(30)	(30)	0,00
				\$ 1.036	\$ (14.731)	\$ (13.695)	(0,45)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF 8.275	\$ 9.253	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07.2023	\$ 12.169	CHF 11.009	136	0	136	0,01
	08.2023	9.253	8.252	0	(3)	(3)	0,00
CLY	07.2023	CHF 4.374	\$ 4.869	0	(20)	(20)	0,00
	08.2023	\$ 4.869	CHF 4.361	20	0	20	0,00
MBC	07.2023	CHF 358	\$ 399	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 116	CHF 105	2	0	2	0,00
MYI	07.2023	CHF 93	\$ 103	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 33	CHF 30	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	8.935	8.028	39	0	39	0,00
UAG	07.2023	CHF 8.544	\$ 9.531	0	(19)	(19)	0,00
	07.2023	\$ 8.052	CHF 7.235	35	0	35	0,00
	08.2023	9.531	8.520	19	0	19	0,00
				\$ 254	\$ (45)	\$ 209	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 437	\$ 473	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	07.2023	\$ 392.875	€ 365.549	5.943	(2)	5.941	0,19
BPS	07.2023	€ 377.818	\$ 414.037	1.840	(3)	1.837	0,06
	07.2023	\$ 393.164	€ 365.704	5.821	(2)	5.819	0,19
	08.2023	397.293	362.084	0	(1.719)	(1.719)	(0,05)
CBK	07.2023	€ 364.241	\$ 395.945	2	(1.444)	(1.442)	(0,05)
	07.2023	\$ 293	€ 270	2	0	2	0,00
	08.2023	389.917	358.138	1.347	0	1.347	0,04
JPM	07.2023	€ 362.629	\$ 395.955	326	0	326	0,01
	07.2023	\$ 9.812	€ 9.177	200	0	200	0,01
	08.2023	396.508	362.629	0	(338)	(338)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 1.676	\$ 1.796	1	(33)	(32)	0,00
	07.2023	\$ 2.211	€ 2.060	37	0	37	0,00
SOG	07.2023	391.584	364.014	5.555	0	5.555	0,18
				\$ 21.074	\$ (3.545)	\$ 17.529	0,57

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und E Class GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 895	\$ 1.127	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	0,00
	07.2023	\$ 671	£ 528	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	£ 49	\$ 61	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 135.368	£ 109.441	3.771	0	3.771	0,12
BRC	07.2023	£ 787	\$ 980	0	(21)	(21)	0,00
	07.2023	\$ 3.592	£ 2.822	0	(4)	(4)	0,00
CBK	07.2023	£ 7.257	\$ 9.202	4	(29)	(25)	0,00
	07.2023	\$ 594	£ 467	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2023	£ 107.650	\$ 136.113	0	(748)	(748)	(0,02)
	08.2023	\$ 136.142	£ 107.650	747	0	747	0,02
MBC	07.2023	£ 135.292	\$ 109.288	3.651	0	3.651	0,12
MYI	07.2023	£ 363	\$ 450	0	(12)	(12)	0,00
	07.2023	\$ 135.000	£ 108.620	3.095	0	3.095	0,10
SCX	07.2023	£ 244	\$ 304	0	(7)	(7)	0,00
TOR	07.2023	£ 108.645	\$ 138.055	0	(71)	(71)	0,00
	08.2023	\$ 138.085	£ 108.645	68	0	68	0,00
				\$ 11.336	\$ (905)	\$ 10.431	0,34

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$ 1.662	SGD 2.249	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	07.2023	SGD 29	\$ 22	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 119	SGD 160	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	SGD 16	\$ 12	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 1.519	SGD 2.052	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	13	18	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD 2.426	\$ 1.795	3	0	3	0,00
	07.2023	\$ 1	SGD 2	0	0	0	0,00
	08.2023	1.758	2.373	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2023	201	272	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	2.031	2.748	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 3	\$ (7)	\$ (4)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 14.502 0,47

Summe Anlagen

\$ 3.064.337 99,82

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 5.499 0,18

Nettovermögen

\$ 3.069.836 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.  
 (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.  
 (c) Nullkuponwertpapier.  
 (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
 (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
 (f) Mit dem Fonds verbunden.  
 (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,00 %):

Emitentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % bar oder 9,000 % PIK)	9,000 %	22.04.2027	12.05.2021	\$ 66	\$ 64	0,00

(i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 11.629 USD (31. Dezember 2022: 10.952 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

(j) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 49 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von 2.600 USD (31. Dezember 2022: 8.590 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 12.259 USD (31. Dezember 2022: 20.021 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 205 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.912.555	\$ 608	\$ 2.913.163
Investmentfonds	130.837	0	0	130.837
Pensionsgeschäfte	0	3.895	0	3.895
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2.312	14.130	0	16.442
Summen	\$ 133.149	\$ 2.930.580	\$ 608	\$ 3.064.337

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.850.743	\$ 43	\$ 2.850.786
Investmentfonds	201.583	0	0	201.583
Pensionsgeschäfte	0	11.412	0	11.412
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	933	15.128	0	16.061
Summen	\$ 202.516	\$ 2.877.283	\$ 43	\$ 3.079.842

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BRC	2,000 %	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.749)	\$ (1.913)	(0,06)
JML	2,500	06.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(2.528)	(2.762)	(0,09)
	2,500	08.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(2.124)	(2.321)	(0,08)
	2,500	12.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(1.273)	(1.390)	(0,05)
MYI	2,200	31.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(2.025)	(2.213)	(0,07)
	2,500	17.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(1.266)	(1.386)	(0,04)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (11.985)</b>	<b>(0,39)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 5.890	\$ (4.505)	\$ 1.385	\$ 1.580	\$ (1.340)	\$ 240
BPS	(2.357)	2.600	243	33	0	33
BRC	(25)	0	(25)	9	0	9
CBK	(174)	0	(174)	11.688	(11.530)	158
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	3	(10)	(7)
JLN	32	0	32	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	202	(270)	(68)	(416)	50	(366)
MBC	2.148	(1.630)	518	8.000	(7.460)	540
MYI	3.167	(2.240)	927	(51)	0	(51)
SCX	32	0	32	(9.114)	8.540	(574)
SOG	5.555	(4.100)	1.455	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(2)	0	(2)	100	(180)	(80)
UAG	34	49	83	5	0	5

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	50,99	49,58
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	43,90	42,29
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	0,01
Investmentfonds	4,26	6,50
Pensionsgeschäfte	0,13	0,37
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,02	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate	0,47	0,38
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,39)	(0,34)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Belgien	0,24	0,22
Bermudas	0,66	0,40
Kanada	1,62	1,55
Cayman-Inseln	0,62	0,78
Tschechische Republik	0,71	k. A.
Dänemark	k. A.	0,09
Frankreich	3,11	1,95
Deutschland	3,40	2,67
Irland	0,24	0,22
Italien	4,20	3,75
Jersey, Kanalinseln	0,12	0,20
Liberia	1,06	0,67
Luxemburg	3,27	2,47
Multinational	2,03	1,67
Niederlande	4,64	5,00
Norwegen	0,33	0,34
Panama	0,66	0,53
Spanien	2,21	1,70
Schweden	0,89	0,91

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Schweiz	k. A.	0,11
Großbritannien	4,18	3,84
USA	58,18	59,77
Kurzfristige Instrumente	2,53	3,04
Investmentfonds	4,26	6,50
Pensionsgeschäfte	0,13	0,37
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,04	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,02	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,45)	(0,64)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,92	1,02
Sonstige Aktiva und Passiva	0,18	0,74
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>					<b>BRASILIEN</b>					<b>CHINA</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Boral Finance Pty. Ltd. 3,750 % fällig am 14.12.2028	\$	415	\$	371	0,00	Viking Cruises Ltd. 13,000 % fällig am 15.05.2025	4.300	4.518	0,04	Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	14.256	12.035	0,12	
CIMIC Finance Ltd. 1,500 % fällig am 28.05.2029	€	4.300	3.688	0,04	Summe Bermudas		59.532	0,57		2,875 % fällig am 15.02.2025	8.300	7.723	0,07	
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd. 1,900 % fällig am 14.12.2028	AUD	23.500	12.697	0,12						4,250 % fällig am 15.04.2026	3.600	3.356	0,03	
GTA Finance Co. Pty. Ltd. 2,200 % fällig am 26.08.2027		7.200	4.123	0,04						4,375 % fällig am 01.05.2026	2.310	2.160	0,02	
Lendlease Finance Ltd. 3,400 % fällig am 27.10.2027		9.900	5.786	0,06						5,500 % fällig am 15.01.2026	18.600	18.032	0,17	
Macquarie University 3,500 % fällig am 07.09.2028		250	153	0,00						China Modern Dairy Holdings Ltd. 2,125 % fällig am 14.07.2026	9.400	8.054	0,08	
Network Finance Co. Pty. Ltd. 6,061 % fällig am 19.06.2030		700	467	0,00						Gaci First Investment Co. 4,750 % fällig am 14.02.2030	2.600	2.562	0,03	
Optus Finance Pty. Ltd. 1,000 % fällig am 20.06.2029	€	6.800	6.098	0,06						4,875 % fällig am 14.02.2035	1.900	1.824	0,02	
Pacific National Finance Pty. Ltd. 4,750 % fällig am 22.03.2028	\$	15.900	14.459	0,14						5,125 % fällig am 14.02.2053	13.000	11.716	0,11	
Qantas Airways Ltd. 3,150 % fällig am 27.09.2028	AUD	500	288	0,00						Goodman HK Finance 4,375 % fällig am 19.06.2024	3.500	3.437	0,03	
Santos Finance Ltd. 4,125 % fällig am 14.09.2027	\$	7.800	7.194	0,07						Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	16.760	15.984	0,15	
Woodside Finance Ltd. 3,700 % fällig am 15.03.2028		600	553	0,01						5,250 % fällig am 26.04.2026	3.650	3.382	0,03	
4,500 % fällig am 04.03.2029		26.390	24.904	0,24						5,375 % fällig am 04.12.2029	3.027	2.515	0,02	
			101.111	0,97						5,625 % fällig am 17.07.2027	8.655	7.849	0,08	
										5,750 % fällig am 21.07.2028	2.100	1.859	0,02	
										MGM China Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 18.06.2025	8.300	7.966	0,08	
										5,375 % fällig am 15.05.2024	1.255	1.237	0,01	
										5,875 % fällig am 15.05.2026	6.746	6.434	0,06	
										Sands China Ltd. 2,800 % fällig am 08.03.2027	1.000	869	0,01	
										3,350 % fällig am 08.03.2029	1.500	1.251	0,01	
										4,300 % fällig am 08.01.2026	3.900	3.670	0,04	
										5,900 % fällig am 08.08.2028	14.348	13.690	0,13	
										Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 5,950 % fällig am 17.07.2026	10.700	10.684	0,10	
										Tencent Holdings Ltd. 2,390 % fällig am 03.06.2030	11.900	9.893	0,10	
										3,240 % fällig am 03.06.2050	5.200	3.416	0,03	
										3,290 % fällig am 03.06.2060	700	435	0,00	
										3,975 % fällig am 11.04.2029	32.750	30.464	0,29	
										Tencent Music Entertainment Group 2,000 % fällig am 03.09.2030	2.800	2.212	0,02	
										Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1,625 % fällig am 24.09.2025	11.500	10.466	0,10	
										Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024	4.635	4.524	0,04	
										5,500 % fällig am 15.01.2026	8.757	8.144	0,08	
										5,500 % fällig am 01.10.2027	2.000	1.782	0,02	
										Xiaomi Best Time International Ltd. 2,875 % fällig am 14.07.2031	1.900	1.437	0,01	
										Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % fällig am 13.01.2026	7.100	6.476	0,06	
												237.314	2,26	
										Summe Cayman Inseln		254.339	2,42	
										<b>CHILE</b>				
										<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
										Celeo Redes Operacion Chile S.A. 5,200 % fällig am 22.06.2047	1.515	1.369	0,01	
										Empresa Electrica Cochran SpA 5,500 % fällig am 14.05.2027	961	889	0,01	
										Summe Chile		2.258	0,02	
										<b>CHINA</b>				
										<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
										State Grid Overseas Investment BVI Ltd. 0,797 % fällig am 05.08.2026	€	12.223	12.100	0,11
										2,125 % fällig am 02.05.2030	5.400	5.127	0,05	
										Summe China		17.227	0,16	
										<b>KOLUMBIEN</b>				
										<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
										Ecopetrol S.A. 8,875 % fällig am 13.01.2033	\$	8.000	7.929	0,08
										<b>ZYPERN</b>				
										<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
										Atrium Finance PLC 2,625 % fällig am 05.09.2027	€	12.100	9.625	0,09



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 1.600	\$ 1.493	0,01	Aroundtown S.A. 3,000 % fällig am 16.10.2029	£ 1.300	\$ 1.046	0,01	29.06.2027 (g)(i) 4,655 % fällig am 22.08.2028	\$ 6.800	6.514	0,06
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % fällig am 09.10.2025	2.800	2.906	0,03	5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 16.400	12.152	0,12	CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	€ 9.400	9.144	0,09
UniCredit SpA 7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 62.000	62.373	0,59	Becton Dickinson Euro Finance SARL 0,334 % fällig am 13.08.2028	€ 4.500	4.128	0,04	1,250 % fällig am 21.06.2029	12.800	10.145	0,10
		180.178	1,72	1,336 % fällig am 13.08.2041	5.180	3.617	0,03	Digital Dutch Finco BV 1,000 % fällig am 15.01.2032	2.600	2.006	0,02
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	10.500	6.246	0,06	1,250 % fällig am 01.02.2031	12.400	10.114	0,10
Italy Government International Bond 6,875 % fällig am 27.09.2023	10.700	10.723	0,10	1,750 % fällig am 14.01.2030	10.900	7.218	0,07	EnBW International Finance BV 3,500 % fällig am 24.07.2028	5.000	5.360	0,05
Summe Italien		190.901	1,82	Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	19.575	18.432	0,17	4,000 % fällig am 24.01.2035	7.300	7.795	0,07
<b>JAPAN</b>				Helvetia Europe S.A. 2,750 % fällig am 30.09.2041	4.700	4.084	0,04	Enel Finance International NV 1,875 % fällig am 12.07.2028	\$ 600	504	0,00
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Logicor Financing SARL 1,625 % fällig am 15.07.2027	23.950	21.721	0,21	5,500 % fällig am 15.06.2052	5.000	4.520	0,04
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,953 % fällig am 19.07.2025	14.400	13.610	0,13	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^	\$ 61.150	3.669	0,03	IMCD NV 2,500 % fällig am 26.03.2025	€ 4.700	4.965	0,05
1,538 % fällig am 20.07.2027	9.500	8.390	0,08	5,250 % fällig am 23.05.2023	12.200	732	0,01	ING Groep NV 4,875 % fällig am			
2,048 % fällig am 17.07.2030	15.400	12.499	0,12	(^)				16.05.2029 (g)(i)	\$ 21.300	16.554	0,16
3,195 % fällig am 18.07.2029	5.600	4.952	0,05	TMS Issuer SARL 5,780 % fällig am 23.08.2032	7.000	7.222	0,07	5,750 % fällig am			
3,273 % fällig am 19.09.2025	€ 3.100	3.332	0,03			91.360	0,87	16.11.2026 (g)(i)	10.000	8.840	0,08
5,422 % fällig am 22.02.2029	\$ 2.700	2.687	0,03	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				6,250 % fällig am 20.05.2033	£ 5.200	6.133	0,06
5,475 % fällig am 22.02.2031	4.400	4.380	0,04	Delos Finance SARL 7,288 % fällig am 06.10.2023	18.243	18.254	0,17	JAB Holdings BV 1,000 % fällig am 20.12.2027	€ 5.000	4.759	0,05
Mizuho Financial Group, Inc. 1,979 % fällig am 08.09.2031	7.100	5.615	0,05	Summe Luxemburg		109.614	1,04	2,200 % fällig am 23.11.2030	\$ 20.150	15.863	0,15
2,201 % fällig am 10.07.2031	9.100	7.293	0,07	<b>MAURITIUS</b>				2,250 % fällig am 19.12.2039	€ 4.800	3.716	0,04
4,416 % fällig am 20.05.2033	€ 5.000	5.464	0,05	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,000 % fällig am 12.06.2033	3.600	3.991	0,04
5,739 % fällig am 27.05.2031	\$ 800	799	0,01	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026	300	282	0,00	LeasePlan Corp. NV 0,125 % fällig am 13.09.2023	6.340	6.865	0,07
Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	€ 16.640	18.076	0,17	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	9.900	9.681	0,09	2,875 % fällig am 24.10.2024	\$ 1.020	972	0,01
3,201 % fällig am 17.09.2028	4.700	4.607	0,04	Summe Mauritius		9.963	0,09	7,375 % fällig am			
4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 14.220	12.943	0,12	<b>MEXIKO</b>				29.05.2024 (g)(i)	€ 1.000	1.073	0,01
4,810 % fällig am 17.09.2030	6.550	5.750	0,06	<b>STAMMAKTIVEN</b>				NE Property BV 1,875 % fällig am 09.10.2026	3.500	3.316	0,03
Nomura Holdings, Inc. 1,851 % fällig am 16.07.2025	15.950	14.595	0,14	Desarrolladora Homex S.A.B. de C.V. (d)	427.064	0	0,00	2,000 % fällig am 20.01.2030	7.000	5.651	0,05
2,172 % fällig am 14.07.2028	5.000	4.223	0,04	<b>AKTIEN</b>				3,375 % fällig am 14.07.2027	9.300	9.118	0,09
2,679 % fällig am 16.07.2030	1.800	1.474	0,01	<b>PAR (000S)</b>				NN Group NV 4,625 % fällig am 13.01.2048	2.000	2.109	0,02
2,710 % fällig am 22.01.2029	9.800	8.270	0,08	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Prosus NV 1,539 % fällig am 03.08.2028	3.700	3.328	0,03
3,103 % fällig am 16.01.2030	4.500	3.840	0,04	Banco Mercantil del Norte S.A. 6,625 % fällig am 24.01.2032				2,031 % fällig am 03.08.2032	25.780	20.035	0,19
5,842 % fällig am 18.01.2028	9.500	9.527	0,09	(g)(i)	\$ 9.600	7.430	0,07	4,027 % fällig am 03.08.2050	\$ 3.800	2.390	0,02
6,181 % fällig am 18.01.2033	8.000	8.262	0,08	Petroleos Mexicanos 2,750 % fällig am 21.04.2027	€ 200	174	0,00	4,193 % fällig am 19.01.2032	3.800	3.202	0,03
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2,440 % fällig am 18.06.2024	11.500	11.116	0,11	3,750 % fällig am 21.02.2024	100	108	0,00	Sagax Euro MTN NL BV 0,750 % fällig am 26.01.2028	€ 6.100	5.049	0,05
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,130 % fällig am 08.07.2030	3.500	2.852	0,03	4,875 % fällig am 21.02.2028	500	453	0,00	1,625 % fällig am 24.02.2026	5.900	5.766	0,05
2,696 % fällig am 16.07.2024	4.700	4.549	0,04	10,000 % fällig am 07.02.2033	\$ 8.100	7.427	0,07	Siemens Energy Finance BV 4,250 % fällig am 05.04.2029	1.800	1.913	0,02
2,750 % fällig am 15.01.2030	2.600	2.245	0,02	Trust Fibra Uno 4,869 % fällig am 15.01.2030	1.900	1.680	0,02	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	7.100	7.438	0,07
5,464 % fällig am 13.01.2026	6.000	5.983	0,06	Summe Mexiko		17.272	0,16	4,892 % fällig am 24.04.2025	\$ 6.784	6.645	0,06
5,520 % fällig am 13.01.2028	5.000	5.024	0,05	<b>NIEDERLANDE</b>				Volkswagen Financial Services NV 0,875 % fällig am 20.02.2025	€ 7.000	8.105	0,08
5,710 % fällig am 13.01.2030	10.000	10.130	0,10	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				1,125 % fällig am 18.09.2023	13.700	17.244	0,16
5,766 % fällig am 13.01.2033	4.500	4.633	0,04	ABN AMRO Bank NV 4,375 % fällig am 22.09.2025	€ 9.700	9.557	0,09	1,875 % fällig am 03.12.2024	1.800	2.140	0,02
6,439 % fällig am 13.01.2026	1.400	1.412	0,01	(g)(i)				Vonovia Finance BV 0,500 % fällig am 14.09.2029	€ 500	409	0,00
Suntory Holdings Ltd. 2,250 % fällig am 16.10.2024	900	855	0,01	Arcadis NV 4,875 % fällig am 28.02.2028	7.000	7.638	0,07	1,125 % fällig am 14.09.2034	1.000	712	0,01
Summe Japan		209.387	2,00	ASR Nederland NV 3,375 % fällig am 02.05.2049	4.300	4.082	0,04	WPC Eurobond BV 1,350 % fällig am 15.04.2028	5.400	5.010	0,05
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				7,000 % fällig am 07.12.2043	2.700	3.071	0,03			290.606	2,77
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				BAT Netherlands Finance BV 5,375 % fällig am 16.02.2031	5.300	5.780	0,06	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
AA Bond Co. Ltd. 5,500 % fällig am 31.07.2050	£ 7.782	8.631	0,08	BP Capital Markets BV 4,323 % fällig am 12.05.2035	2.500	2.726	0,03	EMF-NL Prime BV 3,977 % fällig am 17.04.2041	395	411	0,01
G City Europe Ltd. 4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 24.900	23.768	0,23	Cooperative Rabobank UA 4,375 % fällig am	€ 19.200	\$ 18.339	0,17	Eurosail BV 4,677 % fällig am 17.10.2040	129	141	0,00
Gatwick Funding Ltd. 2,500 % fällig am 15.04.2032	€ 300	304	0,00	<b>NORWEGEN</b>						552	0,01
2,625 % fällig am 07.10.2048	1.200	874	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				BNG Bank NV 2,375 % fällig am 16.03.2026	\$ 9.300	8.741	0,08
3,125 % fällig am 28.09.2041	1.600	1.377	0,01	Althea Financing S.A. 4,250 % fällig am 15.08.2029	€ 1.300	1.093	0,01	Summe Niederlande		299.899	2,86
Heathrow Funding Ltd. 1,875 % fällig am 12.07.2032	€ 3.800	3.483	0,04	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
2,750 % fällig am 13.10.2031	€ 1.300	1.351	0,01	BAT Netherlands Finance BV 5,375 % fällig am 16.02.2031	5.300	5.780	0,06				
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig am 05.11.2031	8.867	11.329	0,11	Summe Jersey, Kanalinseln		51.117	0,49				
Summe Jersey, Kanalinseln		51.117	0,49	<b>LUXEMBURG</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
Althea Financing S.A. 4,250 % fällig am 15.08.2029	€ 1.300	1.093	0,01								

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
<b>Yara International ASA</b>	\$	15.300	14.548	0,14
4,750 % fällig am 01.06.2028				
Summe Norwegen			19.851	0,19
<b>PERU</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Banco de Credito del Peru S.A.</b>	PEN	9.800	2.592	0,03
4,650 % fällig am 17.09.2024				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>Peru Government International Bond</b>		23.400	6.550	0,06
6,350 % fällig am 12.08.2028				
7,300 % fällig am 12.08.2033		213	61	0,00
			6.611	0,06
Summe Peru			9.203	0,09
<b>POLEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>Poland Government International Bond</b>	€	7.400	8.020	0,08
3,875 % fällig am 14.02.2033				
4,250 % fällig am 14.02.2043		2.300	2.469	0,02
Summe Polen			10.489	0,10
<b>KATAR</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>Qatar Government International Bond</b>	\$	11.300	10.303	0,10
4,400 % fällig am 16.04.2050				
<b>RUMÄNIEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>Romania Government International Bond</b>	€	3.425	2.905	0,03
1,375 % fällig am 02.12.2029				
1,750 % fällig am 13.07.2030		7.650	6.381	0,06
2,125 % fällig am 07.03.2028		7.200	6.834	0,07
2,625 % fällig am 02.12.2040		22.600	15.055	0,14
2,875 % fällig am 13.04.2042		8.200	5.513	0,05
Summe Rumänien			36.688	0,35
<b>RUSSLAND</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>MMK International Capital DAC</b>	\$	4.900	294	0,00
4,375 % fällig am 13.06.2024 ^				
<b>SAUDI-ARABIEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>Saudi Arabia Government International Bond</b>		20.200	16.298	0,16
2,250 % fällig am 02.02.2033				
4,750 % fällig am 18.01.2028		52.000	51.620	0,49
4,875 % fällig am 18.07.2033		25.000	25.005	0,24
5,000 % fällig am 18.01.2053		6.000	5.567	0,05
Summe Saudi-Arabien			98.490	0,94
<b>SINGAPUR</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.</b>		13.500	12.315	0,12
1,832 % fällig am 10.09.2030 (i)				
<b>Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.</b>		5.000	4.983	0,05
4,750 % fällig am 19.05.2033				
5,110 % fällig am 19.05.2043		18.100	18.153	0,17
<b>SP PowerAssets Ltd.</b>		2.400	2.237	0,02
3,000 % fällig am 26.09.2027				
<b>United Overseas Bank Ltd.</b>		3.500	3.116	0,03
1,750 % fällig am 16.03.2031 (i)				
Summe Singapur			40.804	0,39
<b>SLOWAKEI</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>Slovakia Government International Bond</b>	€	500	436	0,00
1,875 % fällig am 09.03.2037				
<b>SLOWENIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Nova Kreditna Banka Maribor d.d.</b>		10.700	11.292	0,11
1,875 % fällig am 27.01.2025				

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
<b>SÜDAFRIKA</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>AngloGold Ashanti Holdings PLC</b>	\$	5.500	4.823	0,05
3,375 % fällig am 01.11.2028				
3,750 % fällig am 01.10.2030	7.800	6.701	0,06	
			11.524	0,11
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>South Africa Government International Bond</b>	ZAR	1.231.200	67.685	0,64
10,500 % fällig am 21.12.2026				
Summe Südafrika			79.209	0,75
<b>SÜDKOREA</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Shinhan Bank Co. Ltd.</b>	AUD	7.200	4.359	0,04
1,183 % fällig am 29.09.2025				
<b>Shinhan Financial Group Co. Ltd.</b>	\$	3.000	2.873	0,03
3,340 % fällig am 05.02.2030 (i)				
Summe Südkorea			7.232	0,07
<b>SPANIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b>	€	3.200	3.463	0,03
5,875 % fällig am 24.09.2023 (g)(i)				
<b>CaixaBank S.A.</b>		5.400	4.020	0,04
3,625 % fällig am 14.09.2028 (g)(i)				
<b>Werfen S.A.</b>		11.100	11.959	0,12
4,625 % fällig am 06.06.2028				
Summe Spanien			19.442	0,19
<b>ÜBERNATIONAL</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung</b>	\$	5.200	4.910	0,05
1,500 % fällig am 13.02.2025				
1,625 % fällig am 27.09.2024		500	478	0,01
<b>Europäische Investitionsbank</b>	€	15.350	18.242	0,17
0,750 % fällig am 15.11.2024				
Summe Supranational			23.630	0,23
<b>SCHWEDEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Castellum AB</b>	€	4.300	4.621	0,04
2,125 % fällig am 20.11.2023				
<b>Fastighets AB Balder</b>		4.500	3.702	0,04
1,125 % fällig am 29.01.2027				
<b>Sagax AB</b>		4.200	3.867	0,04
1,125 % fällig am 30.01.2027				
2,250 % fällig am 13.03.2025		8.400	8.659	0,08
Summe Schweden			20.849	0,20
<b>SCHWEIZ</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Credit Suisse AG</b>	\$	95.950	95.601	0,91
6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)				
<b>UBS Group AG</b>		5.000	4.298	0,04
1,494 % fällig am 10.08.2027				
2,593 % fällig am 11.09.2025		18.030	17.193	0,17
3,126 % fällig am 13.08.2030		400	337	0,00
4,125 % fällig am 24.09.2025		58.990	56.395	0,54
4,177 % fällig am 16.01.2026	€	3.550	3.814	0,04
4,750 % fällig am 17.03.2032		12.900	14.034	0,13
Summe Schweiz			191.672	1,83
<b>THAILAND</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Bangkok Bank PCL</b>	\$	9.200	7.507	0,07
3,466 % fällig am 23.09.2036 (i)				

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
<b>TURKEI</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Turkish Airlines Pass-Through Trust</b>	\$	4.094	3.772	0,04
4,200 % fällig am 15.09.2028				
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>DAE Sukuk Dfc Ltd.</b>		8.600	8.184	0,08
3,750 % fällig am 15.02.2026				
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Barclays PLC</b>		8.000	6.422	0,06
2,645 % fällig am 24.06.2031				
4,375 % fällig am 12.01.2026		9.860	9.477	0,09
5,501 % fällig am 09.08.2028		7.550	7.369	0,07
6,224 % fällig am 09.05.2034		5.900	5.880	0,06
7,750 % fällig am 15.09.2023 (g)(i)		700	688	0,01
8,000 % fällig am 15.06.2024 (g)(i)		4.300	4.074	0,04
<b>BAT International Finance PLC</b>		5.990	5.388	0,05
1,668 % fällig am 25.03.2026				
2,250 % fällig am 26.06.2028	£	8.100	8.232	0,08
<b>BP Capital Markets PLC</b>		1.200	1.505	0,01
5,773 % fällig am 25.05.2038				
<b>Broadgate Financing PLC</b>		49	59	0,00
4,851 % fällig am 05.04.2033				
<b>Cadent Finance PLC</b>		300	246	0,00
2,625 % fällig am 22.09.2038				
2,750 % fällig am 22.09.2046		3.200	2.368	0,02
<b>Chanel Ceres PLC</b>	€	11.800	11.477	0,11
0,500 % fällig am 31.07.2026				
1,000 % fällig am 31.07.2031		6.800	5.925	0,06
<b>Connect Plus M25 Issuer PLC</b>	£	2.022	2.000	0,02
2,607 % fällig am 31.03.2039				
<b>Direct Line Insurance Group PLC</b>		1.200	1.104	0,01
4,000 % fällig am 05.06.2032				
<b>DWR Cymru Financing UK PLC</b>		31	44	0,00
3,514 % fällig am 31.03.2030				
<b>Ferguson Finance PLC</b>	\$	4.300	3.737	0,04
3,250 % fällig am 02.06.2030				
<b>Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC</b>		7.700	4.889	0,05
3,250 % fällig am 25.02.2030				
<b>Greene King Finance PLC</b>	£	900	864	0,01
0,000 % fällig am 15.03.2036				
4,064 % fällig am 15.03.2035		4.469	4.659	0,04
5,106 % fällig am 15.03.2034		89	100	0,00
5,318 % fällig am 15.09.2031		221	253	0,00
<b>HSBC Holdings PLC</b>		19.060	20.661	0,20
1,750 % fällig am 24.07.2027				
2,357 % fällig am 18.08.2031	\$	6.600	5.272	0,05
2,848 % fällig am 04.06.2031		8.500	7.058	0,07
3,973 % fällig am 22.05.2030		11.300	10.158	0,10
4,041 % fällig am 13.03.2028		17.400	16.309	0,16
4,292 % fällig am 12.09.2026		2.500	2.405	0,02
4,600 % fällig am 17.12.2030 (g)(i)		11.900	9.089	0,09
6,920 % fällig am 12.09.2026		526	530	0,01
<b>Imperial Brands Finance PLC</b>		1.300	1.256	0,01
3,125 % fällig am 26.07.2024				
3,500 % fällig am 26.07.2026		21.660	20.187	0,19
3,875 % fällig am 26.07.2029		11.840	10.446	0,10
<b>Informa PLC</b>	€	9.200	8.720	0,08
1,250 % fällig am 22.04.2028				
1,500 % fällig am 05.07.2023		7.818	8.529	0,08
2,125 % fällig am 06.10.2025		17.190	17.895	0,17
3,125 % fällig am 05.07.2026	£	100	114	0,00
<b>InterContinental Hotels Group PLC</b>	€	15.000	15.819	0,15
1,625 % fällig am 08.10.2024				
3,375 % fällig am 08.10.2028	£	7.800	8.423	0,08
<b>John Lewis PLC</b>		2.800	2.221	0,02
4,250 % fällig am 18.12.2034				
6,125 % fällig am 21.01.2025		2.050	2.511	0,02
<b>Lloyds Bank PLC</b>	\$	24.800	15.551	0,15
0,000 % fällig am 02.04.2032				
<b>Lloyds Banking Group PLC</b>	€	5.200	5.186	0,05
4,947 % fällig am 27.06.2025 (g)(i)				
<b>M&amp;G PLC</b>	£	500	550	0,01
6,340 % fällig am 19.12.2063				



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS		
<b>Market Bidco Finco PLC</b> 4,750 % fällig am 04.11.2027	€	11.500	\$10.132	0,10	<b>USA</b>			<b>Ally Financial, Inc.</b> 2,200 % fällig am 02.11.2028	\$	800	\$639	0,01	
<b>Marks &amp; Spencer PLC</b> 3,750 % fällig am 19.05.2026	£	100	115	0,00	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			6,992 % fällig am 13.06.2029		6.000	5.931	0,06	
<b>Mitchells &amp; Butlers Finance PLC</b> 5,451 % fällig am 15.12.2030 6,013 % fällig am 15.12.2030		583 418	687 478	0,01 0,00	<b>AASET Trust</b> 3,967 % fällig am 16.05.2042	\$	2.056	1.715	0,02	8,000 % fällig am 01.11.2031	12.285	12.731	0,12
<b>National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC</b> 3,530 % fällig am 20.09.2028	€	3.000	3.189	0,03	<b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b> 6,050 % fällig am 25.12.2034 6,095 % fällig am 25.05.2035	\$	1.000 1.900	\$896 1.694	0,01 0,02	<b>American Airlines Pass-Through Trust</b> 3,000 % fällig am 15.04.2030 3,150 % fällig am 15.08.2033	2.090 6.937	1.856 6.057	0,02 0,06
<b>National Grid PLC</b> 5,602 % fällig am 12.06.2028 5,809 % fällig am 12.06.2033	\$	1.400 21.500	1.407 21.893	0,01 0,21	<b>Aegis Asset-Backed Securities Trust</b> 5,320 % fällig am 25.01.2037		3.741	2.844	0,03	3,200 % fällig am 15.12.2029 3,250 % fällig am 15.04.2030	9.743 1.568	8.743 1.330	0,08 0,01
<b>Nationwiser Building Society</b> 5,875 % fällig am 20.12.2024 (g)(i)	£	8.150	9.689	0,09	<b>Ameriquist Mortgage Securities Trust</b> 5,735 % fällig am 25.03.2036		26	26	0,00	3,350 % fällig am 15.04.2031 3,375 % fällig am 01.11.2028	7.586 8.371	6.753 7.516	0,06 0,07
<b>NatWest Group PLC</b> 4,269 % fällig am 22.03.2025 4,800 % fällig am 05.04.2026 4,892 % fällig am 18.05.2029 5,076 % fällig am 27.01.2030 6,016 % fällig am 02.03.2034	\$	8.800 3.800 8.625 8.560 25.900	8.646 3.691 8.214 8.173 26.056	0,08 0,04 0,08 0,08 0,25	<b>Ameriquist Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b> 5,855 % fällig am 25.01.2036		956	951	0,01	3,500 % fällig am 15.08.2033 3,575 % fällig am 15.07.2029	11.513 2.003	9.405 1.858	0,09 0,02
<b>Northumbrian Water Finance PLC</b> 4,500 % fällig am 14.02.2031	£	4.200	4.787	0,05	<b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b> 4,001 % fällig am 25.08.2032		98	93	0,00	3,600 % fällig am 22.03.2029 3,600 % fällig am 15.04.2031 3,650 % fällig am 15.08.2030	936 4.158 1.362	871 3.514 1.256	0,01 0,03 0,01
<b>Quadgas Finance PLC</b> 3,375 % fällig am 17.09.2029		300	303	0,00	<b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b> 5,870 % fällig am 25.10.2035		11	11	0,00	4,000 % fällig am 15.01.2037 4,100 % fällig am 15.07.2029	2.263 1.026	2.044 912	0,02 0,01
<b>Royalty Pharma PLC</b> 2,200 % fällig am 02.09.2030 3,300 % fällig am 02.09.2040	\$	5.700 5.000	4.585 3.563	0,04 0,03	<b>Fremont Home Loan Trust</b> 5,470 % fällig am 25.08.2036		6.989	2.344	0,02	<b>American Electric Power Co., Inc.</b> 3,875 % fällig am 15.02.2062 4,300 % fällig am 01.12.2028 5,625 % fällig am 01.03.2033	6.200 4.600 1.700	4.955 4.391 1.729	0,05 0,04 0,02
<b>Sage Group PLC</b> 1,625 % fällig am 25.02.2031 3,820 % fällig am 15.02.2028	£	1.500 2.700	1.402 2.910	0,01 0,03	<b>GSAMP Trust</b> 5,320 % fällig am 25.01.2037		1.303	1.253	0,01	<b>American Homes 4 Rent LP</b> 4,250 % fällig am 15.02.2028 4,900 % fällig am 15.02.2029	500 9.200	471 8.847	0,00 0,08
<b>Santander UK Group Holdings PLC</b> 2,896 % fällig am 15.03.2032 2,920 % fällig am 08.05.2026 3,530 % fällig am 25.08.2028 6,750 % fällig am 24.06.2024 (g)(i)	\$	500	405	0,00	<b>Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust</b> 5,340 % fällig am 25.04.2037		4.724	3.083	0,03	<b>American Tower Corp.</b> 0,500 % fällig am 15.01.2028 1,000 % fällig am 15.01.2032 1,375 % fällig am 04.04.2025	17.900 11.300 800	16.434 9.233 828	0,16 0,09 0,01
<b>Santander UK PLC</b> 5,234 % fällig am 12.02.2027		11.800	15.025	0,14	<b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b> 5,360 % fällig am 25.10.2036		1.078	1.061	0,01	1,450 % fällig am 15.09.2026 1,875 % fällig am 15.10.2030	5.900 4.800	5.196 3.793	0,05 0,04
<b>Standard Chartered PLC</b> 1,456 % fällig am 14.01.2027 2,819 % fällig am 30.01.2026 3,265 % fällig am 18.02.2036 3,603 % fällig am 12.01.2033 4,644 % fällig am 01.04.2031 6,296 % fällig am 06.07.2034 (b)	\$	16.100 2.300 5.700 5.900 2.700	14.284 2.170 4.490 4.729 2.493	0,14 0,02 0,04 0,04 0,02	<b>L2L Education Loan Trust</b> 5,533 % fällig am 15.06.2031		1.118	1.117	0,01	2,100 % fällig am 15.06.2030 2,300 % fällig am 15.09.2031 2,400 % fällig am 15.03.2025 2,950 % fällig am 15.01.2025 3,125 % fällig am 15.01.2027 3,800 % fällig am 15.08.2029 3,950 % fällig am 15.03.2029 5,250 % fällig am 15.07.2028 5,550 % fällig am 15.07.2033 5,650 % fällig am 15.03.2033	6.500 3.900 3.800 9.670 5.900 9.134 600 3.000 1.000 9.000	5.258 3.107 3.580 9.253 5.442 8.344 554 2.968 1.008 9.135	0,05 0,03 0,03 0,09 0,05 0,08 0,01 0,03 0,01 0,09
<b>Telereal Secured Finance PLC</b> 4,010 % fällig am 10.12.2033	£	224	252	0,00	<b>Labrador Aviation Finance Ltd.</b> 4,300 % fällig am 15.01.2042		12.687	10.511	0,10	1,875 % fällig am 15.10.2030 1,950 % fällig am 22.05.2026 2,100 % fällig am 15.06.2030	5.900 8.800 6.500	5.196 8.940 5.258	0,05 0,09 0,05
<b>Thames Water Utilities Finance PLC</b> 4,375 % fällig am 18.01.2031	€	3.000	2.920	0,03	<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b> 5,310 % fällig am 25.12.2036 6,200 % fällig am 25.06.2035		4.217 4.324	2.892 4.185	0,03 0,04	2,300 % fällig am 15.09.2031 2,400 % fällig am 15.03.2025 2,950 % fällig am 15.01.2025 3,125 % fällig am 15.01.2027 3,800 % fällig am 15.08.2029 3,950 % fällig am 15.03.2029 5,250 % fällig am 15.07.2028 5,550 % fällig am 15.07.2033 5,650 % fällig am 15.03.2033	3.900 3.800 9.670 5.900 9.134 600 3.000 1.000 9.000	3.107 3.580 9.253 5.442 8.344 554 2.968 1.008 9.135	0,03 0,03 0,09 0,05 0,08 0,01 0,03 0,01
<b>TP ICAP Finance PLC</b> 2,625 % fällig am 18.11.2028 5,250 % fällig am 29.05.2026 7,875 % fällig am 17.04.2030	£	5.900 16.900 4.800	5.545 19.797 5.789	0,05 0,19 0,06	<b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b> 5,870 % fällig am 25.12.2034		1.719	1.586	0,01	2,400 % fällig am 15.03.2025 2,950 % fällig am 15.01.2025 3,125 % fällig am 15.01.2027 3,800 % fällig am 15.08.2029 3,950 % fällig am 15.03.2029 5,250 % fällig am 15.07.2028 5,550 % fällig am 15.07.2033 5,650 % fällig am 15.03.2033	3.900 3.800 9.670 5.900 9.134 600 3.000 1.000 9.000	3.107 3.580 9.253 5.442 8.344 554 2.968 1.008 9.135	0,03 0,03 0,09 0,05 0,08 0,01 0,03 0,01
<b>Virgin Money UK PLC</b> 2,875 % fällig am 24.06.2025 3,375 % fällig am 24.04.2026 4,000 % fällig am 03.09.2027 4,625 % fällig am 29.10.2028	€	6.700 2.300 1.000 500	7.084 2.662 1.113 513	0,07 0,03 0,01 0,00	<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b> 6,200 % fällig am 25.04.2035		1.704	1.585	0,02	2,400 % fällig am 15.03.2025 2,950 % fällig am 15.01.2025 3,125 % fällig am 15.01.2027 3,800 % fällig am 15.08.2029 3,950 % fällig am 15.03.2029 5,250 % fällig am 15.07.2028 5,550 % fällig am 15.07.2033 5,650 % fällig am 15.03.2033	3.900 3.800 9.670 5.900 9.134 600 3.000 1.000 9.000	3.107 3.580 9.253 5.442 8.344 554 2.968 1.008 9.135	0,03 0,03 0,09 0,05 0,08 0,01 0,03 0,01
<b>Weir Group PLC</b> 2,200 % fällig am 13.05.2026	\$	8.500	7.618	0,07	<b>New Century Home Equity Loan Trust</b> 6,080 % fällig am 25.11.2034		223	214	0,00	2,950 % fällig am 15.01.2025 3,125 % fällig am 15.01.2027 3,800 % fällig am 15.08.2029 3,950 % fällig am 15.03.2029 5,250 % fällig am 15.07.2028 5,550 % fällig am 15.07.2033 5,650 % fällig am 15.03.2033	5.900 9.134 600 3.000 1.000 9.000	4.770 3.075 1.722 2.968 1.008 9.135	0,05 0,03 0,02 0,03 0,01 0,09
			525.787	5,01	<b>Option One Mortgage Loan Trust</b> 5,290 % fällig am 25.01.2037		4.609	2.646	0,03	5,550 % fällig am 15.07.2033 5,650 % fällig am 15.03.2033	1.000 9.000	1.008 9.135	0,01 0,09
<b>NON-AGENCY-MBS</b>					<b>Residential Asset Mortgage Products Trust</b> 5,610 % fällig am 25.12.2035		384	308	0,00	<b>American Transmission Systems, Inc.</b> 5,000 % fällig am 01.09.2044	1.539	1.436	0,01
<b>Canary Wharf Finance PLC</b> 5,952 % fällig am 22.10.2037	£	55	69	0,00	<b>Residential Asset Securities Corp. Trust</b> 5,810 % fällig am 25.11.2035		370	368	0,00	<b>Amgen, Inc.</b> 5,250 % fällig am 02.03.2030 5,600 % fällig am 02.03.2043 5,650 % fällig am 02.03.2053 5,750 % fällig am 02.03.2063	5.000 36.650 5.900 10.000	5.014 36.786 5.979 10.152	0,05 0,35 0,06 0,10
<b>Great Hall Mortgages PLC</b> 5,644 % fällig am 18.06.2039	\$	560	554	0,01	<b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b> 5,730 % fällig am 25.12.2035 5,825 % fällig am 25.01.2035		426 94	411 88	0,00 0,00	<b>Anheuser-Busch Cos. LLC</b> 4,900 % fällig am 01.02.2046	1.800	1.722	0,02
<b>Newgate Funding PLC</b> 5,038 % fällig am 01.12.2050	£	122	146	0,00	<b>SLM Private Credit Student Loan Trust</b> 5,792 % fällig am 16.12.2041		1.423	1.368	0,01	<b>Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.</b> 4,600 % fällig am 15.04.2048 5,450 % fällig am 23.01.2039	6.098 7.000	5.666 7.249	0,05 0,07
			769	0,01	<b>Soundview Home Loan Trust</b> 5,610 % fällig am 25.06.2036		3.914	3.740	0,04	<b>Antares Holdings LP</b> 2,750 % fällig am 15.01.2027 3,950 % fällig am 15.07.2026	5.800 3.500	4.770 3.075	0,05 0,03
Summe Großbritannien			526.556	5,02	<b>Structured Asset Investment Loan Trust</b> 5,770 % fällig am 25.01.2036		3.659	3.369	0,03	<b>Apple, Inc.</b> 4,300 % fällig am 10.05.2033	3.000	2.985	0,03
					<b>Stearns Holdings LLC 'B' (d)</b>		1.508.783	0	0,00	<b>Ares Capital Corp.</b> 2,875 % fällig am 15.06.2027	8.500	7.373	0,07
					<b>STAMMAKTIVEN</b>					<b>Ares Finance Co. LLC</b> 3,250 % fällig am 15.06.2030	15.600	13.147	0,13
					<b>FINANZWERTE</b>					<b>Ashtead Capital, Inc.</b> 1,500 % fällig am 12.08.2026 4,000 % fällig am 01.05.2028	1.400 7.041	1.224 6.529	0,01 0,06
					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>AT&amp;T, Inc.</b> 3,550 % fällig am 15.09.2055 3,650 % fällig am 15.09.2059 4,300 % fällig am 18.11.2034	9.608 15.243 € 3.400	6.733 10.623 3.721	0,06 0,10 0,04
					<b>7-Eleven, Inc.</b> 1,800 % fällig am 10.02.2031	\$	2.150	1.701	0,02	<b>Aviation Capital Group LLC</b> 3,500 % fällig am 01.11.2027 4,375 % fällig am 30.01.2024 5,500 % fällig am 15.12.2024	€ 8.392 \$ 13.999 2.600	7.339 13.773 2.546	0,07 0,13 0,02
					<b>Adventist Health System</b> 5,430 % fällig am 01.03.2032		2.000	1.984	0,02	<b>Bank of America Corp.</b> 0,580 % fällig am 08.08.2029 1,898 % fällig am 23.07.2031 2,551 % fällig am 04.02.2028 2,592 % fällig am 29.04.2031	€ 9.500 \$ 4.200 26.100 15.000	8.603 3.347 23.576 12.601	0,08 0,03 0,22 0,12
					<b>AEP Texas, Inc.</b> 2,100 % fällig am 01.07.2030		7.935	6.487	0,06				
					<b>AES Corp.</b> 3,300 % fällig am 15.07.2025 3,950 % fällig am 15.07.2030		9.500 6.000	8.980 5.385	0,09 0,05				
					<b>Alaska Airlines Pass-Through Trust</b> 4,800 % fällig am 15.02.2029		7.839	7.541	0,07				
					<b>Alexandria Real Estate Equities, Inc.</b> 4,300 % fällig am 15.01.2026		12.150	11.726	0,11				
					<b>Allegion U.S. Holding Co., Inc.</b> 3,550 % fällig am 01.10.2027		9.800	9.071	0,09				

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
2,651 % fällig am 11.03.2032	\$ 10.000	\$ 8.286	0,08	Charter Communications Operating LLC	\$ 7.920	\$ 6.599	0,06	Doctors Co. An Interinsurance Exchange	\$ 900	\$ 715	0,01
2,687 % fällig am 22.04.2032	3.400	2.819	0,03	2,250 % fällig am 15.01.2029	11.000	8.333	0,08	4,500 % fällig am 18.01.2032	4.700	4.116	0,04
4,271 % fällig am 23.07.2029	2.300	2.184	0,02	2,300 % fällig am 01.02.2032	9.200	6.231	0,06	DTE Electric Co.	3.500	3.558	0,03
4,300 % fällig am 28.01.2025				3,500 % fällig am 01.06.2041	6.800	4.302	0,04	1,900 % fällig am 01.04.2028			
(g)	27.900	24.970	0,24	3,700 % fällig am 01.04.2051	1.700	1.114	0,01	5,200 % fällig am 01.04.2033	122	101	0,00
5,015 % fällig am 22.07.2033	5.000	4.894	0,05	3,900 % fällig am 01.06.2052	750	507	0,00	Duke Energy Carolinas LLC			
6,233 % fällig am 23.07.2024	35.600	35.611	0,34	4,400 % fällig am 01.12.2061	8.400	6.345	0,06	4,000 % fällig am 30.09.2042			
Bank of America N.A.				4,800 % fällig am 01.03.2050	12.300	9.687	0,09	Duke Energy Corp.	€ 16.000	15.964	0,15
6,000 % fällig am 15.10.2036	7.150	7.647	0,07	5,125 % fällig am 01.07.2049	6.300	5.372	0,05	3,850 % fällig am 15.06.2034	\$ 3.613	3.473	0,03
BAT Capital Corp.				5,375 % fällig am 01.04.2038				4,300 % fällig am 15.03.2028			
2,726 % fällig am 25.03.2031	6.500	5.180	0,05	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC	9.000	8.157	0,08	Duke Energy Indiana LLC	1.218	1.230	0,01
Bayer U.S. Finance LLC				3,700 % fällig am 15.11.2029	13.132	12.918	0,12	5,400 % fällig am 01.04.2053			
4,250 % fällig am 15.12.2025	400	386	0,00	5,125 % fällig am 30.06.2027	6.600	5.439	0,05	Duke Energy Ohio, Inc.	1.868	1.918	0,02
4,375 % fällig am 15.12.2028	22.680	21.526	0,21	Cheniere Energy Partners LP	11.900	10.491	0,10	5,250 % fällig am 15.03.2033	5.283	5.371	0,05
6,562 % fällig am 15.12.2023	6.900	6.893	0,07	3,250 % fällig am 31.01.2032	9.900	9.941	0,09	Edison International			
Becton Dickinson & Co.				4,000 % fällig am 01.03.2031	700	604	0,01	8,125 % fällig am 15.06.2053	1.230	1.258	0,01
0,034 % fällig am 13.08.2025	€ 2.300	2.310	0,02	5,950 % fällig am 30.06.2033				Enel Finance America LLC			
Berry Global, Inc.				Choice Hotels International, Inc.				7,100 % fällig am 14.10.2027	2.800	2.944	0,03
1,000 % fällig am 15.01.2025	9.900	10.286	0,10	3,700 % fällig am 01.12.2029	24.700	20.619	0,20	Energy Transfer LP	6.745	6.453	0,06
1,500 % fällig am 15.01.2027	9.100	8.934	0,09	Citigroup, Inc.				4,400 % fällig am 15.03.2027	2.294	1.952	0,02
4,875 % fällig am 15.07.2026	\$ 3.100	2.983	0,03	2,572 % fällig am 03.06.2031				5,150 % fällig am 01.02.2043	7.503	6.481	0,06
BGC Partners, Inc.				(j)				5,300 % fällig am 01.04.2044	4.130	3.586	0,03
8,000 % fällig am 25.05.2028	5.600	5.416	0,05	Cleveland Electric Illuminating Co.				5,300 % fällig am 15.02.2047	675	588	0,01
Black Hills Corp.				3,500 % fällig am 01.04.2028	2.965	2.720	0,03	5,350 % fällig am 15.05.2045	7.181	6.286	0,06
1,037 % fällig am 23.08.2024	1.200	1.134	0,01	Comcast Corp.				7,500 % fällig am 01.07.2038	5.734	6.295	0,06
4,250 % fällig am 20.03.2033	2.500	2.483	0,02	5,350 % fällig am 15.05.2053	13.100	13.313	0,13	7,600 % fällig am 01.02.2024	10.400	10.462	0,10
5,950 % fällig am 15.03.2028	2.990	3.027	0,03	Constellation Energy Generation LLC				Entergy Louisiana LLC			
Blackstone Private Credit Fund				5,600 % fällig am 01.03.2028	1.600	1.613	0,02	3,780 % fällig am 01.04.2025	25.100	24.340	0,23
2,350 % fällig am 22.11.2024	13.100	12.246	0,12	5,750 % fällig am 01.10.2041	2.500	2.450	0,02	Entergy Mississippi LLC			
Boeing Co.				Continental Resources, Inc.				5,000 % fällig am 01.09.2033	1.000	982	0,01
2,196 % fällig am 04.02.2026	23.500	21.578	0,21	2,875 % fällig am 01.04.2032	15.595	11.992	0,11	Enterprise Products Operating LLC			
3,250 % fällig am 01.02.2028	4.400	4.043	0,04	5,750 % fällig am 15.01.2031	300	285	0,00	5,250 % fällig am 16.08.2077	4.739	4.156	0,04
5,150 % fällig am 01.05.2030	1.706	1.691	0,02	Corporate Office Properties LP				5,375 % fällig am 15.02.2078	5.614	4.658	0,04
5,930 % fällig am 01.05.2060	5.000	4.956	0,05	2,250 % fällig am 15.03.2026	5.200	4.610	0,04	8,304 % fällig am 16.08.2077	5.988	5.903	0,06
Booking Holdings, Inc.				CoStar Group, Inc.				EPR Properties			
4,125 % fällig am 12.05.2033	€ 1.900	2.064	0,02	2,800 % fällig am 15.07.2030	5.200	4.295	0,04	4,500 % fällig am 01.04.2025	4.420	4.189	0,04
Boston Scientific Corp.				Cox Communications, Inc.				4,500 % fällig am 01.06.2027	6.440	5.785	0,06
2,650 % fällig am 01.06.2030	\$ 5.900	5.144	0,05	5,450 % fällig am 15.09.2028	3.500	3.498	0,03	4,750 % fällig am 15.12.2026	4.425	4.031	0,04
BP Capital Markets America, Inc.				Credit Suisse AG AT1 Claim				4,950 % fällig am 15.04.2028	1.986	1.776	0,02
4,812 % fällig am 13.02.2033	2.000	1.972	0,02	^	22.000	880	0,01	Equifax, Inc.			
British Airways Pass-Through Trust				Crown Castle Towers LLC				5,100 % fällig am 01.06.2028	7.900	7.790	0,07
3,300 % fällig am 15.06.2034	11.816	10.273	0,10	4,241 % fällig am 15.07.2048	5.800	5.391	0,05	Evergy Missouri West, Inc.			
3,350 % fällig am 15.12.2030	789	690	0,01	Crown Castle, Inc.				5,150 % fällig am 15.12.2027	2.000	1.975	0,02
3,800 % fällig am 20.03.2033	68	62	0,00	2,250 % fällig am 15.01.2031	12.500	10.199	0,10	Eversource Energy			
4,125 % fällig am 20.03.2033	68	61	0,00	3,100 % fällig am 15.11.2029	12.805	11.167	0,11	5,125 % fällig am 15.05.2033	300	296	0,00
4,250 % fällig am 15.05.2034	674	616	0,01	3,250 % fällig am 15.01.2051	5.400	3.687	0,04	Exelon Corp.			
4,625 % fällig am 20.12.2025	574	567	0,01	3,800 % fällig am 15.02.2028	3.765	3.513	0,03	4,050 % fällig am 15.04.2030	3.540	3.312	0,03
Broadcom, Inc.				4,300 % fällig am 15.02.2029	4.000	3.766	0,04	Expedia Group, Inc.			
2,450 % fällig am 15.02.2031	12.900	10.497	0,10	CVS Health Corp.				3,250 % fällig am 15.02.2030	7.000	6.098	0,06
2,600 % fällig am 15.02.2033	3.300	2.581	0,02	5,000 % fällig am 30.01.2029	7.000	6.936	0,07	3,800 % fällig am 15.02.2028	10.805	10.115	0,10
3,187 % fällig am 15.11.2036	34.991	26.464	0,25	5,250 % fällig am 30.01.2031	12.400	12.365	0,12	6,250 % fällig am 01.05.2025	983	987	0,01
3,469 % fällig am 15.04.2034	18.649	15.305	0,15	CVS Pass-Through Trust				Fells Point Funding Trust			
3,500 % fällig am 15.02.2041	200	150	0,00	4,704 % fällig am 10.01.2036	208	192	0,00	3,046 % fällig am 31.01.2027	6.150	5.658	0,05
4,926 % fällig am 15.05.2037	17.568	15.909	0,15	5,926 % fällig am 10.01.2034	1.926	1.829	0,02	FirstEnergy Transmission LLC			
Brookfield Capital Finance LLC				6,036 % fällig am 10.12.2028	1.096	1.087	0,01	4,550 % fällig am 01.04.2049	2.083	1.740	0,02
6,087 % fällig am 14.06.2033	7.700	7.823	0,07	7,507 % fällig am 10.01.2032	1.255	1.309	0,01	Fiserv, Inc.			
Brooklyn Union Gas Co.				8,353 % fällig am 10.07.2031	230	247	0,00	3,000 % fällig am 01.07.2031	€ 800	815	0,01
3,865 % fällig am 04.03.2029	500	455	0,00	DAE Funding LLC				Flex Intermediate Holdco LLC	\$ 34.000	27.077	0,26
Burlington Northern Santa Fe LLC				1,550 % fällig am 01.08.2024	6.333	6.014	0,06	Ford Foundation			
4,450 % fällig am 15.01.2053	344	315	0,00	1,625 % fällig am 15.02.2024	3.100	2.989	0,03	2,815 % fällig am 01.06.2070	1.600	991	0,01
5,200 % fällig am 15.04.2054	11.056	11.288	0,11	3,375 % fällig am 20.03.2028	24.600	22.197	0,21	Ford Motor Credit Co. LLC	€ 5.450	5.589	0,05
Caesars Entertainment, Inc.				Daimler Truck Finance North America LLC				2,330 % fällig am 25.11.2025	13.290	14.326	0,14
7,000 % fällig am 15.02.2030	8.500	8.544	0,08	1,625 % fällig am 13.12.2024	2.900	2.731	0,03	3,021 % fällig am 06.03.2024	1.400	1.469	0,01
Cameron LNG LLC				2,000 % fällig am 14.12.2026	7.510	6.709	0,06	3,250 % fällig am 15.09.2025	1.033	1.126	0,01
3,402 % fällig am 15.01.2038	4.300	3.587	0,03	Dell International LLC				4,053 % fällig am 15.11.2023	3.187	3.435	0,03
3,701 % fällig am 15.01.2039	8.325	6.881	0,07	4,900 % fällig am 01.10.2026	11.010	10.937	0,10	4,535 % fällig am 06.03.2025	€ 2.900	3.506	0,03
Cantor Fitzgerald LP				5,300 % fällig am 01.10.2029	4.500	4.470	0,04	Freedom Mortgage Corp.			
4,500 % fällig am 14.04.2027	100	94	0,00	6,020 % fällig am 15.06.2026	23.099	23.489	0,22	8,125 % fällig am 15.11.2024	\$ 4.380	4.344	0,04
4,875 % fällig am 01.05.2024	3.500	3.425	0,03	Delta Air Lines, Inc.				8,250 % fällig am 15.04.2025	4.871	4.755	0,05
Capital One Financial Corp.				2,900 % fällig am 28.10.2024	14.442	13.877	0,13	FS KKR Capital Corp.			
6,312 % fällig am 08.06.2029	9.800	9.742	0,09	3,750 % fällig am 28.10.2029	18.900	17.014	0,16	1,650 % fällig am 12.10.2024	12.300	11.443	0,11
Carlyle Holdings Finance LLC				Digital Realty Trust LP				2,625 % fällig am 15.01.2027	5.400	4.608	0,04
5,625 % fällig am 30.03.2043	100	88	0,00	5,550 % fällig am 15.01.2028	5.000	4.931	0,05				
CDW LLC				Discovery Communications LLC							
3,569 % fällig am 01.12.2031	6.500	5.494	0,05	2,500 % fällig am 20.09.2024	£ 2.400	2.902	0,03				
Centene Corp.				DISH DBS Corp.							
2,450 % fällig am 15.07.2028	20.800	17.799	0,17	5,250 % fällig am 01.12.2026	\$ 3.100	2.493	0,02				
3,000 % fällig am 15.10.2030	21.000	17.519	0,17	5,750 % fällig am 01.12.2028	3.100	2.312	0,02				

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Georgia Power Co. 3,250 % fällig am 15.03.2051	\$ 200	\$ 141	0,00	JPMorgan Chase & Co. 2,069 % fällig am 01.06.2029	\$ 6.600	\$ 5.665	0,05	Monongahela Power Co. 5,400 % fällig am 15.12.2043	\$ 150	\$ 146	0,00
4,950 % fällig am 17.05.2033	5.000	4.938	0,05	2,301 % fällig am 15.10.2025	32.500	30.982	0,30	Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032 (j)	46.900	29.310	0,28
Global Payments, Inc. 4,875 % fällig am 17.03.2031	€ 8.600	9.351	0,09	2,545 % fällig am 08.11.2032	10.000	8.197	0,08	5,250 % fällig am 21.04.2034	2.700	2.667	0,03
5,950 % fällig am 15.06.2052	\$ 2.200	2.108	0,02	2,580 % fällig am 22.04.2032	16.700	13.877	0,13	MSCI, Inc. 3,250 % fällig am 15.08.2033	700	564	0,01
GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2030	1.500	1.301	0,01	2,739 % fällig am 15.10.2030	35.800	30.872	0,29	3,625 % fällig am 01.09.2030	2.500	2.158	0,02
4,000 % fällig am 15.01.2031	4.000	3.462	0,03	3,702 % fällig am 06.05.2030	9.300	8.531	0,08	4,000 % fällig am 15.11.2029	5.350	4.847	0,05
5,300 % fällig am 15.01.2029	15.224	14.509	0,14	3,782 % fällig am 01.02.2028	3.569	3.397	0,03	Nasdaq, Inc. 5,350 % fällig am 28.06.2028	400	401	0,00
5,375 % fällig am 15.04.2026	5.600	5.487	0,05	3,797 % fällig am 23.07.2024	7.500	7.491	0,07	National Fuel Gas Co. 2,950 % fällig am 01.03.2031	3.700	2.963	0,03
5,750 % fällig am 01.06.2028	14.330	14.033	0,13	4,565 % fällig am 14.06.2030	10.000	9.618	0,09	National Health Investors, Inc. 3,000 % fällig am 01.02.2031	1.800	1.384	0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 2,383 % fällig am 21.07.2032	4.100	3.286	0,03	5,350 % fällig am 01.06.2034	5.000	5.042	0,05	Nationwide Financial Services, Inc. 3,900 % fällig am 30.11.2049	8.800	6.436	0,06
2,600 % fällig am 07.02.2030	5.000	4.263	0,04	6,163 % fällig am 23.07.2024	14.100	14.109	0,13	Nationwide Mutual Insurance Co. 9,375 % fällig am 15.08.2039	200	258	0,00
4,223 % fällig am 01.05.2029	19.400	18.336	0,17	Kentucky Utilities Co. 5,450 % fällig am 15.04.2033	4.000	4.078	0,04	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2030	€ 29.473	30.654	0,29
4,482 % fällig am 23.08.2028	17.300	16.737	0,16	Kenvue, Inc. 4,900 % fällig am 22.03.2033	1.200	1.215	0,01	3,875 % fällig am 15.11.2029	17.950	19.123	0,18
6,491 % fällig am 15.05.2026	14.800	14.983	0,14	5,000 % fällig am 22.03.2030	400	404	0,00	Neuberger Berman Group LLC 4,500 % fällig am 15.03.2027	\$ 12.200	11.514	0,11
7,250 % fällig am 10.04.2028	€ 3.817	4.973	0,05	5,100 % fällig am 22.03.2043	6.700	6.816	0,07	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	5.000	4.290	0,04
Goodman U.S. Finance Four LLC 4,500 % fällig am 15.10.2037	\$ 7.182	5.999	0,06	Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032	1.100	765	0,01	4,800 % fällig am 01.12.2027	140	123	0,00
Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % fällig am 15.03.2028	12.875	11.685	0,11	Kinder Morgan, Inc. 7,420 % fällig am 15.02.2037	3.500	3.795	0,04	5,250 % fällig am 28.02.2053	5.000	4.820	0,05
Guardian Life Global Funding 1,100 % fällig am 23.06.2025	3.000	2.731	0,03	8,050 % fällig am 15.10.2030	36	40	0,00	5,481 % fällig am 03.11.2023	3.930	3.930	0,04
Gulfstream Natural Gas System LLC 4,600 % fällig am 15.09.2025	4.560	4.385	0,04	KKR Financial Holdings LLC 5,400 % fällig am 23.05.2033	10.400	9.692	0,09	5,650 % fällig am 01.05.2079	500	465	0,00
Haleon U.S. Capital LLC 3,625 % fällig am 24.03.2032	500	448	0,00	KKR Group Finance Co. LLC 3,625 % fällig am 25.02.2050	1.300	896	0,01	NGPL PipeCo LLC 4,875 % fällig am 15.08.2027	8.855	8.397	0,08
Hanover Insurance Group, Inc. 4,500 % fällig am 15.04.2026	740	717	0,01	Kraft Heinz Foods Co. 4,125 % fällig am 01.07.2027	€ 6.150	7.237	0,07	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 1,850 % fällig am 16.09.2026	15.000	12.734	0,12
HCA, Inc. 3,500 % fällig am 15.07.2051	3.800	2.633	0,03	4,375 % fällig am 01.06.2046	\$ 25.000	21.264	0,20	NVR, Inc. 3,000 % fällig am 15.05.2030	21.840	18.936	0,18
4,125 % fällig am 15.06.2029	3.100	2.870	0,03	Las Vegas Sands Corp. 3,200 % fällig am 08.08.2024	51.200	49.623	0,47	Oaktree Specialty Lending Corp. 3,500 % fällig am 25.02.2025	2.000	1.895	0,02
4,500 % fällig am 15.02.2027	3.800	3.668	0,03	3,500 % fällig am 18.08.2026	3.900	3.635	0,03	Occidental Petroleum Corp. 6,200 % fällig am 15.03.2040	3.750	3.701	0,04
5,500 % fällig am 01.06.2033	22.550	22.524	0,21	Lazard Group LLC 4,375 % fällig am 11.03.2029	4.968	4.616	0,04	6,600 % fällig am 15.03.2046	2.000	2.062	0,02
Highwoods Realty LP 2,600 % fällig am 01.02.2031	6.800	4.991	0,05	Lehman Brothers Holdings, Inc. 0,000 % fällig am 23.12.2010 ^	900	2	0,00	6,625 % fällig am 01.09.2030	1.000	1.040	0,01
4,200 % fällig am 15.04.2029	2.500	2.109	0,02	5,259 % fällig am 12.06.2013 ^	€ 2.807	16	0,00	8,875 % fällig am 15.07.2030	4.850	5.579	0,05
Host Hotels & Resorts LP 2,900 % fällig am 15.12.2031	2.500	1.969	0,02	6,875 % fällig am 02.05.2018 ^	\$ 3.000	7	0,00	Oklahoma Gas & Electric Co. 5,400 % fällig am 15.01.2033	3.269	3.324	0,03
3,375 % fällig am 15.12.2029	4.700	4.021	0,04	Leidos, Inc. 2,300 % fällig am 15.02.2031	2.034	1.604	0,02	Omega Healthcare Investors, Inc. 5,250 % fällig am 15.01.2026	4.200	4.047	0,04
3,500 % fällig am 15.09.2030	2.600	2.206	0,02	Level 3 Financing, Inc. 3,625 % fällig am 15.01.2029	700	421	0,00	OneMain Finance Corp. 6,875 % fällig am 15.03.2025	5.400	5.352	0,05
3,875 % fällig am 01.04.2024	8.200	8.070	0,08	3,875 % fällig am 15.11.2029	4.000	3.187	0,03	ONEOK, Inc. 4,350 % fällig am 15.03.2029	21.030	19.568	0,19
4,000 % fällig am 15.06.2025	1.625	1.563	0,01	Liberty Mutual Group, Inc. 3,825 % fällig am 23.05.2059	€ 2.900	3.013	0,03	6,100 % fällig am 15.11.2032	4.300	4.376	0,04
Howard Midstream Energy Partners LLC 8,875 % fällig am 15.07.2028 (b)	1.000	1.006	0,01	4,569 % fällig am 01.02.2029	\$ 800	755	0,01	Oracle Corp. 3,600 % fällig am 01.04.2050	500	358	0,00
Hudson Pacific Properties LP 3,250 % fällig am 15.01.2030	2.325	1.474	0,01	Marriott International, Inc. 3,500 % fällig am 15.10.2032	11.240	9.717	0,09	3,850 % fällig am 01.04.2060	1.800	1.270	0,01
3,950 % fällig am 01.11.2027	3.000	2.184	0,02	4,150 % fällig am 01.12.2023	3.900	3.881	0,04	4,100 % fällig am 25.03.2061 (j)	6.600	4.877	0,05
5,950 % fällig am 15.02.2028	100	80	0,00	Marvell Technology, Inc. 2,450 % fällig am 15.04.2028	15.000	13.107	0,12	4,900 % fällig am 06.02.2033	1.800	1.748	0,02
Humana, Inc. 5,875 % fällig am 01.03.2033	6.000	6.238	0,06	MassMutual Global Funding 3,400 % fällig am 08.03.2026	3.700	3.519	0,03	6,250 % fällig am 09.11.2032 (j)	14.500	15.398	0,15
Hyundai Capital America 0,875 % fällig am 14.06.2024	12.010	11.457	0,11	Merck & Co., Inc. 5,150 % fällig am 17.05.2063	2.100	2.147	0,02	Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 2.300	2.184	0,02
1,500 % fällig am 15.06.2026	10.200	9.038	0,09	Meta Platforms, Inc. 5,600 % fällig am 15.05.2053	12.800	13.155	0,13	Ovintiv, Inc. 6,250 % fällig am 15.07.2033	\$ 3.000	2.961	0,03
Infor, Inc. 1,450 % fällig am 15.07.2023	7.100	7.088	0,07	MetLife Capital Trust 7,875 % fällig am 15.12.2067	3.282	3.444	0,03	Pacific Gas & Electric Co. 2,500 % fällig am 01.02.2031	500	392	0,00
1,750 % fällig am 15.07.2025	4.700	4.293	0,04	MetLife, Inc. 5,875 % fällig am 15.03.2028 (g)	7.400	6.893	0,07	2,950 % fällig am 01.03.2026 ^	6.700	6.141	0,06
Integrus Baptist Medical Center, Inc. 3,875 % fällig am 15.08.2050	8.300	6.274	0,06	Metropolitan Edison Co. 4,000 % fällig am 15.04.2025	6.300	6.037	0,06	3,000 % fällig am 15.06.2028	16.330	14.091	0,13
Intercontinental Exchange, Inc. 3,000 % fällig am 15.09.2060	9.450	6.194	0,06	Mid-America Apartments LP 1,100 % fällig am 15.09.2026	2.600	2.270	0,02	3,150 % fällig am 01.01.2026	7.209	6.693	0,06
International Flavors & Fragrances, Inc. 1,832 % fällig am 15.10.2027	5.000	4.221	0,04	3,600 % fällig am 01.06.2027	1.925	1.820	0,02	3,300 % fällig am 15.03.2027 ^	11.935	10.842	0,10
Invitation Homes Operating Partnership LP 4,150 % fällig am 15.04.2032	1.500	1.345	0,01	3,950 % fällig am 15.03.2029	6.857	6.464	0,06	3,300 % fällig am 01.12.2027 ^	15.869	13.926	0,13
Ipalco Enterprises, Inc. 3,700 % fällig am 01.09.2024	2.858	2.764	0,03	Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC 4,100 % fällig am 15.05.2028	7.140	6.757	0,06	3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	9.676	9.366	0,09
4,250 % fällig am 01.05.2030	200	181	0,00	Midwest Connector Capital Co. LLC 3,900 % fällig am 01.04.2024	30.282	29.655	0,28	3,450 % fällig am 01.07.2025	5.877	5.552	0,05
Jackson National Life Global Funding 2,650 % fällig am 21.06.2024	600	581	0,01	Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % fällig am 20.06.2027	6.320	6.341	0,06	3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	13.400	12.692	0,12
Jersey Central Power & Light Co. 4,300 % fällig am 15.01.2026	880	852	0,01	Mississippi Power Co. 3,950 % fällig am 30.03.2028	100	94	0,00	3,750 % fällig am 15.08.2042 ^	3.300	2.287	0,02
4,700 % fällig am 01.04.2024	3.800	3.761	0,04	4,250 % fällig am 15.03.2042	2.600	2.169	0,02	3,850 % fällig am 15.11.2023 ^	5.177	5.132	0,05
JetBlue Pass-Through Trust 4,000 % fällig am 15.05.2034	920	840	0,01					4,000 % fällig am 01.12.2046 ^	100	67	0,00
								4,200 % fällig am 01.06.2041	2.173	1.622	0,02
								4,450 % fällig am 15.04.2042 ^	8.543	6.479	0,06
								4,500 % fällig am 15.12.2041 ^	3.400	2.509	0,02



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
4,650 % fällig am 01.08.2028	\$ 1.600	\$ 1.481	0,01	SCE Recovery Funding LLC	\$ 3.100	\$ 3.067	0,03	Time Warner Cable Enterprises LLC	\$ 400	\$ 440	0,00
4,750 % fällig am 15.02.2044 ^	1.889	1.468	0,01	5,112 % fällig am 14.12.2049				8,375 % fällig am 15.07.2033			
5,900 % fällig am 15.06.2032	1.900	1.830	0,02	Sempra Energy	4.100	3.322	0,03	Times Square Hotel Trust	4.164	4.119	0,04
6,700 % fällig am 01.04.2053	7.000	6.879	0,07	4,125 % fällig am 01.04.2052	11.200	11.134	0,11	8,528 % fällig am 01.08.2026			
Pacific Life Global Funding				5,500 % fällig am 01.08.2033				Trans-Allegheny Interstate Line Co.	1.157	1.113	0,01
1,200 % fällig am 24.06.2025	8.100	7.390	0,07	SLM Corp.	2.200	2.046	0,02	3,850 % fällig am 01.06.2025	6.000	5.339	0,05
PacifiCorp				4,200 % fällig am 29.10.2025				Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC			
6,250 % fällig am 15.10.2037	3.600	3.601	0,03	Southern California Edison Co.	1.110	929	0,01	3,250 % fällig am 15.05.2030	1.300	1.318	0,01
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC				2,250 % fällig am 01.06.2030	4.631	3.855	0,04	Trimble, Inc.	5.000	4.809	0,05
4,375 % fällig am 15.10.2028	1.700	1.474	0,01	2,750 % fällig am 01.02.2032	6.400	5.358	0,05	6,100 % fällig am 15.03.2033	1.700	1.612	0,02
PECO Energy Co.				2,950 % fällig am 01.02.2051	6.400	4.200	0,04	Trust Financial Corp.			
3,000 % fällig am 15.09.2049	200	140	0,00	3,450 % fällig am 01.02.2052	5.800	4.159	0,04	4,873 % fällig am 26.01.2029	987	979	0,01
Pennsylvania Electric Co.				3,650 % fällig am 01.06.2051	4.300	3.198	0,03	5,122 % fällig am 26.01.2034			
3,600 % fällig am 01.06.2029	6.770	6.153	0,06	3,900 % fällig am 01.12.2041	450	353	0,00	U.S. Airways Pass-Through Trust			
4,150 % fällig am 15.04.2025	2.205	2.123	0,02	4,000 % fällig am 01.04.2047	11.644	9.262	0,09	5,900 % fällig am 01.04.2026			
6,150 % fällig am 01.10.2038	4.415	4.402	0,04	4,125 % fällig am 01.03.2048	3.755	3.052	0,03	U.S. Bancorp	3.500	3.347	0,03
Penske Truck Leasing Co. LP				5,625 % fällig am 01.02.2036	2.053	2.036	0,02	4,653 % fällig am 01.02.2029	7.100	6.013	0,06
3,350 % fällig am 01.11.2029	17.110	14.620	0,14	5,950 % fällig am 01.02.2038	1.490	1.534	0,01	United Airlines Pass-Through Trust			
Philip Morris International, Inc.				6,650 % fällig am 01.04.2029	10.800	11.191	0,11	2,700 % fällig am 01.11.2033	6.602	5.547	0,05
5,625 % fällig am 17.11.2029	6.800	6.934	0,07	Southern California Gas Co.	5.200	5.200	0,09	2,875 % fällig am 07.04.2030	496	438	0,00
Physicians Realty LP				5,200 % fällig am 01.06.2033	10.000	9.873	0,09	3,450 % fällig am 01.06.2029	662	607	0,01
3,950 % fällig am 15.01.2028	11.870	10.847	0,10	Southern Co.				3,450 % fällig am 07.01.2030	2.200	1.905	0,02
4,300 % fällig am 15.03.2027	7.400	6.973	0,07	1,875 % fällig am 15.09.2081	€ 2.800	2.398	0,02	3,500 % fällig am 01.09.2031	15.443	13.954	0,13
Piedmont Natural Gas Co., Inc.				5,200 % fällig am 15.06.2033	\$ 1.000	993	0,01	3,700 % fällig am 01.09.2031	5.137	4.459	0,04
5,400 % fällig am 15.06.2033	5.000	4.992	0,05	Southern Co. Gas Capital Corp.				4,000 % fällig am 11.10.2027	1.764	1.661	0,02
Pioneer Natural Resources Co.				1,750 % fällig am 15.01.2031	11.390	8.957	0,09	4,150 % fällig am 11.10.2025	1.676	1.648	0,02
7,200 % fällig am 15.01.2028	2.500	2.649	0,03	3,250 % fällig am 15.06.2026	1.100	1.037	0,01	4,150 % fällig am 25.02.2033	9.834	9.034	0,09
Plains All American Pipeline LP				4,400 % fällig am 30.05.2047	600	499	0,00	4,300 % fällig am 15.02.2027	1.677	1.614	0,02
6,700 % fällig am 15.05.2036	300	296	0,00	5,875 % fällig am 15.03.2041	1.920	1.936	0,02	4,650 % fällig am 25.02.2033	976	871	0,01
Principal Life Global Funding				Southern Power Co.				5,800 % fällig am 15.07.2037	6.500	6.616	0,06
3,000 % fällig am 18.04.2026	5.700	5.286	0,05	5,250 % fällig am 15.07.2043	2.800	2.582	0,02	5,875 % fällig am 15.04.2029	6.097	6.052	0,06
Progress Energy, Inc.				Southwest Airlines Co.				UnitedHealth Group, Inc.			
7,750 % fällig am 01.03.2031	750	851	0,01	5,125 % fällig am 15.06.2027	7.600	7.549	0,07	5,875 % fällig am 15.02.2053	25.000	27.795	0,26
Prologis Euro Finance LLC				Spirit AeroSystems, Inc.				6,050 % fällig am 15.02.2063	10.000	11.318	0,11
3,875 % fällig am 31.01.2030	€ 2.100	2.224	0,02	3,850 % fällig am 15.06.2026	1.200	1.116	0,01	Venture Global Calcasieu Pass LLC			
4,250 % fällig am 31.01.2043	5.100	5.157	0,05	Spirit Airlines Pass-Through Trust				3,875 % fällig am 01.11.2033	7.800	6.398	0,06
Protective Life Corp.				4,100 % fällig am 01.10.2029	2.425	2.197	0,02	6,250 % fällig am 15.01.2030	39.500	39.219	0,37
3,400 % fällig am 15.01.2030	\$ 21.300	18.534	0,18	Spirit Realty LP				Venture Global LNG, Inc.			
Provident Funding Associates LP				3,200 % fällig am 15.01.2027	4.800	4.325	0,04	8,125 % fällig am 01.06.2028	14.700	14.946	0,14
6,375 % fällig am 15.06.2025	4.100	3.623	0,03	3,200 % fällig am 15.02.2031	2.245	1.836	0,02	8,375 % fällig am 01.06.2031	14.500	14.638	0,14
Realty Income Corp.				4,000 % fällig am 15.07.2029	1.000	881	0,01	Verizon Communications, Inc.			
2,200 % fällig am 15.06.2028	5.000	4.336	0,04	4,450 % fällig am 15.09.2026	6.100	5.751	0,05	2,100 % fällig am 22.03.2028	1.400	1.231	0,01
4,875 % fällig am 01.06.2026	3.471	3.435	0,03	Sprint LLC				2,355 % fällig am 15.03.2032	736	592	0,01
4,875 % fällig am 06.07.2030 (b)	€ 600	652	0,01	7,875 % fällig am 15.09.2023	4.300	4.314	0,04	5,882 % fällig am 20.03.2026	1.400	1.402	0,01
Regency Centers LP				Sprint Spectrum Co. LLC				6,421 % fällig am 15.05.2025	6.800	6.858	0,07
2,950 % fällig am 15.09.2029	\$ 1.200	1.030	0,01	4,738 % fällig am 20.09.2029	5.119	5.054	0,05	VICI Properties LP			
Reliance Standard Life Global Funding				5,152 % fällig am 20.09.2029	3.800	3.761	0,04	3,875 % fällig am 15.02.2029	7.400	6.501	0,06
2,750 % fällig am 21.01.2027	6.100	5.457	0,05	Standard Industries, Inc.				4,250 % fällig am 01.12.2026	5.200	4.869	0,05
Rio Oil Finance Trust				2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 14.450	14.041	0,13	4,500 % fällig am 15.01.2028	4.200	3.863	0,04
8,200 % fällig am 06.04.2028	3.671	3.694	0,04	STORE Capital Corp.				4,625 % fällig am 01.12.2029	2.825	2.567	0,02
9,250 % fällig am 06.07.2024	1.765	1.782	0,02	2,750 % fällig am 18.11.2030	\$ 2.000	1.448	0,01	5,750 % fällig am 01.02.2027	2.000	1.959	0,02
9,750 % fällig am 06.01.2027	156	161	0,00	4,500 % fällig am 15.03.2028	800	700	0,01	Virginia Electric and Power Co.			
Rockies Express Pipeline LLC				Stryker Corp.				5,000 % fällig am 01.04.2033	5.000	4.945	0,05
4,800 % fällig am 15.05.2030	6.600	5.774	0,06	1,950 % fällig am 15.06.2030	9.650	8.066	0,08	Vistra Operations Co. LLC			
S&P Global, Inc.				Sun Communities Operating LP				3,550 % fällig am 15.07.2024	9.500	9.178	0,09
4,250 % fällig am 01.05.2029	13.610	13.236	0,13	4,200 % fällig am 15.04.2032	3.400	2.973	0,03	3,700 % fällig am 30.01.2027	8.000	7.332	0,07
4,750 % fällig am 01.08.2028	2.600	2.586	0,02	Synchrony Bank				VMware, Inc.			
Sabine Pass Liquefaction LLC				5,625 % fällig am 23.08.2027	7.550	7.091	0,07	1,000 % fällig am 15.08.2024	5.000	4.736	0,05
4,200 % fällig am 15.03.2028	5.700	5.406	0,05	Synchrony Financial				3,900 % fällig am 21.08.2027	7.900	7.495	0,07
5,000 % fällig am 15.03.2027	7.300	7.190	0,07	3,950 % fällig am 01.12.2027	5.200	4.536	0,04	4,700 % fällig am 15.05.2030	19.415	18.541	0,18
5,750 % fällig am 15.05.2024	2.548	2.544	0,02	System Energy Resources, Inc.				Volkswagen Group of America Finance LLC			
Sabra Health Care LP				2,140 % fällig am 09.12.2025	17.300	15.704	0,15	6,040 % fällig am 07.06.2024	1.500	1.504	0,01
3,200 % fällig am 01.12.2031	4.050	3.026	0,03	T-Mobile USA, Inc.				Walt Disney Co.			
Sammons Financial Group, Inc.				2,050 % fällig am 15.02.2028	13.940	12.095	0,12	2,200 % fällig am 31.01.2028	5.959	5.389	0,05
4,450 % fällig am 12.05.2027	700	646	0,01	2,250 % fällig am 15.11.2031	16.100	12.890	0,12	Warnermedia Holdings, Inc.			
San Diego Gas & Electric Co.				2,550 % fällig am 15.02.2031	8.000	6.652	0,06	3,755 % fällig am 15.03.2027	1.500	1.400	0,01
3,750 % fällig am 01.06.2047	100	78	0,00	3,300 % fällig am 15.02.2051	2.200	1.545	0,01	4,279 % fällig am 15.03.2032	5.950	5.280	0,05
4,100 % fällig am 15.06.2049	3.400	2.798	0,03	3,875 % fällig am 15.04.2030	13.200	12.169	0,12	5,141 % fällig am 15.03.2052	9.090	7.408	0,07
5,350 % fällig am 01.04.2053	3.075	3.053	0,03	4,800 % fällig am 15.07.2028	8.400	8.230	0,08	WEA Finance LLC			
Santander Holdings USA, Inc.				5,650 % fällig am 15.01.2053	1.900	1.931	0,02	3,750 % fällig am 17.09.2024	8.000	7.558	0,07
2,490 % fällig am 06.01.2028	4.600	3.977	0,04	Targa Resources Corp.				WEC Energy Group, Inc.			
3,244 % fällig am 05.10.2026	2.500	2.253	0,02	6,125 % fällig am 15.03.2033	3.500	3.578	0,03	4,750 % fällig am 09.01.2026	7.300	7.193	0,07
3,500 % fällig am 07.06.2024	9.500	9.228	0,09	TD SYNEX Corp.				Wells Fargo & Co.			
4,500 % fällig am 17.07.2025	4.000	3.885	0,04	1,750 % fällig am 09.08.2026	5.950	5.190	0,05	2,393 % fällig am 02.06.2028	11.500	10.256	0,10
SBA Tower Trust				2,375 % fällig am 09.08.2028	10.000	8.202	0,08	3,196 % fällig am 17.06.2027	5.800	5.450	0,05
1,884 % fällig am 15.07.2050	25.500	22.928	0,22	Teachers Insurance & Annuity Association of America				3,584 % fällig am 22.05.2028	7.000	6.524	0,06
2,836 % fällig am 15.01.2050	7.009	6.658	0,06	4,375 % fällig am 15.09.2054	18.200	17.577	0,17				



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
4,000 % fällig am 01.08.2053	\$ 411.400	\$ 386.443	3,68	Ameren Corp.	\$ 1.300	\$ 1.296	0,01	Republic Services, Inc.	\$ 1.300	\$ 1.299	0,01
4,500 % fällig am 01.08.2053	68.600	65.990	0,63	5,400 % fällig am 21.07.2023				S&P Global, Inc.	3.600	3.597	0,04
5,000 % fällig am 01.07.2053	101.200	99.184	0,94	American Electric Power Co., Inc.				Sempra Energy	300	300	0,00
		671.151	6,39	5,430 % fällig am 10.07.2023	7.500	7.489	0,07	Thomson Reuters Corp.	11.900	11.879	0,11
				5,480 % fällig am 01.08.2023	5.800	5.772	0,06	5,470 % fällig am 12.07.2023	5.700	5.689	0,05
				5,480 % fällig am 14.08.2023	6.800	6.753	0,07	5,470 % fällig am 13.07.2023	6.900	6.882	0,07
<b>US-SCHATZOBIGLIGTIONEN</b>				AT+T, Inc.	32.000	30.633	0,29	5,500 % fällig am 18.07.2023	500	499	0,01
U.S. Treasury Bonds				5,700 % fällig am 19.03.2024				5,500 % fällig am 19.07.2023	4.200	4.188	0,04
1,375 % fällig am 15.11.2040	149.120	99.887	0,95	Becton Dickinson and Co.	3.100	3.096	0,03	VW Credit, Inc.	5.800	5.782	0,06
1,750 % fällig am 15.08.2041	81.800	57.528	0,55	Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	8.600	8.578	0,08	5,400 % fällig am 21.07.2023	800	797	0,01
1,875 % fällig am 15.02.2041	297.100	215.989	2,06	5,420 % fällig am 17.07.2023	8.600	8.578	0,08	5,400 % fällig am 26.07.2023	300	299	0,00
1,875 % fällig am 15.11.2051	66.350	43.827	0,42	5,430 % fällig am 25.07.2023	3.400	3.387	0,03	5,400 % fällig am 28.07.2023			
2,000 % fällig am 15.11.2041	189.400	138.773	1,32	Constellation Brands, Inc.	3.300	3.299	0,03	Walgreens Boots Alliance	7.800	7.794	0,08
2,250 % fällig am 15.05.2041	68.000	52.425	0,50	5,590 % fällig am 03.07.2023				Summe kurzfristige Instrumente		187.981	1,79
2,250 % fällig am 15.08.2046	220	161	0,00	5,590 % fällig am 05.07.2023	2.000	1.998	0,02	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 9.186.690	87,55	
2,375 % fällig am 15.02.2042	53.700	41.834	0,40	5,600 % fällig am 11.07.2023	250	250	0,00				
2,500 % fällig am 15.02.2045	28.750	22.274	0,21	5,610 % fällig am 11.07.2023	250	250	0,00				
2,750 % fällig am 15.11.2047	1.133	912	0,01	Dominion Resources, Inc.	600	600	0,01				
2,875 % fällig am 15.11.2046	1.461	1.205	0,01	5,400 % fällig am 05.07.2023	600	600	0,01				
2,875 % fällig am 15.05.2049	6.555	5.423	0,05	5,400 % fällig am 19.07.2023	400	399	0,00				
3,000 % fällig am 15.05.2045	32.725	27.661	0,27	Duke Energy Corp.	4.500	4.493	0,04				
3,000 % fällig am 15.02.2048	40.992	34.587	0,33	Electricité de France S.A.	5.050	5.023	0,05				
3,125 % fällig am 15.08.2044	25.700	22.253	0,21	5,510 % fällig am 03.08.2023	6.600	6.564	0,06				
3,125 % fällig am 15.05.2048	29.360	25.347	0,24	5,510 % fällig am 04.08.2023							
3,250 % fällig am 15.03.2042	141.316	126.174	1,20	Enbridge, Inc.	3.300	3.294	0,03				
3,375 % fällig am 15.08.2042	2.000	1.816	0,02	5,400 % fällig am 12.07.2023	7.200	7.178	0,07				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)				5,470 % fällig am 14.07.2023	250	249	0,00				
1,500 % fällig am 15.02.2053	96.589	93.868	0,89	5,470 % fällig am 20.07.2023	700	698	0,01				
U.S. Treasury Notes				Enel Finance America LLC	4.700	4.696	0,05				
3,875 % fällig am 30.09.2029	206.000	204.016	1,94	5,450 % fällig am 06.07.2023	900	897	0,01				
4,625 % fällig am 15.03.2026	460	461	0,01	5,450 % fällig am 24.07.2023	300	299	0,00				
U.S. Treasury STRIPS				Entergy Corp.	1.900	1.896	0,02				
0,000 % fällig am 15.05.2043 (e)	25	11	0,00	5,380 % fällig am 14.07.2023	1.000	997	0,01				
		1.216.432	11,59	5,450 % fällig am 20.07.2023	1.000	997	0,01				
				Humana, Inc.	1.200	1.197	0,01				
				5,450 % fällig am 26.07.2023							
				J.M. Smucker Co.	1.400	1.396	0,01				
				5,410 % fällig am 17.07.2023	4.400	4.392	0,04				
				5,450 % fällig am 12.07.2023							
				Leidos, Inc.	10.200	10.184	0,10				
				5,900 % fällig am 10.07.2023							
				Marriott International, Inc.	700	696	0,01				
				5,450 % fällig am 04.08.2023							
				McCormick & Co., Inc.	300	299	0,00				
				5,350 % fällig am 25.07.2023							
				Mondelez International, Inc.	750	747	0,01				
				5,370 % fällig am 24.07.2023	750	747	0,01				
				5,370 % fällig am 25.07.2023	1.300	1.298	0,01				
				5,430 % fällig am 13.07.2023	1.300	1.297	0,01				
				5,430 % fällig am 14.07.2023							
				Penske Truck Leasing Co. LP	4.600	4.593	0,04				
				5,350 % fällig am 11.07.2023	250	249	0,00				
				5,350 % fällig am 14.07.2023							
				Quanta Services, Inc.	250	250	0,00				
				5,900 % fällig am 05.07.2023	250	250	0,00				
				5,900 % fällig am 11.07.2023							

\* Das Engagement des Global Investment Grade Credit Fund in den Anlagefonds stieg etwas über 10 %. Ab dem 3. Juli 2023 erfüllte der Fonds die Vorgaben wieder.

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BRC	5,120 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 472.200	U.S. Treasury Notes 3,875 % - 4,625 % fällig am 30.04.2025 - 30.06.2025	\$ (481.979)	\$ 472.200	\$ 472.401	4,50
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	57.832	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(58.989)	57.832	57.844	0,55
	5,010	30.06.2023	03.07.2023	21.500	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 30.04.2028	(21.930)	21.500	21.500	0,20
SAL	5,100	30.06.2023	03.07.2023	8.000	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.10.2025	(8.161)	8.000	8.003	0,08
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (571.059)	\$ 559.532	\$ 559.748	5,33

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	836	\$ (1.329)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	8	(14)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	455	464	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	3.648	(5.734)	(0,06)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	15	33	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	2.163	(1.530)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	205	(194)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	306	286	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2023	598	(343)	0,00
				<b>\$ (8.361)</b>	<b>(0,08)</b>

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	252	\$ (110)	\$ (95)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	252	(88)	(12)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	72	(28)	(11)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	72	(37)	(14)	0,00
				<b>\$ (263)</b>	<b>\$ (132)</b>	<b>0,00</b>
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					<b>\$ (8.493)</b>	<b>(0,08)</b>

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Toll Brothers Finance Corp.	(1,000) %	20.06.2024	\$ 23.500	\$ (152)	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AES Corp.	5,000 %	20.12.2025	\$ 7.900	\$ (781)	(0,01)
AES Corp.	5,000	20.06.2026	2.400	(217)	0,00
Airbus Finance BV	1,000	20.12.2025	€ 10.300	27	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2027	\$ 8.000	137	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	12.100	(119)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	3.400	16	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2024	7.600	(86)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	2.000	(11)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	54.000	(482)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	1.300	(12)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	29.600	208	0,00
Atlantia SpA	1,000	20.12.2025	€ 1.800	75	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2025	\$ 7.000	156	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	900	22	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	1.000	15	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 6.800	(22)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	23.900	(26)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	6.000	15	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	500	7	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	20.400	(48)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	1.100	0	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	\$ 5.000	(304)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	32.050	268	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	27.900	555	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	18.750	(10)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	2.000	0	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	2.050	(165)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2028	2.435	53	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.06.2028	€ 2.700	10	0,00
Hess Corp.	1,000	20.06.2026	\$ 7.000	100	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20.12.2023	6.100	(792)	(0,01)
Lennar Corp.	5,000	20.12.2026	3.200	(223)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2023	11.000	346	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2028	600	10	0,00

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 11.300	\$ (98)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	€ 25.300	(222)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	9.000	(58)	0,00
Southwest Airlines Co.	1,000	20.12.2026	\$ 3.100	40	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	7.800	22	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	€ 24.800	(45)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	63.700	761	0,01
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	4.700	39	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	7.300	(23)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 1.900	(29)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	500	11	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	11.700	47	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	€ 12.700	(65)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2026	4.100	(77)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	11.100	(167)	0,00
				\$ (1.142)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 89.300	\$ 824	0,01
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	903.500	6.634	0,06
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000	20.06.2028	€ 12.100	416	0,01
				\$ 7.874	0,08

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175 %	28.02.2052	£ 7.200	\$ (4.109)	(0,04)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	72.000	(2.788)	(0,03)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2023	¥ 910.000	9	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.09.2024	1.829.900	9	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300	20.03.2028	1.192.900	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	\$ 160.000	11.897	0,11
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	427.700	10.167	0,10
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	CAD 244.800	(17.861)	(0,17)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 88.530	41.610	0,40
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,175	17.03.2033	265.610	(70.613)	(0,67)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	31.200	(1.394)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	88.900	(9.442)	(0,09)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	20.800	(2.180)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	62.700	(5.881)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	28.000	(2.625)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	24.000	(533)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	76.300	663	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,000	19.09.2023	HUF 37.770.400	(6.154)	(0,06)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	16.157.700	(3.275)	(0,03)
				\$ (62.500)	(0,60)	
				\$ (55.920)	(0,53)	

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- <sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- <sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- <sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- <sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSOPTIENEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	11.400	\$ (44)	\$ (54)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	11.400	(44)	(34)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	7.900	(52)	(20)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	7.900	(52)	(6)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	4.300	(31)	(19)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	4.300	(31)	(10)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	5.400	(17)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	5.400	(17)	(6)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	4.400	(30)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	4.400	(30)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	4.300	(14)	(9)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	4.300	(14)	(21)	0,00
BRC	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	5.300	(12)	(10)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	5.300	(12)	(19)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	4.600	(32)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	4.600	(32)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	4.400	(14)	(9)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	4.400	(14)	(21)	0,00
GLM	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	5.200	(12)	(10)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	5.200	(12)	(18)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	5.500	(20)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	5.500	(20)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	12.200	(42)	(16)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	12.200	(42)	(51)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	5.400	(17)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	5.400	(17)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	5.400	(19)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	5.400	(19)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	5.400	(18)	(10)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	5.400	(18)	(22)	0,00
							\$ (748)	\$ (381)	(0,01)

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	\$ 95,875	07.08.2023	14.300	\$ (85)	\$ (84)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	97,875	07.08.2023	14.300	(78)	(20)	0,00
					\$ (163)	\$ (104)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 1.100	\$ (38)	\$ 43	\$ 5	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2024	14.500	(304)	435	131	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	14.200	(395)	568	173	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.500	(294)	416	122	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	22.100	93	189	282	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	62.700	(1.024)	1.821	797	0,01
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2025	7.800	170	(68)	102	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	31.400	(1.186)	1.046	(140)	0,00
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 3.000	286	(491)	(205)	0,00
DUB	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	\$ 11.100	(270)	406	136	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	5.700	(5)	81	76	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	44.900	(502)	1.235	733	0,01
GLM	Equinix, Inc.	5,000	20.06.2027	4.500	629	(52)	577	0,01
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 15.100	1.697	(2.727)	(1.030)	(0,01)
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	\$ 5.700	(7)	83	76	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.400	33	(8)	25	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.700	(229)	204	(25)	0,00
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 5.000	560	(901)	(341)	0,00
JLN	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	\$ 4.400	(99)	63	(36)	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2024	16.300	223	(106)	117	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2024	8.100	112	(35)	77	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	7.600	(1)	103	102	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	15.800	(978)	811	(167)	0,00
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20.06.2025	7.900	0	(63)	(63)	0,00
MYC	Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	1,000	20.12.2024	16.500	322	(119)	203	0,00
	Pioneer Natural Resources Co.	1,000	20.06.2025	8.400	(408)	520	112	0,00
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 2.700	311	(495)	(184)	0,00
					\$ (1.304)	\$ 2.959	\$ 1.655	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHÜTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2023	\$ 5.80	\$ 676	\$ (532)	\$ 144	0,00
BRC	iTraxx Japan 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	¥ 13.027.00	499	755	1.254	0,01
CBK	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	\$ 8.00	828	(629)	199	0,00
GST	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	24.00	2.849	(2.253)	596	0,01
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	44.30	5.450	(4.349)	1.101	0,01
	iTraxx Japan 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	¥ 4.024.00	108	279	387	0,01
MYC	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	\$ 6.60	784	(620)	164	0,00
					\$ 11.194	\$ (7.349)	\$ 3.845	0,04

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 2.061	\$ 1.349	\$ 0	\$ (23)	\$ (23)	0,00
	07.2023	\$ 7.525	AUD 11.340	23	0	23	0,00
	08.2023	AUD 11.340	\$ 7.531	0	(23)	(23)	0,00
BOA	07.2023	19.171	12.507	0	(254)	(254)	0,00
	07.2023	CAD 194.652	143.054	0	(4.047)	(4.047)	(0,04)
	07.2023	DKK 39.871	5.758	0	(85)	(85)	0,00
	07.2023	£ 1.232	1.558	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	\$ 10.635	DKK 72.307	0	(40)	(40)	0,00
	07.2023	33.407	€ 30.900	316	(11)	305	0,00
	07.2023	53.907	¥ 7.498.900	0	(2.024)	(2.024)	(0,02)
	07.2023	30.438	MXN 560.360	2.153	0	2.153	0,02
	08.2023	DKK 72.186	\$ 10.635	40	0	40	0,00
	09.2023	INR 959	12	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW 76.331	60	2	0	2	0,00
	09.2023	\$ 4.348	IDR 65.090.309	0	(25)	(25)	0,00
BPS	07.2023	€ 1.318.551	\$ 1.417.573	0	(20.968)	(20.968)	(0,20)
	07.2023	\$ 5.370	AUD 8.107	27	0	27	0,00
	07.2023	174	CHF 156	0	0	0	0,00
	07.2023	52.119	€ 47.721	5	(60)	(55)	0,00
	07.2023	49.940	¥ 6.941.546	0	(1.913)	(1.913)	(0,02)
	07.2023	7.308	MXN 130.668	298	0	298	0,00
	08.2023	AUD 8.107	\$ 5.374	0	(27)	(27)	0,00
	08.2023	CHF 155	174	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 55.207	¥ 7.932.000	24	0	24	0,00
	08.2023	ZAR 137.691	\$ 7.416	157	0	157	0,00
	09.2023	\$ 4.509	IDR 67.761.328	0	(8)	(8)	0,00
	09.2023	890	PEN 3.258	3	0	3	0,00
	10.2023	ZAR 263.125	\$ 14.135	353	0	353	0,00
	12.2023	\$ 1.134	MXN 20.219	10	0	10	0,00
BRC	07.2023	PEN 50.187	\$ 13.718	0	(128)	(128)	0,00
	07.2023	\$ 21.192	£ 16.801	185	(17)	168	0,00
	07.2023	13.711	PEN 50.187	127	0	127	0,00
	08.2023	CLP 78.489	\$ 96	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 30.801	COP 131.218.774	236	0	236	0,00
	08.2023	ZAR 286.354	\$ 15.180	191	(105)	86	0,00
	09.2023	IDR 163.629	11	0	0	0	0,00
	09.2023	PEN 376.007	102.259	0	(851)	(851)	(0,01)
BSH	09.2023	\$ 7.552	PEN 27.887	99	0	99	0,00
CBK	07.2023	AUD 7.159	\$ 4.671	0	(95)	(95)	0,00
	07.2023	\$ 8.847	€ 8.181	84	(6)	78	0,00
	07.2023	9.735	£ 7.675	22	0	22	0,00
	07.2023	7.308	MXN 130.664	297	0	297	0,00
	07.2023	59.488	PEN 223.029	2.007	0	2.007	0,02
	08.2023	CLP 18.085.756	\$ 22.033	0	(351)	(351)	0,00
	08.2023	CNH 101	14	1	0	1	0,00
	08.2023	SEK 1.637	161	10	0	10	0,00
	08.2023	\$ 22.200	CLP 18.164.245	281	0	281	0,00
	08.2023	8.714	NOK 90.901	0	(217)	(217)	0,00
	10.2023	1.548	CLP 1.268.928	15	0	15	0,00
DUB	07.2023	525	BRL 2.842	65	0	65	0,00
	07.2023	16.206	£ 12.998	319	0	319	0,00
	09.2023	PEN 544	\$ 148	0	(1)	(1)	0,00
	10.2023	ZAR 110.471	6.066	279	0	279	0,00
FAR	07.2023	PEN 54.587	14.998	0	(50)	(50)	0,00
	08.2023	\$ 14.998	PEN 54.743	43	0	43	0,00
GLM	07.2023	BRL 70.572	\$ 14.616	0	(14)	(14)	0,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2023	\$	12.533	BRL 67.506	\$ 1.461	\$ 0	0,02	
	07.2023		2.569	PEN 9.379	15	0	0,00	
	08.2023		3.831	NOK 40.652	0	(31)	0,00	
	09.2023	BRL	14.376	\$ 2.854	0	(93)	0,00	
	09.2023	\$	14.616	BRL 71.354	11	0	0,00	
	09.2023		5.177	PEN 18.922	12	0	0,00	
IND	07.2023	DKK	117.175	\$ 16.913	0	(255)	0,00	
	08.2023	\$	9.838	NOK 103.111	0	(199)	0,00	
JPM	07.2023	AUD	15.930	\$ 10.415	0	(189)	0,00	
	07.2023	£	4.810	6.081	0	(33)	0,00	
	07.2023	¥	4.917.636	34.387	363	0	0,00	
	07.2023	\$	1.577	CAD 2.092	4	0	0,00	
	07.2023		1.328.758	€ 1.217.147	235	(1.085)	(0,01)	
	07.2023		798	MXN 14.030	19	0	0,00	
	08.2023	€	1.206.366	\$ 1.319.073	1.126	0	0,01	
	08.2023	HUF	7.853.166	22.608	41	(120)	0,00	
	08.2023	\$	6.082	£ 4.810	33	0	0,00	
	08.2023		34.387	¥ 4.896.739	0	(364)	0,00	
	08.2023		888	MXN 15.390	2	0	0,00	
	08.2023		1.413	NOK 14.990	0	(12)	0,00	
	08.2023		1.308	ZAR 23.940	0	(46)	0,00	
	08.2023	ZAR	134	\$ 7	0	0	0,00	
	09.2023	\$	1.818	IDR 27.350.116	0	(1)	0,00	
	09.2023		17.251	INR 1.421.764	31	0	0,00	
MBC	09.2023		4.619	PEN 16.901	18	0	0,00	
	07.2023	CAD	3.656	\$ 2.741	0	(22)	0,00	
	07.2023	€	22.076	23.676	0	(409)	0,00	
	07.2023	£	275.719	341.314	0	(9.222)	(0,09)	
	07.2023	\$	1.647	CAD 2.232	40	0	0,00	
	07.2023		25.247	€ 23.435	321	0	0,00	
	09.2023	KRW	141.506	\$ 111	3	0	0,00	
MYI	07.2023	€	1.008	1.099	0	(1)	0,00	
	07.2023	£	80	101	0	(1)	0,00	
	07.2023	IDR	17.158.597	1.147	3	0	0,00	
	07.2023	SGD	71	53	0	0	0,00	
	07.2023	\$	111	CHF 99	0	0	0,00	
	07.2023		9.453	DKK 64.485	0	(5)	0,00	
	07.2023		15.606	€ 14.430	137	0	0,00	
	07.2023		32.574	£ 26.082	587	(2)	0,01	
	07.2023		1.142	IDR 17.158.597	2	0	0,00	
	07.2023		2	SEK 23	0	0	0,00	
	08.2023	DKK	64.377	\$ 9.453	5	0	0,00	
	08.2023	\$	2.251	ZAR 41.194	0	(79)	0,00	
	09.2023	KRW	159.031	\$ 124	3	0	0,00	
	09.2023	\$	4.518	IDR 67.514.158	0	(34)	0,00	
	09.2023		3.723	INR 307.093	10	0	0,00	
RBC	07.2023	MXN	16.241	\$ 844	0	(101)	0,00	
	08.2023	\$	5.183	MXN 89.828	12	0	0,00	
SCX	07.2023	AUD	22.487	\$ 14.694	0	(274)	0,00	
	07.2023	CHF	164	182	0	(1)	0,00	
	07.2023	\$	11.057	AUD 16.657	30	0	0,00	
	08.2023	AUD	16.657	\$ 11.066	0	(30)	0,00	
	09.2023	\$	16.887	IDR 252.117.291	0	(140)	0,00	
	09.2023		10.796	INR 889.196	12	0	0,00	
	09.2023		10.260	PEN 37.754	98	0	0,00	
SOG	07.2023	AUD	13.613	\$ 8.906	0	(155)	0,00	
	07.2023	PLN	1.619	376	0	(22)	0,00	
SSB	07.2023	PEN	104.373	28.615	0	(164)	0,00	
	08.2023	\$	28.575	PEN 104.373	147	0	0,00	
TOR	07.2023	AUD	7.204	\$ 4.712	0	(84)	0,00	
	07.2023	\$	13.539	AUD 20.498	106	0	0,00	
	07.2023		148.194	CAD 196.089	102	(108)	0,00	
	07.2023		287.423	£ 226.192	147	0	0,00	
	08.2023	AUD	20.498	\$ 13.550	0	(105)	0,00	
	08.2023	CAD	196.011	148.194	107	(102)	0,00	
	08.2023	£	226.192	287.485	0	(142)	0,00	
	10.2023	CLP	1.268.928	1.540	0	(23)	0,00	
UAG	07.2023	AUD	1.649	1.079	0	(18)	0,00	
	07.2023	\$	21.815	AUD 32.669	46	(114)	0,00	
	07.2023		138	MXN 2.464	5	0	0,00	
	08.2023	AUD	32.669	\$ 21.832	114	(46)	0,00	
	08.2023	ZAR	180.831	9.421	3	(113)	0,00	
	09.2023		185.425	10.576	828	0	0,01	
	10.2023		35.601	1.923	58	0	0,00	
					\$ 13.969	\$ (45.297)	\$ (31.328)	(0,30)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Investor AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 851	\$ 565	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07.2023	\$ 1.067	AUD 1.630	18	0	18	0,00
	08.2023	565	851	2	0	2	0,00
BOA	07.2023	AUD 17	\$ 11	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 3.319	AUD 5.106	80	0	80	0,00
BPS	07.2023	AUD 4.482	\$ 2.967	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	\$ 2.769	AUD 4.268	72	0	72	0,00
	08.2023	2.883	4.349	14	0	14	0,00
CBK	07.2023	914	1.383	14	(7)	7	0,00
MBC	07.2023	AUD 75	\$ 49	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	1.501	996	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	\$ 821	AUD 1.256	15	0	15	0,00
	08.2023	997	1.501	3	0	3	0,00
UAG	07.2023	AUD 5.197	\$ 3.453	8	(15)	(7)	0,00
	07.2023	\$ 1.269	AUD 1.939	21	0	21	0,00
	08.2023	3.357	5.052	15	(6)	9	0,00
				\$ 262	\$ (49)	\$ 213	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) ausschüttend, Administrative CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF 186	\$ 208	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 19	CHF 17	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	CHF 209.112	\$ 233.815	79	0	79	0,00
	07.2023	\$ 318.182	CHF 287.839	3.552	0	3.552	0,03
	08.2023	233.815	208.517	0	(79)	(79)	0,00
IND	07.2023	CHF 110.524	\$ 123.042	0	(496)	(496)	0,00
	08.2023	\$ 123.042	CHF 110.209	496	0	496	0,00
JPM	07.2023	CHF 75	\$ 83	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	2.354	2.623	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	\$ 181	CHF 163	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CHF 9.715	\$ 10.745	0	(115)	(115)	0,00
	07.2023	\$ 4.647	CHF 4.201	49	0	49	0,00
RBC	07.2023	CHF 113	\$ 127	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	49	55	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	1.132	1.253	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	\$ 222.524	CHF 199.944	964	0	964	0,01
	07.2023	CHF 216.943	\$ 242.011	0	(478)	(478)	0,00
UAG	07.2023	\$ 200.590	CHF 180.239	873	0	873	0,01
	08.2023	241.279	215.670	475	0	475	0,00
				\$ 6.488	\$ (1.190)	\$ 5.298	0,05

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CZK (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	\$ 3.719	CZK 81.931	\$ 44	\$ 0	\$ 44	0,00
DUB	07.2023	3.758	83.597	81	0	81	0,00
MYI	07.2023	CZK 82.828	\$ 3.818	15	0	15	0,00
	07.2023	\$ 39	CZK 872	1	0	1	0,00
UAG	08.2023	3.818	82.930	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	3.702	81.871	58	0	58	0,00
				\$ 199	\$ (15)	\$ 184	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, E Class EUR (Currency Exposure) ausschüttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 401	\$ 266	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2023	\$ 119	AUD 182	2	0	2	0,00
	08.2023	266	401	1	0	1	0,00
BOA	07.2023	€ 53	\$ 57	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	¥ 56	0	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK 662	61	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 148	AUD 229	4	0	4	0,00
	07.2023	4.906	CAD 6.676	139	0	139	0,00
	07.2023	0	€ 0	0	0	0	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	\$ 27	NZD 45	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	1	SEK 13	0	0	0	0,00
	08.2023	61	661	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	AUD 287	\$ 190	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CHF 626	699	0	0	0	0,00
	07.2023	€ 44.525	48.786	209	0	209	0,00
	07.2023	\$ 77	€ 70	0	0	0	0,00
	07.2023	1.020	¥ 141.786	0	(39)	(39)	0,00
	07.2023	2	NZD 4	0	0	0	0,00
	08.2023	190	AUD 287	1	0	1	0,00
	08.2023	699	CHF 624	0	0	0	0,00
	08.2023	48.832	€ 44.505	0	(211)	(211)	0,00
CBK	07.2023	€ 52	\$ 57	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 604	€ 562	10	0	10	0,00
IND	07.2023	CHF 16	\$ 18	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 18	CHF 16	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	¥ 48.265	\$ 337	3	0	3	0,00
	08.2023	\$ 337	¥ 48.060	0	(4)	(4)	0,00
MBC	07.2023	€ 145	\$ 156	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	£ 157	196	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	\$ 3	CAD 3	0	0	0	0,00
	07.2023	217	€ 199	2	(1)	1	0,00
	07.2023	8.147	£ 6.582	220	0	220	0,00
MYI	07.2023	9	CHF 8	0	0	0	0,00
	07.2023	60	SEK 648	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD 589	\$ 391	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 678	CHF 610	3	0	3	0,00
	07.2023	71	NZD 116	1	0	1	0,00
	08.2023	391	AUD 589	1	0	1	0,00
SOG	07.2023	787	1.203	14	0	14	0,00
	07.2023	47.357	€ 44.023	672	0	672	0,01
TOR	07.2023	AUD 725	\$ 479	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	CAD 4.733	3.566	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	£ 6.425	8.164	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	NZD 165	100	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 416	AUD 637	7	0	7	0,00
	08.2023	479	725	4	0	4	0,00
	08.2023	3.566	CAD 4.731	11	0	11	0,00
	08.2023	8.165	£ 6.425	4	0	4	0,00
	08.2023	100	NZD 165	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	AUD 395	\$ 261	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 95	AUD 146	2	0	2	0,00
	07.2023	44	CHF 40	0	0	0	0,00
	08.2023	261	AUD 395	2	0	2	0,00
				\$ 1.313	\$ (287)	\$ 1.026	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 787.948	€ 733.130	\$ 11.902	\$ (4)	\$ 11.898	0,11
BPS	07.2023	€ 725.158	\$ 794.516	3.380	(12)	3.368	0,03
	07.2023	\$ 792.262	€ 736.861	11.671	(17)	11.654	0,11
	08.2023	789.286	719.338	0	(3.414)	(3.414)	(0,03)
CBK	07.2023	€ 744.782	\$ 809.419	2	(3.140)	(3.138)	(0,03)
	07.2023	\$ 2.709	€ 2.476	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	776.143	712.885	2.681	0	2.681	0,02
JPM	07.2023	€ 720.167	\$ 786.351	648	0	648	0,01
	07.2023	\$ 33.791	€ 31.605	690	0	690	0,01
	08.2023	787.450	720.167	0	(672)	(672)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 45.147	\$ 48.387	0	(868)	(868)	(0,01)
	07.2023	\$ 5.346	€ 4.975	83	(2)	81	0,00
SOG	07.2023	785.082	729.807	11.138	0	11.138	0,11
				\$ 42.195	\$ (8.136)	\$ 34.059	0,32

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, E Class GBP (Hedged) ausschüttend, R Class GBP (Hedged) ausschüttend, W Class GBP (Hedged) thesaurierend und W Class GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 438	\$ 556	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2023	\$ 127	£ 101	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	449.439	362.179	11.351	(333)	11.018	0,11
BRC	07.2023	£ 2.759	\$ 3.482	1	(27)	(26)	0,00
	07.2023	\$ 1.772	£ 1.423	38	0	38	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	£ 8.694	\$ 10.947	\$ 8	\$ (115)	\$ (107)	0,00
	07.2023	\$ 332	£ 263	3	0	3	0,00
JPM	07.2023	£ 335.315	\$ 423.972	0	(2.332)	(2.332)	(0,02)
	08.2023	\$ 424.062	£ 335.315	2.326	0	2.326	0,02
MBC	07.2023	\$ 403.500	\$ 325.955	10.903	(1)	10.902	0,10
MYI	07.2023	\$ 403.575	\$ 324.714	9.251	0	9.251	0,09
TOR	07.2023	£ 335.832	\$ 426.741	0	(218)	(218)	0,00
	08.2023	\$ 426.834	£ 335.832	211	0	211	0,00
				\$ 34.093	\$ (3.027)	\$ 31.066	0,30

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	NOK 9	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 9.141	NOK 100.865	274	0	274	0,00
BPS	07.2023	NOK 68.609	\$ 6.382	0	(22)	(22)	0,00
	08.2023	\$ 6.382	NOK 68.542	22	0	22	0,00
CBK	07.2023	NOK 3.596	\$ 324	0	(12)	(12)	0,00
	07.2023	\$ 7.814	NOK 87.875	388	0	388	0,01
GLM	07.2023	NOK 72.566	\$ 6.733	0	(41)	(41)	0,00
	08.2023	\$ 6.733	NOK 72.495	41	0	41	0,00
RYL	07.2023	NOK 85	\$ 8	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	\$ 6.967	NOK 77.091	229	0	229	0,00
				\$ 954	\$ (75)	\$ 879	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK 1.368.269	\$ 126.957	\$ 299	\$ (19)	\$ 280	0,00
	07.2023	\$ 33	SEK 349	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 93.646	1.009.361	0	(80)	(80)	0,00
BPS	07.2023	SEK 158.850	\$ 14.853	146	0	146	0,00
BRC	07.2023	\$ 1	SEK 6	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	\$ 67.716	739.603	758	0	758	0,01
GLM	07.2023	SEK 78	\$ 7	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 75	SEK 812	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	SEK 2.767	\$ 257	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 75.531	SEK 813.436	0	(222)	(222)	0,00
MYI	07.2023	SEK 1.011.051	\$ 93.646	41	0	41	0,00
	07.2023	\$ 108.693	SEK 1.166.772	0	(671)	(671)	(0,01)
	08.2023	\$ 93.646	SEK 1.009.796	0	(40)	(40)	0,00
SCX	07.2023	SEK 893	\$ 83	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 75.863	SEK 820.568	106	0	106	0,00
				\$ 1.352	\$ (1.032)	\$ 320	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$ 28.844	SGD 39.030	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
GLM	07.2023	SGD 83	\$ 62	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 7.120	SGD 9.560	0	(56)	(56)	0,00
JPM	07.2023	SGD 42.389	\$ 31.325	3	0	3	0,00
	07.2023	\$ 3.692	SGD 4.997	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 31.325	SGD 42.348	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023	\$ 26.484	SGD 35.783	0	(43)	(43)	0,00
	08.2023	SGD 198	\$ 146	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	\$ 41.538	SGD 30.739	48	(1)	47	0,00
	08.2023	\$ 30.021	SGD 40.527	0	(45)	(45)	0,00
UAG	07.2023	SGD 202	\$ 150	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 28.154	SGD 38.086	0	(12)	(12)	0,00
				\$ 52	\$ (164)	\$ (112)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 46.620 0,44

Summe Anlagen

\$ 10.785.911 102,79

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (293.060) (2,79)

Nettovermögen

\$ 10.492.851 100,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,70 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	2,572 %	03.06.2031	26.05.2020 - 09.07.2020	\$ 25.025	\$ 20.619	0,20
Morgan Stanley	0,000	02.04.2032	11.02.2020	41.043	29.310	0,28
Oracle Corp.	4,100	25.03.2061	24.03.2021 - 26.03.2021	6.835	4.877	0,05
Oracle Corp.	6,250	09.11.2032	07.11.2022	14.476	15.398	0,15
				\$ 87.379	\$ 70.204	0,68

Barmittel in Höhe von 179.611 USD (31. Dezember 2022: 213.307 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 590 USD (31. Dezember 2022: 55.028 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 4.048 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

#### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 9.173.458	\$ 13.232	\$ 9.186.690
Investmentfonds	1.057.482	0	0	1.057.482
Pensionsgeschäfte	0	559.532	0	559.532
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(7.125)	(10.668)	0	(17.793)
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.050.357</b>	<b>\$ 9.722.322</b>	<b>\$ 13.232</b>	<b>\$ 10.785.911</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 9.770.167	\$ 8.376	\$ 9.778.544
Investmentfonds	782.040	256.286	0	1.038.326
Pensionsgeschäfte	0	75.423	0	75.423
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(44.604)	(36.888)	0	(81.492)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(136.255)	0	(136.255)
<b>Summen</b>	<b>\$ 737.437</b>	<b>\$ 9.928.733</b>	<b>\$ 8.376</b>	<b>\$ 10.674.546</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Derivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (3)	\$ 0	\$ (3)	\$ 32	\$ 0	\$ 32
BOA	8.777	(6.280)	2.497	5.200	(5.790)	(590)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	360	(470)	(110)
BPS	4.436	(840)	3.596	(21.024)	20.550	(474)
BRC	2.002	(2.040)	(38)	977	0	977
BSH	99	0	99	(11)	0	(11)
CBK	2.761	(2.470)	291	36.530	(37.360)	(830)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	24	0	24
DUB	819	(570)	249	(3.383)	3.210	(173)
FAR	(7)	0	(7)	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	189	(250)	(61)
GLM	1.980	(1.830)	150	(8.272)	8.408	136
GST	219	(210)	9	1.037	(1.030)	7
IND	(454)	510	56	k. A.	k. A.	k. A.
JLN	(341)	0	(341)	(237)	0	(237)
JPM	2.357	(2.020)	337	(9.156)	8.080	(1.076)
MBC	769	0	769	20.345	(19.090)	1.255
MYC	206	(260)	(54)	(594)	630	36
MYI	8.959	(5.090)	3.869	(342)	280	(62)
RBC	(89)	80	(9)	236	(350)	(114)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	14	0	14
SAL	(104)	0	(104)	(90)	0	(90)
SCX	772	0	772	(14.373)	13.840	(533)
SOG	11.647	(8.600)	3.047	(88)	30	(58)
SSB	(17)	0	(17)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(102)	0	(102)	365	(2.890)	(2.525)
UAG	1.934	(640)	1.294	623	0	623

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	62,92	63,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,62	28,59
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	0,33
Investmentfonds	10,08	9,85
Pensionsgeschäfte	5,33	0,72
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,08)	(0,41)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,53)	(0,44)
Freiverkehrsfinaanzderivate	0,44	0,08
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(1,29)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,04)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,74	1,72
Österreich	0,19	0,21
Belgien	0,12	0,12
Bermuda	0,57	0,66
Brasilien	0,19	0,32
Kanada	2,40	2,14
Cayman-Inseln	2,42	3,29
Chile	0,02	0,06
China	0,16	0,27
Kolumbien	0,08	k. A.
Zypern	0,09	0,09
Tschechische Republik	0,05	k. A.
Dänemark	0,31	0,30
Finnland	0,21	0,20
Frankreich	2,54	2,51
Deutschland	1,56	1,98
Guernsey, Kanalinseln	0,34	0,33
Hongkong	0,12	0,27
Indien	0,21	0,25
Indonesien	0,17	0,17
Irland	0,69	0,78
Italien	1,82	2,62
Japan	2,00	1,59
Jersey, Kanalinseln	0,49	0,53
Luxemburg	1,04	2,33
Mauritius	0,09	0,37
Mexiko	0,16	0,18
Multinational	0,03	0,03

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Niederlande	2,86	2,56
Norwegen	0,19	0,13
Panama	k. A.	0,18
Peru	0,09	1,25
Polen	0,10	k. A.
Katar	0,10	0,10
Rumänien	0,35	0,31
Russland	0,00	0,02
Saudi-Arabien	0,94	0,16
Singapur	0,39	0,17
Slowakei	0,00	0,00
Slowenien	0,11	0,10
Südafrika	0,75	0,95
Südkorea	0,07	0,07
Spanien	0,19	0,25
Supranational	0,23	0,22
Schweden	0,20	0,32
Schweiz	1,83	2,23
Thailand	0,07	0,07
Türkei	0,04	0,04
Ukraine	k. A.	0,02
Vereinigte Arabische Emirate	0,08	0,08
Großbritannien	5,02	5,72
USA	51,94	51,20
Jungferninseln (Britisch)	0,40	0,40
Kurzfristige Instrumente	1,79	2,91
Investmentfonds	10,08	9,85
Pensionsgeschäfte	5,33	0,72
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,08)	(0,41)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	(0,01)	(0,07)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,08	0,01
Zinsswaps	(0,60)	(0,38)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,45
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,81)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,02	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,04	0,05
Devisenterminkontrakte	(0,30)	(0,50)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,69	0,86
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(1,29)
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,79)	(1,29)
Nettovermögen	100,00	100,00



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>												
<b>AUSTRALIEN</b>												
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>												
APPP Commercial Finance Pty. Ltd. 3,600 % fällig am 11.11.2031	AUD	800	0,02	Region Wallonne Belgium 3,500 % fällig am 15.03.2043	€	5.800	0,34	Nykredit Realkredit A/S 1,375 % fällig am 12.07.2027	€	1.650	0,09	
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3,437 % fällig am 04.04.2025	€	2.000	0,12	Summe Belgien		10.819	0,60	Orsted A/S 5,125 % fällig am 13.09.2034	£	1.300	0,08	
Boral Finance Pty. Ltd. 3,750 % fällig am 01.05.2028	\$	52	0,00	<b>KANADA</b>		24.901	1,37	Pandora A/S 4,500 % fällig am 10.04.2028	€	1.500	0,09	
Commonwealth Bank of Australia 3,743 % fällig am 12.09.2039	(g)	200	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028		5.200	0,30	
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd. 3,400 % fällig am 30.09.2026		850	0,04	Bank of Montreal 1,758 % fällig am 10.03.2026	CAD	2.900	0,11	5,618 % fällig am 06.02.2030		1.000	0,06	
Goodman Australia Finance Pty. Ltd. 1,375 % fällig am 27.09.2025	€	400	0,02	5,440 % fällig am 08.12.2023	\$	900	0,05	6,500 % fällig am 01.06.2031		2.800	0,17	
GPT Wholesale Office Fund 3,222 % fällig am 05.11.2031	AUD	1.740	0,05	Bank of Nova Scotia 4,900 % fällig am 04.06.2025	(f)(g)	3.000	0,16	Summe Dänemark		15.913	0,87	
Lendlease Finance Ltd. 3,400 % fällig am 27.10.2027		1.370	0,04	5,447 % fällig am 31.07.2024		500	0,03	<b>FINNLAND</b>				
Macquarie University 2,250 % fällig am 22.05.2030		750	0,02	Brookfield Finance, Inc. 2,724 % fällig am 15.04.2031		4.850	0,22	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
National Australia Bank Ltd. 5,200 % fällig am 13.05.2025	\$	3.800	0,21	Brookfield Property Finance ULC 7,125 % fällig am 13.02.2028		1.100	0,04	Balder Finland Oyj 1,000 % fällig am 20.01.2029		400	0,02	
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,375 % fällig am 30.04.2025		150	0,01	(h)	CAD	770	0,04	Kemira Oyj 1,000 % fällig am 30.03.2028		1.000	0,05	
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 2,450 % fällig am 16.03.2031		2.100	0,10	Canadian Imperial Bank of Commerce 4,414 % fällig am 08.06.2028	\$	3.100	0,17	Nokia Oyj 4,375 % fällig am 21.08.2031		2.800	0,17	
4,125 % fällig am 02.02.2026		600	0,03	5,062 % fällig am 13.04.2026	£	3.000	0,21	Nordea Bank Abp 1,500 % fällig am 30.09.2026	\$	1.500	0,07	
Vicinity Centres Trust 4,927 % fällig am 02.06.2028	AUD	2.500	0,09	CGI, Inc. 2,300 % fällig am 14.09.2031	\$	1.000	0,04	3,750 % fällig am 01.03.2029		3.300	0,13	
Worley Financial Services Pty. Ltd. 5,950 % fällig am 13.10.2028		1.700	0,06	Manulife Financial Corp. 3,703 % fällig am 16.03.2032		1.000	0,05	(f)(g)		2.500	0,15	
		15.170	0,83	Open Text Corp. 6,900 % fällig am 01.12.2027		1.400	0,08	6,000 % fällig am 02.06.2026	£	300	0,02	
				Toronto-Dominion Bank 1,952 % fällig am 08.04.2030	€	3.700	0,19	Tornator Oyj 1,250 % fällig am 14.10.2026	€	200	0,01	
				4,701 % fällig am 05.06.2027	\$	2.400	0,13			197	0,01	
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>		26.856	1,48			11.247	0,62	
				Canada Government International Bond 2,250 % fällig am 01.12.2029	CAD	12.200	0,47	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
				Province of Quebec 1,850 % fällig am 13.02.2027		500	0,02	Kundarahoitus Oyj 3,000 % fällig am 25.09.2028		2.200	0,13	
				Summe Kanada		35.823	1,97	Summe Finnland		13.626	0,75	
				<b>CAYMAN INSELN</b>				<b>FRANKREICH</b>				
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
				Goodman HK Finance 4,375 % fällig am 19.06.2024	\$	300	0,02	Accor S.A. 2,375 % fällig am 29.11.2028		2.500	0,13	
				Health & Happiness International Holdings Ltd. 5,625 % fällig am 24.10.2024		1.200	0,06	Altarea S.C.A. 1,875 % fällig am 17.01.2028		1.200	0,06	
				MAF Sukuk Ltd. 3,933 % fällig am 28.02.2030		400	0,02	Arkea Home Loans SFH S.A. 3,250 % fällig am 01.08.2033		9.900	0,59	
				Summe Cayman Inseln		1.777	0,10	AXA S.A. 1,375 % fällig am 07.10.2041		500	0,02	
				<b>CHILE</b>				5,500 % fällig am 11.07.2043		2.500	0,15	
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,250 % fällig am 29.06.2028		900	0,05	
				Banco de Credito e Inversiones S.A. 2,875 % fällig am 14.10.2031		3.100	0,14	1,750 % fällig am 19.12.2024	£	100	0,01	
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				3,750 % fällig am 20.07.2023	\$	3.670	0,20	
				Chile Government International Bond 1,250 % fällig am 29.01.2040	€	800	0,03	4,000 % fällig am 21.11.2029	€	2.000	0,12	
				1,250 % fällig am 22.01.2051		2.200	0,07	4,375 % fällig am 02.05.2030		1.100	0,07	
				3,500 % fällig am 25.01.2050	\$	300	0,01	BNP Paribas Home Loan SFH S.A. 3,000 % fällig am 31.01.2030		1.500	0,09	
				3,500 % fällig am 15.04.2053		1.600	0,07	BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig am 30.06.2027	\$	6.650	0,32	
				4,340 % fällig am 07.03.2042		1.000	0,05	2,219 % fällig am 09.06.2026		1.200	0,06	
						4.155	0,23	2,819 % fällig am 19.11.2025		1.300	0,07	
				Summe Chile		6.726	0,37	3,132 % fällig am 20.01.2033		2.800	0,13	
				<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>				4,625 % fällig am 25.02.2031	(f)(g)	2.100	0,08	
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				BPCE S.A. 2,045 % fällig am 19.10.2027		4.000	0,19	
				UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S 3,750 % fällig am 20.06.2028	€	4.100	0,24	3,116 % fällig am 19.10.2032		300	0,01	
				<b>DANEMARK</b>				Cie de Financement Foncier S.A. 3,125 % fällig am 17.05.2029	€	4.200	0,25	
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				CNP Assurances 1,250 % fällig am 27.01.2029		2.200	0,11	
				GN Store Nord A/S 0,875 % fällig am 25.11.2024		1.400	0,08	4,875 % fällig am 07.10.2030	(f)(g)	\$	800	0,03
								Credit Agricole Assurances S.A. 1,500 % fällig am 06.10.2031	€	3.400	0,15	
								Credit Agricole S.A. 0,125 % fällig am 09.12.2027		700	0,04	
								0,375 % fällig am 21.10.2025		400	0,02	
								5,301 % fällig am 12.07.2028	\$	1.700	0,09	
								Danone S.A. 2,589 % fällig am 02.11.2023		2.300	0,13	

**Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Electricite de France S.A.	€ 1.100	\$ 1.152	0,06	<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>HONGKONG</b>			
4,625 % fällig am 25.01.2043	€ 300	341	0,02	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			0,14	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
5,500 % fällig am 25.01.2035	\$ 1.000	1.017	0,06	Commerzbank AG	2.400	2.598	0,14	Hong Kong Government International Bond	\$ 300	204	0,01
6,250 % fällig am 23.05.2033	\$ 1.300	1.349	0,07	3,125 % fällig am 13.06.2033				3,750 % fällig am 07.06.2032	€ 3.500	3.846	0,21
6,900 % fällig am 23.05.2053	1.300	1.336	0,07	Deutsche Bahn Finance GmbH	€ 750	\$ 414	0,02	5,250 % fällig am 11.01.2053	\$ 3.200	3.580	0,20
9,125 % fällig am 15.03.2033 (f)				0,625 % fällig am 08.12.2050				<b>Summe Hongkong</b>		7.630	0,42
Engie S.A.	€ 1.000	1.081	0,06	Deutsche Bank AG				<b>INDIEN</b>			
3,625 % fällig am 11.01.2030	€ 2.000	2.177	0,12	1,447 % fällig am 01.04.2025			0,11	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,000 % fällig am 11.01.2035	2.000	2.177	0,12	(h)	\$ 2.000	1.901	0,11	Bharti Airtel Ltd.	\$ 1.200	\$ 1.167	0,06
4,250 % fällig am 11.01.2043	1.200	1.320	0,07	1,875 % fällig am 23.02.2028	€ 2.500	2.417	0,13	4,375 % fällig am 10.06.2025	\$ 1.200	\$ 1.167	0,06
Groupe des Assurances du Credit Mutuel	600	481	0,03	2,222 % fällig am 18.09.2024	\$ 100	99	0,01	Indian Railway Finance Corp. Ltd.	5.100	4.451	0,24
1,850 % fällig am 21.04.2042				2,311 % fällig am 16.11.2027	3.000	2.580	0,14	3,570 % fällig am 21.01.2032			
Holding d'Infrastructures de Transport SASU	3.000	2.675	0,15	2,552 % fällig am 07.01.2028	1.600	1.389	0,08	JSW Hydro Energy Ltd.	3.612	3.051	0,17
1,475 % fällig am 18.01.2031				3,125 % fällig am 19.05.2033	€ 1.300	1.411	0,08	4,125 % fällig am 18.05.2031			
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement	3.500	3.449	0,19	3,547 % fällig am 18.09.2031	\$ 450	374	0,02	ReNew Power Pvt Ltd.	928	870	0,05
0,125 % fällig am 16.09.2025				3,742 % fällig am 07.01.2033	1.300	954	0,05	5,875 % fällig am 05.03.2027			
JCDecaux SE	2.900	2.596	0,14	3,961 % fällig am 26.11.2025	500	477	0,03	ReNew Wind Energy AP2	3.000	2.559	0,14
1,625 % fällig am 07.02.2030				E.ON SE	€ 1.000	1.085	0,06	4,500 % fällig am 14.07.2028			
L'Oreal S.A.	2.300	2.329	0,13	3,875 % fällig am 12.01.2035				<b>Summe Indien</b>		12.098	0,66
0,875 % fällig am 29.06.2026				Eurogrid GmbH	1.000	1.059	0,06	<b>INDONESIEN</b>			
New Immo Holding S.A.	900	881	0,05	3,279 % fällig am 05.09.2031				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
2,750 % fällig am 26.11.2026				Frappot AG Frankfurt Airport Services Worldwide				Bank Mandiri Persero Tbk PT	800	724	0,04
SEB S.A.	200	213	0,01	1,625 % fällig am 09.07.2024	300	319	0,02	2,000 % fällig am 19.04.2026			
1,500 % fällig am 31.05.2024				2,125 % fällig am 09.07.2027	400	401	0,02	<b>IRLAND</b>			
Societe Generale S.A.	400	355	0,02	IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
0,500 % fällig am 12.06.2029	\$ 200	188	0,01	3,750 % fällig am 15.09.2026	300	306	0,02	OCP Euro CLO DAC	2.000	2.179	0,12
2,625 % fällig am 22.01.2025	1.050	683	0,04	(c)				4,713 % fällig am 20.01.2033			
3,625 % fällig am 01.03.2041	2.200	2.053	0,11	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	7.450	6.950	0,38	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,000 % fällig am 12.01.2027	1.500	1.486	0,08	0,000 % fällig am 15.09.2028				Abbott Ireland Financing DAC	1.600	1.656	0,09
6,096 % fällig am 21.01.2026	3.100	3.158	0,17	(d)	\$ 7.450	6.950	0,38	0,100 % fällig am 19.11.2024			
6,691 % fällig am 10.01.2034	3.100	3.158	0,17	0,750 % fällig am 30.09.2030	\$ 1.100	875	0,05	AIB Group PLC	2.800	2.773	0,15
7,367 % fällig am 10.01.2053	2.500	2.441	0,13	1,375 % fällig am 07.06.2032	€ 1.300	1.248	0,07	4,625 % fällig am 23.07.2029	2.700	2.895	0,16
7,875 % fällig am 18.12.2023	200	196	0,01	2,750 % fällig am 14.02.2033	750	806	0,04	5,750 % fällig am 16.02.2029	2.000	2.250	0,12
(f)(g)				Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	1.700	1.341	0,07	Bank of Ireland Group PLC	1.500	1.636	0,09
Suez SACA	€ 1.200	1.391	0,08	1,000 % fällig am 26.05.2042				4,875 % fällig am 16.07.2028	\$ 250	248	0,01
5,000 % fällig am 03.11.2032				Robert Bosch GmbH	1.000	1.120	0,06	6,253 % fällig am 16.09.2026	€ 3.000	3.653	0,20
Vilmorin & Cie S.A.	1.200	1.028	0,06	4,375 % fällig am 02.06.2043				7,594 % fällig am 06.12.2032	£ 3.000	3.653	0,20
1,375 % fällig am 26.03.2028				Vonovia SE				CCEP Finance Ireland DAC	€ 1.900	1.712	0,10
		93.012	5,11	0,000 % fällig am 01.12.2025	200	193	0,01	0,500 % fällig am 06.09.2029			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				(d)	1.900	1.614	0,09	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 933	927	0,05
Action Logement Services	2.500	2.327	0,13	0,250 % fällig am 01.09.2028	1.900	1.614	0,09	2,875 % fällig am 23.09.2023			
1,375 % fällig am 13.04.2032	400	413	0,02	1,375 % fällig am 28.01.2026	2.600	2.591	0,14	Smurfit Kappa Acquisitions ULC	€ 300	316	0,02
3,125 % fällig am 28.09.2037	5.000	5.386	0,30	1,625 % fällig am 01.09.2051	100	53	0,00	2,875 % fällig am 15.01.2026			
3,625 % fällig am 25.05.2043				1,875 % fällig am 28.06.2028	1.900	1.765	0,10	<b>Summe Irland</b>		18.066	0,99
Agence Francaise de Developpement	2.000	1.912	0,11	2,375 % fällig am 25.03.2032	400	356	0,02		20.245	1,11	
1,625 % fällig am 25.05.2032				ZF Finance GmbH	500	476	0,03	<b>ISRAEL</b>			
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 4.000	3.256	0,18	2,000 % fällig am 06.05.2027	1.800	1.659	0,09	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
1,375 % fällig am 20.01.2031	\$ 4.000	3.256	0,18	2,250 % fällig am 03.05.2028				Israel Discount Bank Ltd.	\$ 1.900	1.879	0,10
2,750 % fällig am 25.11.2032	€ 1.000	1.060	0,06	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				5,375 % fällig am 26.01.2028			
3,000 % fällig am 25.05.2028	1.200	1.298	0,07	<b>Land Berlin</b>				<b>ITALIEN</b>			
France Government International Bond	2.100	1.358	0,07	Bundesrepublik Deutschland	14.700	13.288	0,73	<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
0,500 % fällig am 25.06.2044	950	961	0,05	0,000 % fällig am 15.08.2031	2.000	2.407	0,13	Koromo Italy SRL	€ 1.989	2.175	0,12
2,000 % fällig am 25.11.2032				(d)				4,213 % fällig am 26.02.2035			
Region of Ile de France	1.900	1.461	0,08	4,750 % fällig am 04.07.2028				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
0,675 % fällig am 24.11.2036	4.000	4.291	0,24	2,875 % fällig am 04.07.2033	1.200	1.297	0,07	Intesa Sanpaolo SpA	€ 1.000	832	0,05
3,050 % fällig am 03.02.2033	3.900	4.335	0,24	(b)				3,625 % fällig am 30.06.2028	€ 1.400	1.518	0,08
3,700 % fällig am 14.06.2038				Land Nordrhein-Westfalen	200	144	0,01	3,875 % fällig am 12.01.2028	\$ 1.400	1.251	0,07
SNCF Reseau	500	394	0,02	0,500 % fällig am 25.11.2039	1.975	2.138	0,12	4,000 % fällig am 23.09.2029	1.300	1.131	0,06
0,750 % fällig am 25.05.2036				2,900 % fällig am 07.06.2033				4,198 % fällig am 01.06.2032	900	672	0,04
Societe Du Grand Paris EPIC	2.200	2.338	0,13	<b>Summe Deutschland</b>		22.057	1,21	4,950 % fällig am 01.06.2042	2.100	1.385	0,08
3,500 % fällig am 25.05.2043	2.000	2.193	0,12			60.888	3,35	5,017 % fällig am 26.06.2024	4.600	4.457	0,25
3,700 % fällig am 25.05.2053				<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>				6,625 % fällig am 31.05.2033	€ 900	1.099	0,06
Societe Nationale SNCF S.A.	5.600	6.024	0,33	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,625 % fällig am 20.06.2033	\$ 800	798	0,04
3,125 % fällig am 02.11.2027	4.100	4.480	0,25	Globalworth Real Estate Investments Ltd.	1.850	1.522	0,08	7,778 % fällig am 20.06.2054	400	399	0,02
3,375 % fällig am 25.05.2033				2,950 % fällig am 29.07.2026				Mundys SpA	€ 2.900	2.705	0,15
UNEDIC ASSEO	300	262	0,01	Sirius Real Estate Ltd.	1.100	992	0,06	1,875 % fällig am 12.02.2028			
0,000 % fällig am 19.11.2030	1.000	774	0,04	1,125 % fällig am 22.06.2026	2.300	1.792	0,10	Nexi SpA	1.600	1.459	0,08
0,250 % fällig am 16.07.2035				1,750 % fällig am 24.11.2028				2,125 % fällig am 30.04.2029			
<b>Summe Frankreich</b>		137.535	7,56	<b>Summe Guernsey, Kanalinseln</b>		4.306	0,24	Snam SpA	500	452	0,02

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
UniCredit SpA				CPI Property Group S.A.				1,500 % fällig am 27.09.2031			
1,982 % fällig am 03.06.2027	\$ 1.900	\$ 1.675	0,09	1,500 % fällig am 27.01.2031	500	297	0,02	Digital Dutch Finco BV			
3,500 % fällig am 31.07.2030	€ 2.500	2.698	0,15	1,625 % fällig am 23.04.2027	700	558	0,03	1,000 % fällig am 15.01.2032	350	270	0,01
4,625 % fällig am 12.04.2027	\$ 1.000	951	0,05	1,750 % fällig am 14.01.2030	3.050	2.020	0,11	1,250 % fällig am 01.02.2031	1.900	1.550	0,09
5,459 % fällig am 30.06.2035	1.300	1.104	0,06	2,750 % fällig am 12.05.2026	1.062	943	0,05	Digital Intrepid Holding BV			
7,296 % fällig am 02.04.2034	3.400	3.206	0,18	2,750 % fällig am 22.01.2028	€ 350	298	0,02	0,625 % fällig am 15.07.2031	1.600	1.215	0,07
		27.792	1,53	Logicor Financing SARL				1,375 % fällig am 18.07.2032	1.000	782	0,04
Summe Italien		29.967	1,65	1,625 % fällig am 17.01.2030	€ 500	404	0,02	Enel Finance International NV			
				2,000 % fällig am 17.01.2034	2.900	2.105	0,12	1,875 % fällig am 12.07.2028	\$ 1.700	1.427	0,08
<b>JAPAN</b>				Segro Capital SARL				2,250 % fällig am 12.07.2031	2.300	1.804	0,10
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				1,875 % fällig am 23.03.2030	950	871	0,05	2,650 % fällig am 10.09.2024	200	193	0,01
Central Japan Railway Co.				SELP Finance SARL				2,875 % fällig am 11.04.2029	€ 3.100	3.275	0,18
3,400 % fällig am 06.09.2023	500	498	0,03	0,875 % fällig am 27.05.2029	1.950	1.664	0,09	4,250 % fällig am 15.06.2025	\$ 1.900	1.845	0,10
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.						16.369	0,90	7,750 % fällig am 14.10.2052	2.000	2.346	0,13
0,337 % fällig am 08.06.2027	€ 900	873	0,05	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Holcim Sterling Finance Netherlands BV			
0,339 % fällig am 19.07.2024	200	210	0,01	Großherzogtum Luxemburg				2,250 % fällig am 04.04.2034	€ 1.800	1.580	0,09
0,962 % fällig am 20.07.2027	\$ 400	373	0,02	0,000 % fällig am 14.09.2032				Iberdrola International BV			
0,980 % fällig am 09.10.2023	€ 300	325	0,02	(d)	2.000	1.668	0,09	6,750 % fällig am 15.09.2033	\$ 1.200	1.271	0,07
1,538 % fällig am 20.07.2027	€ 1.650	1.457	0,08	Summe Luxemburg		18.037	0,99	ING Groep NV			
1,640 % fällig am 13.10.2027	300	264	0,01	<b>MAURITIUS</b>				1,250 % fällig am 16.02.2027	€ 1.200	1.199	0,07
2,048 % fällig am 17.07.2030	700	568	0,03	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				1,400 % fällig am 01.07.2026	\$ 1.800	1.640	0,09
2,341 % fällig am 19.01.2028	900	806	0,04	India Green Energy Holdings				1,726 % fällig am 01.04.2027	1.900	1.694	0,09
2,494 % fällig am 13.10.2032	2.900	2.334	0,13	5,375 % fällig am 29.04.2024	\$ 3.550	3.471	0,19	2,125 % fällig am 23.05.2026	€ 2.700	2.810	0,15
2,757 % fällig am 13.09.2026	3.932	3.601	0,20	India Green Power Holdings				3,875 % fällig am 16.05.2027			
3,273 % fällig am 19.09.2025	€ 2.000	2.150	0,12	4,000 % fällig am 22.02.2027	1.200	1.050	0,06	(f)(g)	\$ 200	143	0,01
3,837 % fällig am 17.04.2026	\$ 1.400	1.347	0,07	Summe Mauritius		4.521	0,25	4,125 % fällig am 24.08.2033	€ 2.100	2.162	0,12
5,475 % fällig am 22.02.2031	200	199	0,01	<b>MEXIKO</b>				4,250 % fällig am 16.04.2025	\$ 1.000	668	0,04
Mizuho Financial Group, Inc.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				(f)(g)			
0,184 % fällig am 13.04.2026	€ 600	586	0,03	Banco Mercantil del Norte S.A.				6,500 % fällig am 16.04.2052	€ 4.100	3.171	0,17
1,020 % fällig am 11.10.2023	100	108	0,01	6,625 % fällig am 24.01.2032				5,000 % fällig am 12.06.2033	€ 200	222	0,01
1,241 % fällig am 10.07.2024	\$ 800	800	0,04	(f)(g)	1.800	1.393	0,08	JDE Peet's NV			
2,201 % fällig am 10.07.2031	2.900	2.324	0,13	Metalsa S.A. de C.V.				1,125 % fällig am 16.06.2033	300	246	0,01
2,839 % fällig am 13.09.2026	8.261	7.574	0,42	3,750 % fällig am 04.05.2031	2.900	2.286	0,12	2,250 % fällig am 24.09.2031	\$ 1.000	775	0,04
3,170 % fällig am 11.09.2027	1.850	1.697	0,09	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				LeasePlan Corp. NV			
3,261 % fällig am 22.05.2030	4.800	4.240	0,23	Mexico Government International Bond				0,250 % fällig am 07.09.2026	€ 3.500	3.361	0,18
6,123 % fällig am 08.09.2024	550	550	0,03	6,338 % fällig am 04.05.2053	2.000	2.042	0,11	1,375 % fällig am 07.03.2024	800	855	0,05
Nippon Life Insurance Co.				Summe Mexiko		5.721	0,31	Mondelez International Holdings Netherlands BV			
2,900 % fällig am 16.09.2051	700	572	0,03	<b>MULTINATIONAL</b>				0,250 % fällig am 09.09.2029	2.000	1.778	0,10
Nomura Holdings, Inc.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Nationale-Niederlande Bank NV			
2,172 % fällig am 14.07.2028	4.100	3.463	0,19	NXP BV				0,500 % fällig am 21.09.2028	3.200	2.894	0,16
2,329 % fällig am 22.01.2027	3.900	3.451	0,19	2,500 % fällig am 11.05.2031	2.660	2.169	0,12	1,875 % fällig am 17.05.2032	500	489	0,03
Norinchukin Bank				3,875 % fällig am 18.06.2026	150	144	0,01	3,250 % fällig am 28.05.2027	2.000	2.163	0,12
1,284 % fällig am 22.09.2026	2.000	1.754	0,10	5,000 % fällig am 15.01.2033	6.500	6.245	0,34	NE Property BV			
2,080 % fällig am 22.09.2031	800	644	0,04	Summe multinational		8.558	0,47	2,000 % fällig am 20.01.2030	4.200	3.391	0,19
NTT Finance Corp.				<b>NIEDERLANDE</b>				3,375 % fällig am 14.07.2027	600	588	0,03
4,142 % fällig am 26.07.2024	2.900	2.855	0,16	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				NN Group NV			
4,239 % fällig am 25.07.2025	300	292	0,02	ABB Finance BV				4,500 % fällig am 15.01.2026	200	211	0,01
4,372 % fällig am 27.07.2027	800	783	0,04	3,250 % fällig am 16.01.2027	€ 800	859	0,05	(f)	200	211	0,01
ORIX Corp.				ABN AMRO Bank NV				4,625 % fällig am 13.01.2048	200	211	0,01
1,919 % fällig am 20.04.2026	€ 3.000	3.077	0,17	2,470 % fällig am 13.12.2029	\$ 7.800	6.538	0,36	Prosus NV			
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				4,000 % fällig am 18.01.2028	€ 400	428	0,02	2,085 % fällig am 19.01.2030	1.300	1.112	0,06
0,465 % fällig am 30.05.2024	300	317	0,02	4,750 % fällig am 28.07.2025	\$ 1.500	1.448	0,08	2,778 % fällig am 19.01.2034	200	161	0,01
0,819 % fällig am 23.07.2023	900	980	0,05	5,250 % fällig am 26.05.2026	€ 2.000	2.462	0,14	3,257 % fällig am 19.01.2027	\$ 2.200	1.989	0,11
2,130 % fällig am 08.07.2030	\$ 2.300	1.874	0,10	Achmea Bank NV				Siemens Energy Finance BV			
2,348 % fällig am 15.01.2025	3.000	2.846	0,16	3,000 % fällig am 31.01.2030	€ 2.100	2.245	0,12	4,000 % fällig am 05.04.2026	€ 2.500	2.668	0,15
2,472 % fällig am 14.01.2029	4.800	4.098	0,22	Akzo Nobel NV				Sika Capital BV			
3,010 % fällig am 19.10.2026	1.395	1.290	0,07	2,000 % fällig am 28.03.2032	750	698	0,04	3,750 % fällig am 03.11.2026	2.000	2.169	0,12
3,202 % fällig am 17.09.2029				Arcadis NV				Stedin Holding NV			
(g)	400	349	0,02	4,875 % fällig am 28.02.2028	1.900	2.073	0,11	0,500 % fällig am 14.11.2029	100	90	0,00
6,125 % fällig am 19.07.2023	100	100	0,01	CNH Industrial NV				Telefonica Europe BV			
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				4,500 % fällig am 15.08.2023	\$ 1.650	\$ 1.647	0,09	6,135 % fällig am 03.02.2030	2.500	2.638	0,15
1,350 % fällig am 16.09.2026	2.500	2.195	0,12	Compass Group Finance Netherlands BV				(f)			
2,800 % fällig am 10.03.2027	1.200	1.104	0,06	3,000 % fällig am 08.03.2030	€ 1.700	1.771	0,10	TenneT Holding BV			
3,629 % fällig am 06.04.2026	€ 3.500	3.772	0,21	Cooperatieve Rabobank UA				4,250 % fällig am 28.04.2032	1.000	1.145	0,06
		68.700	3,78	1,004 % fällig am 24.09.2026	\$ 3.500	3.128	0,17				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				1,106 % fällig am 24.02.2027	800	708	0,04				
Japan Finance Organization for Municipalities				3,649 % fällig am 06.04.2028	3.400	3.151	0,17				
3,375 % fällig am 22.02.2028	2.100	2.270	0,12	4,375 % fällig am 29.06.2027							
Summe Japan		70.970	3,90	(f)(g)	€ 1.000	955	0,05				
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				4,875 % fällig am 29.06.2029							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				(f)(g)	2.800	2.572	0,14				
Aptiv PLC				5,250 % fällig am 14.09.2027	€ 1.200	1.418	0,08				
3,100 % fällig am 01.12.2051	\$ 1.800	1.133	0,06	CTP NV							
<b>LUXEMBURG</b>				0,500 % fällig am 21.06.2025	€ 3.800	3.696	0,20				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,875 % fällig am 20.01.2026	2.900	2.702	0,15				
Acef Holding S.C.A.				1,250 % fällig am 21.06.2029	500	396	0,02				
0,750 % fällig am 14.06.2028	€ 1.700	\$ 1.519	0,08								
1,250 % fällig am 26.04.2030	2.650	2.216	0,12								
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan											
European Core Fund											
0,500 % fällig am 27.01.2028	600	518	0,03								
0,900 % fällig am 12.10.2029	3.700	2.956	0,16								

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>Thermo Fisher Scientific Finance BV</b> 1,625 % fällig am 18.10.2041	€ 700	\$ 526	0,03	<b>SINGAPUR</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Caja Rural de Navarra SCC</b> 3,000 % fällig am 26.04.2027	€ 1.700	\$ 1.806	0,10
<b>Universal Music Group NV</b> 4,000 % fällig am 13.06.2031	600	653	0,04	<b>Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.</b> 4,250 % fällig am 25.03.2027	\$ 1.209	\$ 1.062	0,06	<b>Cellex Finance Co. S.A.</b> 3,875 % fällig am 07.07.2041	\$ 1.000	734	0,04
<b>Van Lanschot Kempen NV</b> 3,500 % fällig am 31.05.2026	1.000	1.082	0,06	<b>Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.</b> 5,340 % fällig am 19.05.2063	1.250	1.266	0,07	<b>Werfen S.A.</b> 4,625 % fällig am 06.06.2028	€ 2.200	2.370	0,13
<b>Vesteda Finance BV</b> 0,750 % fällig am 18.10.2031	5.300	4.378	0,24	<b>SingTel Group Treasury Pte. Ltd.</b> 3,875 % fällig am 28.08.2028	900	863	0,05			20.990	1,16
<b>Vonovia Finance BV</b> 0,500 % fällig am 14.09.2029	100	82	0,00	<b>United Overseas Bank Ltd.</b> 3,863 % fällig am 07.10.2032	(g) 4.000	3.750	0,20	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>1,125 % fällig am 14.09.2034</b>	200	142	0,01	<b>Summe Singapur</b>		<b>6.941</b>	<b>0,38</b>	<b>Autonomous Community of Andalusia</b> 3,950 % fällig am 30.04.2033	2.500	2.787	0,15
<b>Wabtec Transportation Netherlands BV</b> 1,250 % fällig am 03.12.2027	4.200	3.983	0,22	<b>SUDKOREA</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Junta de Castilla y Leon</b> 3,500 % fällig am 30.04.2033		1.503	0,08
<b>WPC Eurobond BV</b> 1,350 % fällig am 15.04.2028	300	278	0,02	<b>Hana Bank</b> 3,750 % fällig am 04.05.2026	€ 7.500	8.103	0,45	<b>Spain Government International Bond</b> 1,000 % fällig am 30.07.2042	3.170	2.181	0,12
		<b>112.404</b>	<b>6,18</b>	<b>KB Kookmin Card Co. Ltd.</b> 1,500 % fällig am 13.05.2026	\$ 2.600	2.303	0,13	<b>Xunta de Galicia</b> 0,084 % fällig am 30.07.2027	150	143	0,01
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>Kodit Global Co. Ltd.</b> 4,954 % fällig am 25.05.2026	3.700	3.643	0,20			<b>6.614</b>	<b>0,36</b>
<b>Green Storm BV</b> 4,138 % fällig am 22.02.2068	200	220	0,01	<b>Kookmin Bank</b> 2,500 % fällig am 04.11.2030	(g) 900	731	0,04	<b>Summe Spanien</b>		<b>27.604</b>	<b>1,52</b>
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>(g)</b> <b>Shinhan Bank Co. Ltd.</b> 1,183 % fällig am 29.09.2025	AUC 1.100	666	0,04	<b>SUPRANATIONAL</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>BNG Bank NV</b> 0,050 % fällig am 20.11.2029	700	628	0,03	<b>4,000 % fällig am 23.04.2029</b>	(g) \$ 1.100	1.003	0,05	<b>Asian Development Bank</b> 1,500 % fällig am 04.05.2028	CAC 2.000	1.347	0,07
<b>0,500 % fällig am 26.11.2025</b>	500	508	0,03	<b>(g)</b> 4,375 % fällig am 13.04.2032	(g) 2.200	2.006	0,11	<b>6,550 % fällig am 26.01.2025</b>	ZAR 64.000	3.246	0,18
<b>3,000 % fällig am 11.01.2033</b>	5.000	5.403	0,30	<b>(g)</b> 5,862 % fällig am 16.11.2025	AUC 1.500	1.018	0,06	<b>Banque Ouest Africaine de Developpement</b> 2,750 % fällig am 22.01.2033	€ 800	637	0,03
<b>3,500 % fällig am 19.05.2028</b>	\$ 1.600	1.540	0,08	<b>(g)</b> Shinhan Financial Group Co. Ltd.	\$ 300	270	0,01	<b>Eurofima Europäische Gesellschaft für die Finanzierung von Eisenbahnmaterial</b> 0,000 % fällig am 28.07.2026	(d) 1.000	978	0,05
<b>Nederlandse Waterschapsbank NV</b> 0,125 % fällig am 03.09.2035	€ 2.000	1.517	0,08	<b>1,350 % fällig am 10.01.2026</b>	\$ 500	499	0,03	<b>3,125 % fällig am 09.11.2031</b>	3.200	3.473	0,19
<b>2,750 % fällig am 17.12.2029</b>	500	532	0,03	<b>SK Broadband Co. Ltd.</b> 3,875 % fällig am 13.08.2023	500	499	0,03	<b>Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung</b> 1,500 % fällig am 13.02.2025	\$ 880	831	0,05
<b>3,000 % fällig am 20.04.2033</b>	6.500	7.036	0,39	<b>SK Hynix, Inc.</b> 1,000 % fällig am 19.01.2024	600	583	0,03	<b>1,625 % fällig am 27.09.2024</b>	500	477	0,03
		<b>17.164</b>	<b>0,94</b>	<b>2,375 % fällig am 19.01.2031</b>	1.000	772	0,04	<b>Europäische Investitionsbank</b> 0,750 % fällig am 15.07.2027	AUC 2.100	1.205	0,07
<b>Summe Niederlande</b>		<b>129.788</b>	<b>7,13</b>	<b>6,375 % fällig am 17.01.2028</b>	4.400	4.420	0,24	<b>1,500 % fällig am 15.06.2032</b>	€ 3.000	2.887	0,16
<b>NORWEGEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>26.017</b>	<b>1,43</b>			<b>Europäische Union</b> 0,000 % fällig am 04.11.2025	(d) 1.400	1.414	0,08
<b>DNB Bank ASA</b> 0,375 % fällig am 18.01.2028	2.400	2.302	0,13	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>(d)</b> 0,000 % fällig am 04.10.2030	(d) 3.700	3.258	0,18
<b>PERU</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Export-Import Bank of Korea</b> 2,125 % fällig am 18.01.2032	2.000	1.639	0,09	<b>(d)</b> 0,000 % fällig am 04.07.2035	(d) 1.700	1.281	0,07
<b>Peru Government International Bond</b> 1,950 % fällig am 17.11.2036	2.000	1.583	0,09	<b>3,600 % fällig am 11.01.2033</b>	3.600	3.693	0,20	<b>(d)</b> 0,300 % fällig am 04.11.2050	1.900	1.017	0,06
<b>PHILIPPINEN</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Korea Expressway Corp.</b> 1,125 % fällig am 17.05.2026	1.000	886	0,05	<b>0,400 % fällig am 04.02.2037</b>	2.150	1.643	0,09
<b>Philippines Government International Bond</b> 5,500 % fällig am 17.01.2048	\$ 3.900	4.007	0,22	<b>Korea Housing Finance Corp.</b> 0,010 % fällig am 05.02.2025	€ 400	408	0,02	<b>1,250 % fällig am 04.02.2043</b>	8.000	6.287	0,34
<b>POLEN</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>4,625 % fällig am 24.02.2028</b>	\$ 2.200	2.169	0,12	<b>2,625 % fällig am 04.02.2048</b>	2.880	2.840	0,16
<b>Poland Government International Bond</b> 4,875 % fällig am 04.10.2033	1.500	1.475	0,08	<b>Korea Water Resources Corp.</b> 3,500 % fällig am 27.04.2025	3.500	3.375	0,19	<b>2,750 % fällig am 04.02.2033</b>	2.370	2.529	0,14
<b>RUMÄNIEN</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Summe Südkorea</b>		<b>12.170</b>	<b>0,67</b>	<b>2,750 % fällig am 04.12.2037</b>	10.000	10.391	0,57
<b>Romania Government International Bond</b> 1,375 % fällig am 02.12.2029	€ 500	424	0,02	<b>Spanien</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung</b> 0,125 % fällig am 03.01.2051	1.600	780	0,04
<b>1,750 % fällig am 13.07.2030</b>	2.500	2.086	0,12	<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b> 5,862 % fällig am 14.09.2026	1.200	1.184	0,07	<b>2,900 % fällig am 19.01.2033</b>	2.400	2.575	0,14
<b>2,625 % fällig am 02.12.2040</b>	3.400	2.265	0,12	<b>6,138 % fällig am 14.09.2028</b>	1.000	1.003	0,06	<b>3,100 % fällig am 14.04.2038</b>	2.900	3.130	0,17
<b>3,750 % fällig am 07.02.2034</b>	900	796	0,04	<b>Banco de Sabadell S.A.</b> 5,125 % fällig am 10.11.2028	€ 1.500	1.651	0,09	<b>Summe Supranational</b>		<b>52.226</b>	<b>2,87</b>
<b>4,625 % fällig am 03.04.2049</b>	100	84	0,01	<b>Banco Santander S.A.</b> 0,625 % fällig am 24.06.2029	800	725	0,04	<b>SCHWEDEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>5,000 % fällig am 27.09.2026</b>	400	438	0,02	<b>2,750 % fällig am 12.09.2023</b>	£ 400	505	0,03	<b>EQT AB</b> 0,875 % fällig am 14.05.2031	3.200	2.490	0,14
<b>Summe Rumänien</b>		<b>6.093</b>	<b>0,33</b>	<b>3,490 % fällig am 28.05.2030</b>	£ 400	349	0,02	<b>2,375 % fällig am 06.04.2028</b>	1.000	962	0,05
<b>SERBIEN</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>3,625 % fällig am 21.03.2029</b>	(f)(g) € 600	432	0,02	<b>2,875 % fällig am 06.04.2032</b>	3.000	2.613	0,14
<b>Serbia Government International Bond</b> 1,000 % fällig am 23.09.2028	1.500	1.270	0,07	<b>(f)(g)</b> 4,125 % fällig am 12.11.2027	(f)(g) € 1.000	820	0,05	<b>Sagax AB</b> 1,125 % fällig am 30.01.2027	800	737	0,04
<b>1,650 % fällig am 03.03.2033</b>	400	291	0,02	<b>(f)(g)</b> 4,175 % fällig am 24.03.2028	\$ 2.000	1.874	0,10	<b>Skandinaviska Enskilda Banken AB</b> 4,000 % fällig am 09.11.2026	1.500	1.618	0,09
<b>Summe Serbien</b>		<b>1.561</b>	<b>0,09</b>	<b>(f)(g)</b> 4,375 % fällig am 14.01.2026	€ 400	367	0,02	<b>Svenska Handelsbanken AB</b> 0,125 % fällig am 03.11.2026	300	289	0,02
				<b>Bankinter S.A.</b> 0,625 % fällig am 06.10.2027	1.000	932	0,05	<b>Volvo Car AB</b> 2,500 % fällig am 07.10.2027	1.400	1.386	0,08
				<b>CaixaBank S.A.</b> 0,625 % fällig am 21.01.2028	3.000	2.884	0,16			<b>10.095</b>	<b>0,56</b>
				<b>0,750 % fällig am 10.07.2026</b>	600	609	0,03	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				<b>1,500 % fällig am 03.12.2026</b>	£ 700	769	0,04	<b>Kommuninvest Sverige AB</b> 3,375 % fällig am 15.03.2027	700	765	0,04
				<b>4,625 % fällig am 16.05.2027</b>	€ 1.000	1.081	0,06	<b>Sweden Government International Bond</b> 0,125 % fällig am 09.09.2030	SEK 9.000	704	0,04
				<b>5,375 % fällig am 14.11.2030</b>	100	112	0,01			<b>1.469</b>	<b>0,08</b>
				<b>5,875 % fällig am 09.10.2027</b>	(f)(g) 800	783	0,04	<b>Summe Schweden</b>		<b>11.564</b>	<b>0,64</b>





# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS
5,150 % fällig am 02.03.2028	\$ 2.800	\$ 2.799	0,15	Cigna Group	\$ 163	\$ 163	0,01	Equifax, Inc.	\$ 1.200	\$ 1.183	0,06
5,250 % fällig am 02.03.2030	4.400	4.412	0,24	3,750 % fällig am 15.07.2023				5,100 % fällig am 01.06.2028			
5,600 % fällig am 02.03.2043	1.600	1.606	0,09	Citigroup, Inc.	1.400	1.129	0,06	2,500 % fällig am 15.05.2031	1.600	1.304	0,07
5,650 % fällig am 02.03.2053	50	51	0,00	2,520 % fällig am 03.11.2032				Erquinix, Inc.			
5,750 % fällig am 02.03.2063	100	102	0,01	2,572 % fällig am 03.06.2031				Equitable Financial Life Global Funding			
Apple, Inc.				(h)	8.100	6.762	0,37	0,600 % fällig am 16.06.2028	€ 1.300	1.194	0,07
2,200 % fällig am 11.09.2029	1.961	1.722	0,09	4,658 % fällig am 24.05.2028	0	0	0,00	1,300 % fällig am 12.07.2026	\$ 4.450	3.884	0,21
4,150 % fällig am 10.05.2030	1.050	1.034	0,06	5,746 % fällig am 25.01.2026				5,500 % fällig am 02.12.2025	1.600	1.580	0,09
4,300 % fällig am 10.05.2033	550	547	0,03	(h)	2.000	1.992	0,11	ERAC USA Finance LLC			
Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc.				6,270 % fällig am 17.11.2033				3,800 % fällig am 01.11.2025	5.000	4.785	0,26
3,600 % fällig am 15.09.2051	550	378	0,02	(h)	0	0	0,00	Essential Properties LP			
Astrazeneca Finance LLC				6,462 % fällig am 24.05.2025	1.400	1.406	0,08	2,950 % fällig am 15.07.2031	200	150	0,01
1,750 % fällig am 28.05.2028	100	87	0,00	Citizens Bank N.A.				Eversource Energy			
4,900 % fällig am 03.03.2030	1.300	1.303	0,07	5,284 % fällig am 26.01.2026	3.650	3.390	0,19	1,650 % fällig am 15.08.2030	800	635	0,03
AT&T, Inc.				Clearway Energy Operating LLC				F&G Global Funding			
3,550 % fällig am 15.09.2055	246	172	0,01	3,750 % fällig am 17.11.2033	700	571	0,03	2,300 % fällig am 11.04.2027	700	619	0,03
4,300 % fällig am 15.02.2030	1.300	1.235	0,07	Comcast Corp.				FactSet Research Systems, Inc.			
4,850 % fällig am 25.05.2047				4,650 % fällig am 15.02.2033	3.810	3.784	0,21	3,450 % fällig am 01.03.2032	4.100	3.492	0,19
(h)	CAD 1.500	1.015	0,06	5,500 % fällig am 15.05.2064	2.000	2.030	0,11	Farmers Exchange Capital			
Autodesk, Inc.				CommonSpirit Health				5,454 % fällig am 15.10.2054	400	352	0,02
2,400 % fällig am 15.12.2031	\$ 2.900	2.375	0,13	2,782 % fällig am 01.10.2030	600	505	0,03	Fifth Third Bancorp			
Bank of America Corp.				Commonwealth Edison Co.				6,361 % fällig am 17.07.2028	2.200	2.192	0,12
0,583 % fällig am 24.08.2028	€ 200	187	0,01	2,200 % fällig am 01.03.2030	1.000	846	0,05	First American Financial Corp.			
1,102 % fällig am 24.05.2032	300	258	0,01	Community Preservation Corp.				2,400 % fällig am 15.08.2031	3.600	2.741	0,15
1,734 % fällig am 22.07.2027	\$ 300	268	0,01	2,867 % fällig am 01.02.2030	1.225	1.028	0,06	4,000 % fällig am 15.05.2030	700	614	0,03
1,898 % fällig am 23.07.2031	2.700	2.151	0,12	Continental Wind LLC				Fiserv, Inc.			
2,087 % fällig am 14.06.2029	2.400	2.049	0,11	6,000 % fällig am 28.02.2033	2.406	2.433	0,13	3,000 % fällig am 01.07.2031	€ 100	102	0,01
2,299 % fällig am 21.07.2032	600	480	0,03	Corebridge Financial, Inc.				Ford Motor Credit Co. LLC			
2,456 % fällig am 22.10.2025	1.700	1.624	0,09	3,900 % fällig am 05.04.2032	7.150	6.222	0,34	1,744 % fällig am 19.07.2024	€ 900	951	0,05
2,687 % fällig am 22.04.2032	6.600	5.472	0,30	Corporate Office Properties LP				3,021 % fällig am 06.03.2024	300	323	0,02
2,824 % fällig am 27.04.2033	700	681	0,04	2,000 % fällig am 15.01.2029	700	534	0,03	4,174 % fällig am 01.12.2024	200	216	0,01
2,884 % fällig am 22.10.2030	\$ 1.100	948	0,05	2,250 % fällig am 15.03.2026	500	443	0,02	4,535 % fällig am 06.03.2025	€ 400	484	0,03
3,384 % fällig am 04.02.2033	300	250	0,01	2,750 % fällig am 15.04.2031	400	304	0,02	FS KKR Capital Corp.			
3,458 % fällig am 15.03.2025	7.800	7.481	0,42	Crown Castle, Inc.				3,125 % fällig am 12.10.2028	\$ 1.300	1.060	0,06
3,559 % fällig am 23.04.2027	1.100	1.078	0,06	2,500 % fällig am 15.07.2031	1.000	822	0,05	Gap, Inc.			
4,412 % fällig am 24.08.2025	€ 1.400	1.533	0,08	3,250 % fällig am 15.01.2051	600	410	0,02	3,625 % fällig am 01.10.2029	2.550	1.805	0,10
5,015 % fällig am 22.07.2033	\$ 4.900	4.796	0,26	5,000 % fällig am 11.01.2028	2.600	2.554	0,14	Gilead Sciences, Inc.			
6,204 % fällig am 10.11.2028	4.060	4.176	0,23	5,200 % fällig am 15.02.2049	100	93	0,01	2,500 % fällig am 01.09.2023	875	870	0,05
Bank of New York Mellon Corp.				CVS Health Corp.				Goldman Sachs Group, Inc.			
4,543 % fällig am 01.02.2029	4.300	4.189	0,23	4,300 % fällig am 25.03.2028	192	185	0,01	1,000 % fällig am 16.12.2025	€ 200	235	0,01
4,706 % fällig am 01.02.2034	2.800	2.691	0,15	5,125 % fällig am 21.02.2030	3.800	3.776	0,21	1,000 % fällig am 18.03.2033	€ 600	488	0,03
5,802 % fällig am 25.10.2028	3.500	3.570	0,20	CVS Pass-Through Trust				1,500 % fällig am 07.12.2027	€ 800	823	0,05
Baxter International, Inc.				4,163 % fällig am 11.08.2036	113	97	0,01	1,542 % fällig am 10.09.2027	\$ 400	352	0,02
5,351 % fällig am 01.12.2023	350	349	0,02	Dell International LLC				1,875 % fällig am 16.12.2030	€ 1.100	1.038	0,06
Blackstone Holdings Finance Co. LLC				3,375 % fällig am 15.12.2041	1.470	1.038	0,06	1,992 % fällig am 27.01.2032	\$ 1.000	788	0,04
2,850 % fällig am 05.08.2051	600	345	0,02	6,020 % fällig am 15.06.2026	1.200	1.220	0,07	2,383 % fällig am 07.12.2027	900	721	0,04
6,200 % fällig am 22.04.2033	400	409	0,02	8,350 % fällig am 15.07.2046	25	31	0,00	2,615 % fällig am 22.04.2032	7.400	6.071	0,33
Blue Owl Finance LLC				Digital Euro Finco LLC				2,640 % fällig am 24.02.2028	3.300	2.997	0,16
3,125 % fällig am 10.06.2031	200	152	0,01	2,500 % fällig am 16.01.2026	€ 950	966	0,05	2,650 % fällig am 21.10.2032	900	734	0,04
BlueHub Loan Fund, Inc.				Digital Realty Trust LP				3,102 % fällig am 24.02.2033	1.100	930	0,05
3,099 % fällig am 01.01.2030	650	533	0,03	3,600 % fällig am 01.07.2029	\$ 1.500	1.334	0,07	3,125 % fällig am 25.07.2029	€ 400	425	0,02
Booking Holdings, Inc.				Digital Stout Holding LLC				3,691 % fällig am 05.06.2028	\$ 500	470	0,03
0,100 % fällig am 08.03.2025	€ 500	511	0,03	3,300 % fällig am 19.07.2029	€ 100	103	0,01	3,750 % fällig am 30.04.2024	€ 300	327	0,02
4,125 % fällig am 12.05.2033	600	652	0,04	3,750 % fällig am 17.10.2030	400	415	0,02	5,236 % fällig am 02.05.2024	AUD 2.000	1.334	0,07
Boston Properties LP				Discover Bank				Goodman U.S. Finance Five LLC			
2,550 % fällig am 01.04.2032	\$ 930	702	0,04	3,450 % fällig am 27.07.2026	\$ 3.860	3.555	0,20	4,625 % fällig am 04.05.2032	\$ 4.100	3.773	0,21
6,500 % fällig am 15.01.2034	2.800	2.820	0,15	4,200 % fällig am 08.08.2023	2.000	1.996	0,11	Great-West Lifeco Finance LP			
Brandywine Operating Partnership LP				Discovery Communications LLC				4,047 % fällig am 17.05.2028	500	468	0,03
3,950 % fällig am 15.11.2027	500	397	0,02	4,875 % fällig am 01.04.2043	1.900	1.548	0,08	Haleon U.S. Capital LLC			
Bush Foundation				Doris Duke Charitable Foundation				3,375 % fällig am 24.03.2029	2.550	2.319	0,13
2,754 % fällig am 01.10.2050	375	252	0,01	2,345 % fällig am 01.07.2050	400	244	0,01	Hanover Insurance Group, Inc.			
Capital One Financial Corp.				DTE Electric Co.				2,500 % fällig am 01.09.2030	300	237	0,01
5,468 % fällig am 01.02.2029	100	96	0,01	1,900 % fällig am 01.04.2028	1.500	1.314	0,07	HAT Holdings LLC			
6,377 % fällig am 08.06.2034	2.200	2.185	0,12	3,250 % fällig am 01.04.2051	1.100	797	0,04	3,375 % fällig am 15.06.2026	255	229	0,01
CBRE Services, Inc.				3,950 % fällig am 01.03.2049	700	577	0,03	3,750 % fällig am 15.09.2030	3.200	2.514	0,14
2,500 % fällig am 01.04.2031	1.000	805	0,04	Duke Energy Florida LLC				HCA, Inc.			
Centene Corp.				2,500 % fällig am 01.12.2029	300	259	0,01	4,125 % fällig am 15.06.2029	4.700	4.352	0,24
2,625 % fällig am 01.08.2031	600	479	0,03	Duke Energy Progress LLC				4,500 % fällig am 15.02.2027	1.700	1.641	0,09
3,000 % fällig am 15.10.2030	8.700	7.258	0,40	3,450 % fällig am 15.03.2029	1.300	1.193	0,07	5,000 % fällig am 15.03.2024	2.000	1.988	0,11
CenterPoint Energy Houston Electric LLC				Elevance Health, Inc.				Healthpeak OP LLC			
5,300 % fällig am 01.04.2053	5.250	5.375	0,30	2,875 % fällig am 15.09.2029	1.812	1.598	0,09	2,125 % fällig am 01.12.2028	1.750	1.477	0,08
Charles Schwab Corp.				Eli Lilly & Co.				Host Hotels & Resorts LP			
2,000 % fällig am 20.03.2028	300	259	0,01	1,375 % fällig am 14.09.2061	€ 700	405	0,02	2,900 % fällig am 15.12.2031	2.200	1.733	0,10
4,000 % fällig am 01.12.2030				Empower Finance LP				3,375 % fällig am 15.12.2029	5.800	4.962	0,27
(f)	1.400	1.028	0,06	1,776 % fällig am 17.03.2031	\$ 0	0	0,00	3,875 % fällig am 01.04.2024	100	98	0,01
5,643 % fällig am 19.05.2029	600	600	0,03	Enel Finance America LLC				4,000 % fällig am 15.06.2025	500	481	0,03
5,853 % fällig am 19.05.2034	600	609	0,03	7,100 % fällig am 14.10.2027	1.250	1.314	0,07	4,500 % fällig am 01.02.2026	100	97	0,01
Church & Dwight Co., Inc.				Energy Louisiana LLC							
5,600 % fällig am 15.11.2032	1.200	1.269	0,07	4,750 % fällig am 15.09.2052	1.700	1.563	0,09				

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Hudson Pacific Properties LP 5,950 % fällig am 15.02.2028	\$ 3.600	\$ 2.865	0,16	MSCI, Inc. 3,250 % fällig am 15.08.2033	\$ 800	\$ 645	0,04	Rayonier LP 2,750 % fällig am 17.05.2031	\$ 1.500	\$ 1.208	0,07
Humana, Inc. 1,350 % fällig am 03.02.2027	1.250	1.088	0,06	4,000 % fällig am 15.11.2029	100	91	0,01	Realty Income Corp. 1,750 % fällig am 13.07.2033	£ 2.000	1.701	0,09
3,700 % fällig am 23.03.2029	3.200	2.933	0,16	4,150 % fällig am 15.12.2032	2.550	2.367	0,13	4,700 % fällig am 15.12.2028	\$ 1.000	970	0,05
3,950 % fällig am 15.03.2027	95	91	0,01	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2030	€ 1.500	1.560	0,09	Regency Centers LP 2,950 % fällig am 15.09.2029	1.100	945	0,05
5,875 % fällig am 01.03.2033	3.000	3.119	0,17	3,875 % fällig am 15.11.2029	3.400	3.622	0,20	Reinsurance Group of America, Inc. 6,000 % fällig am 15.09.2033	1.500	1.511	0,08
International Flavors & Fragrances, Inc. 1,832 % fällig am 15.10.2027	1.600	1.351	0,07	Neuberger Berman Group LLC 4,875 % fällig am 15.04.2045	\$ 200	164	0,01	Reliance Steel & Aluminum Co. 2,150 % fällig am 15.08.2030	1.000	816	0,04
Interstate Power & Light Co. 3,600 % fällig am 01.04.2029	1.200	1.097	0,06	New York State Electric & Gas Corp. 2,150 % fällig am 01.10.2031	400	313	0,02	RELX Capital, Inc. 4,000 % fällig am 18.03.2029	700	668	0,04
IQVIA, Inc. 5,700 % fällig am 15.05.2028	3.000	2.974	0,16	Niagara Mohawk Power Corp. 1,960 % fällig am 27.06.2030	3.000	2.402	0,13	RGA Global Funding 2,700 % fällig am 18.01.2029	1.000	863	0,05
John Deere Capital Corp. 3,350 % fällig am 18.04.2029	1.900	1.769	0,10	5,783 % fällig am 16.09.2052	2.690	2.701	0,15	S&P Global, Inc. 2,700 % fällig am 01.03.2029	5.500	4.954	0,27
JPMorgan Chase & Co. 1,045 % fällig am 19.11.2026	1.500	1.344	0,07	Northern States Power Co. 2,600 % fällig am 01.06.2051	1.300	835	0,05	Salesforce, Inc. 1,500 % fällig am 15.07.2028	1.750	1.509	0,08
2,545 % fällig am 08.11.2032	8.750	7.173	0,39	2,900 % fällig am 01.03.2050	1.700	1.173	0,06	San Diego Gas & Electric Co. 2,950 % fällig am 15.08.2051	1.750	1.187	0,07
2,580 % fällig am 22.04.2032	7.400	6.149	0,34	NSTAR Electric Co. 4,950 % fällig am 15.09.2052	1.300	1.264	0,07	Santander Holdings USA, Inc. 2,490 % fällig am 06.01.2028	1.400	1.210	0,07
2,739 % fällig am 15.10.2030	1.800	1.552	0,09	Nuveen LLC 4,000 % fällig am 01.11.2028	300	283	0,02	SBA Tower Trust 1,631 % fällig am 15.05.2051	1.000	864	0,05
4,203 % fällig am 23.07.2029	1.500	1.427	0,08	NVR, Inc. 3,000 % fällig am 15.05.2030	2.000	1.734	0,10	SCE Recovery Funding LLC 4,697 % fällig am 15.06.2042	2.000	1.950	0,11
4,323 % fällig am 26.04.2028	4.500	4.346	0,24	Oracle Corp. 3,950 % fällig am 25.03.2051	300	227	0,01	ServiceNow, Inc. 1,400 % fällig am 01.09.2030	3.200	2.536	0,14
4,565 % fällig am 14.06.2030	300	289	0,02	(h)	300	227	0,01	SLM Corp. 3,125 % fällig am 02.11.2026	1.400	1.212	0,07
4,912 % fällig am 25.07.2033	5.600	5.474	0,30	Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % fällig am 01.04.2053	3.200	3.145	0,17	Solar Star Funding LLC 5,375 % fällig am 30.06.2035	1.866	1.840	0,10
6,163 % fällig am 23.07.2024	1.100	1.101	0,06	Pacific Life Global Funding 1,375 % fällig am 14.04.2026	605	541	0,03	Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	200	166	0,01
Kaiser Foundation Hospitals 2,810 % fällig am 01.06.2041	2.850	2.096	0,12	1,600 % fällig am 21.09.2028	1.000	818	0,04	3,600 % fällig am 01.02.2045	1.600	1.179	0,06
Kellogg Co. 2,650 % fällig am 01.12.2023	734	727	0,04	2,450 % fällig am 11.01.2032	2.000	1.607	0,09	3,650 % fällig am 01.06.2051	2.500	1.859	0,10
Kilroy Realty LP 2,650 % fällig am 15.11.2033	6.400	4.344	0,24	5,890 % fällig am 06.12.2024	2.000	1.992	0,11	3,900 % fällig am 01.12.2041	100	78	0,00
3,050 % fällig am 15.02.2030	400	313	0,02	Pacific LifeCorp. 3,350 % fällig am 15.09.2050	200	139	0,01	4,500 % fällig am 01.09.2040	190	166	0,01
Lazard Group LLC 4,375 % fällig am 11.03.2029	200	186	0,01	PacifiCorp 5,350 % fällig am 01.12.2053	1.200	1.098	0,06	4,875 % fällig am 01.03.2049	200	180	0,01
Lennox International, Inc. 3,000 % fällig am 15.11.2023	1.480	1.463	0,08	5,500 % fällig am 15.05.2054	4.700	4.416	0,24	5,950 % fällig am 01.11.2032	3.750	3.928	0,22
Liberty Mutual Group, Inc. 3,625 % fällig am 23.05.2059	€ 200	208	0,01	Penn Mutual Life Insurance Co. 3,800 % fällig am 29.04.2061	1.800	1.221	0,07	Southwestern Public Service Co. 5,150 % fällig am 01.06.2052	2.000	1.862	0,10
Liberty Utilities Finance GP 2,050 % fällig am 15.09.2030	\$ 1.800	1.400	0,08	Physicians Realty LP 3,950 % fällig am 15.01.2028	800	731	0,04	Spirit Realty LP 4,450 % fällig am 15.09.2026	100	94	0,01
Low Income Investment Fund 3,711 % fällig am 01.07.2029	300	269	0,01	PNC Bank N.A. 2,700 % fällig am 22.10.2029	600	502	0,03	Sprint LLC 7,875 % fällig am 15.09.2023	100	100	0,01
Marriott International, Inc. 4,900 % fällig am 15.04.2029	1.300	1.265	0,07	4,758 % fällig am 26.01.2027	5.880	5.750	0,32	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 1.600	1.555	0,09
McLaren Health Care Corp. 4,386 % fällig am 15.05.2048	200	177	0,01	Principal Life Global Funding 1,250 % fällig am 16.08.2026	2.750	2.400	0,13	State Street Corp. 3,700 % fällig am 20.11.2023	\$ 2.000	1.982	0,11
Mercedes-Benz Finance North America LLC 4,950 % fällig am 30.03.2025	2.500	2.482	0,14	1,375 % fällig am 10.01.2025	2.000	1.866	0,10	5,751 % fällig am 04.11.2026	2.600	2.615	0,14
Merck & Co., Inc. 1,900 % fällig am 10.12.2028	2.000	1.748	0,10	Prologis Euro Finance LLC 1,500 % fällig am 08.02.2034	€ 3.250	2.645	0,15	Synchrony Financial 2,875 % fällig am 28.10.2031	500	364	0,02
4,900 % fällig am 17.05.2044	1.950	1.956	0,11	Prologis LP 2,250 % fällig am 15.01.2032	\$ 600	485	0,03	4,375 % fällig am 19.03.2024	650	637	0,03
Metropolitan Life Global Funding 0,375 % fällig am 09.04.2024	€ 300	319	0,02	Protective Life Global Funding 1,618 % fällig am 15.04.2026	800	717	0,04	7,250 % fällig am 02.02.2033	700	631	0,03
Micron Technology, Inc. 2,703 % fällig am 15.04.2032	\$ 1.800	1.421	0,08	1,737 % fällig am 21.09.2030	800	628	0,03	T-Mobile USA, Inc. 2,400 % fällig am 15.03.2029	450	387	0,02
MidAmerican Energy Co. 2,700 % fällig am 01.08.2052	1.250	792	0,04	1,900 % fällig am 06.07.2028	300	256	0,01	2,550 % fällig am 15.02.2031	2.000	1.663	0,09
3,150 % fällig am 15.04.2050	1.150	807	0,04	6,140 % fällig am 11.12.2024	5.000	5.015	0,28	2,625 % fällig am 15.02.2029	1.000	869	0,05
3,650 % fällig am 01.08.2048	4.629	3.571	0,20	Providence St. Joseph Health Obligated Group 5,403 % fällig am 01.10.2033	2.900	2.864	0,16	3,300 % fällig am 15.02.2051	900	632	0,03
3,950 % fällig am 01.08.2047	1.060	865	0,05	Public Service Co. of Colorado 2,700 % fällig am 15.01.2051	625	396	0,02	3,600 % fällig am 15.11.2060	300	211	0,01
Moody's Corp. 2,000 % fällig am 19.08.2031	700	565	0,03	3,200 % fällig am 01.03.2050	2.827	2.000	0,11	3,875 % fällig am 15.04.2030	700	645	0,04
2,550 % fällig am 18.08.2060	500	277	0,02	3,700 % fällig am 15.06.2028	2.100	1.995	0,11	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4,270 % fällig am 15.05.2047	400	331	0,02
3,100 % fällig am 29.11.2061	400	264	0,01	Public Service Co. of Oklahoma 3,150 % fällig am 15.08.2051	2.600	1.728	0,09	Topaz Solar Farms LLC 5,750 % fällig am 30.09.2039	1.324	1.300	0,07
3,250 % fällig am 15.01.2028	300	280	0,02	Public Service Electric & Gas Co. 3,100 % fällig am 15.03.2032	2.950	2.581	0,14	Toyota Motor Credit Corp. 3,050 % fällig am 22.03.2027	1.300	1.218	0,07
Morgan Stanley 1,102 % fällig am 29.04.2033	€ 600	497	0,03	4,650 % fällig am 15.03.2033	4.700	4.616	0,25	5,810 % fällig am 11.12.2023	3.900	3.905	0,21
1,375 % fällig am 27.10.2026	1.350	1.349	0,07	Puget Sound Energy, Inc. 5,448 % fällig am 01.06.2053	4.050	4.083	0,22	Travel + Leisure Co. 5,650 % fällig am 01.04.2024	300	297	0,02
1,928 % fällig am 28.04.2032	\$ 8.900	6.952	0,38	Qorvo, Inc. 1,750 % fällig am 15.12.2024	4.900	4.561	0,25	Truist Financial Corp. 1,267 % fällig am 02.03.2027	1.900	1.677	0,09
5,050 % fällig am 28.01.2027	1.000	992	0,05	Quanta Services, Inc. 2,900 % fällig am 01.10.2030	5.500	4.677	0,26	4,873 % fällig am 26.01.2029	5.250	5.050	0,28
5,123 % fällig am 01.02.2029	8.100	7.993	0,44					5,122 % fällig am 26.01.2034	2.750	2.607	0,14
6,342 % fällig am 18.10.2033	6.000	6.386	0,35								
Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 20.06.2028	1.500	1.446	0,08								
MPT Operating Partnership LP 2,550 % fällig am 05.12.2023	£ 200	246	0,01								



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
U.S. Bancorp				Xylem, Inc.				2,000 % fällig am 15.11.2041 (i)	39.500	28.941	1,59
5,727 % fällig am 21.10.2026	\$ 1.800	\$ 1.800	0,10	2,250 % fällig am 30.01.2031	\$ 1.080	\$ 897	0,05	2,250 % fällig am 15.05.2041 (i)	28.900	22.281	1,23
5,836 % fällig am 12.06.2034	600	605	0,03	Zoetis, Inc.				2,375 % fällig am 15.02.2042 (i)	58.900	45.885	2,52
UDR, Inc.				2,000 % fällig am 15.05.2030	0	0	0,00	2,875 % fällig am 15.05.2052	2.620	2.172	0,12
3,100 % fällig am 01.11.2034	1.800	1.435	0,08			566.665	31,16	3,000 % fällig am 15.02.2048	462	390	0,02
UnitedHealth Group, Inc.								3,125 % fällig am 15.08.2044	432	374	0,02
5,350 % fällig am 15.02.2033	1.400	1.456	0,08	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				3,125 % fällig am 15.05.2048	42	36	0,00
5,875 % fällig am 15.02.2053	600	667	0,04	Hilton Domestic Operating Co., Inc.				3,250 % fällig am 15.05.2042 (i)	38.800	34.643	1,90
USAA Capital Corp.				6,939 % fällig am 22.06.2026	1.200	1.201	0,07	3,375 % fällig am 15.08.2042	13.000	11.806	0,65
2,125 % fällig am 01.05.2030	1.000	833	0,05	IQVIA, Inc.				3,875 % fällig am 15.05.2043 (j)	7.100	6.929	0,38
3,375 % fällig am 01.05.2025	1.300	1.249	0,07	5,598 % fällig am 07.03.2024	€ 1.000	1.091	0,06	4,000 % fällig am 15.11.2042 (i)	27.600	27.436	1,51
VeriSign, Inc.						2.292	0,13	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)			
2,700 % fällig am 15.06.2031	1.100	916	0,05	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,625 % fällig am 15.07.2032 (i)	31.422	28.898	1,59
Verizon Communications, Inc.				California Health Facilities Financing Authority Revenue Bonds, Series 2022				U.S. Treasury Notes			
0,375 % fällig am 22.03.2029	€ 800	717	0,04	4,190 % fällig am 01.06.2037	\$ 2.100	1.965	0,11	0,500 % fällig am 30.11.2023 (i)	22.700	22.254	1,22
1,500 % fällig am 18.09.2030	\$ 5.560	4.397	0,24	University of Michigan Revenue Bonds, Series 2022				0,750 % fällig am 30.04.2026	7.400	6.665	0,37
2,100 % fällig am 22.03.2028	700	615	0,03	3,504 % fällig am 01.04.2052	1.300	1.051	0,05	3,125 % fällig am 31.08.2027	3.250	3.109	0,17
2,355 % fällig am 15.03.2032	600	483	0,03	University of Pittsburgh of the Commonwealth System of Higher Education, Pennsylvania Revenue Bonds, Series 2017				4,250 % fällig am 31.05.2025 (i)(j)	30.800	30.414	1,67
2,850 % fällig am 03.09.2041	1.550	1.104	0,06	3,646 % fällig am 15.09.2036	2.000	1.819	0,10	4,250 % fällig am 15.10.2025	13.700	13.549	0,74
3,400 % fällig am 22.03.2041	500	386	0,02			4.835	0,26	4,625 % fällig am 15.03.2026	310	310	0,02
3,700 % fällig am 22.03.2061	261	190	0,01	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				U.S. Treasury STRIPS			
3,875 % fällig am 08.02.2029	2.400	2.252	0,12	Freddie Mac				0,000 % fällig am 15.05.2046 (d)	2.200	882	0,05
4,329 % fällig am 21.09.2028	600	579	0,03	0,375 % fällig am 23.09.2025	1.700	1.543	0,08				
5,050 % fällig am 09.05.2033	2.000	1.979	0,11	1,147 % fällig am 25.08.2029 (a)	2.322	109	0,01	Summe USA		1.116.784	61,39
VF Corp.				Uniform Mortgage-Backed Security				<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>			
2,950 % fällig am 23.04.2030	3.500	2.878	0,16	3,000 % fällig am 01.07.2052	6.588	5.809	0,32	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
VMware, Inc.				3,500 % fällig am 01.12.2052	99	90	0,01	TSMC Global Ltd.			
2,200 % fällig am 15.08.2031	0	0	0,00	4,000 % fällig am 01.12.2052 - 01.06.2053	14.160	13.298	0,73	1,250 % fällig am 23.04.2026	3.600	3.217	0,18
4,700 % fällig am 15.05.2030	3.000	2.865	0,16	4,500 % fällig am 01.07.2052 - 01.06.2053	26.506	25.500	1,40	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
Warnermedia Holdings, Inc.				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
4,279 % fällig am 15.03.2032	4.100	3.638	0,20	4,000 % fällig am 01.08.2053	48.670	45.717	2,51	AT+T, Inc.			
5,391 % fällig am 15.03.2062	500	408	0,02	5,000 % fällig am 01.08.2053	19.900	19.504	1,07	5,700 % fällig am 19.03.2024	1.550	1.484	0,08
Wells Fargo & Co.				6,000 % fällig am 01.07.2053	111.500	112.493	6,18	Haleon UK Capital PLC			
4,540 % fällig am 15.08.2026	3.100	3.030	0,17			224.063	12,31	5,520 % fällig am 24.07.2023	300	299	0,02
Weyerhaeuser Co.				<b>US-SCHATZPAPIERE</b>				Humana, Inc.			
4,000 % fällig am 15.11.2029	3.000	2.769	0,15	U.S. Treasury Bonds				5,450 % fällig am 13.07.2023	400	399	0,02
6,875 % fällig am 15.12.2033	70	76	0,00	1,625 % fällig am 15.11.2050	4.770	2.965	0,16	Walgreens Boots Alliance			
Wisconsin Electric Power Co.				1,875 % fällig am 15.02.2041	\$ 18.150	\$ 13.195	0,73	6,000 % fällig am 05.07.2023	4.300	4.296	0,23
4,750 % fällig am 30.09.2032	1.850	1.813	0,10					Summe kurzfristige Instrumente		6.478	0,35
Wisconsin Power & Light Co.								Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 2.107.775	115,86
4,950 % fällig am 01.04.2033	6.760	6.692	0,37								
Wisconsin Public Service Corp.											
2,850 % fällig am 01.12.2051	2.250	1.487	0,08								
WP Carey, Inc.											
2,450 % fällig am 01.02.2032	1.200	941	0,05								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermö-gens
SSB	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 2.319	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	\$ (2.365)	\$ 2.319	\$ 2.319	0,13
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (2.365)</b>	<b>\$ 2.319</b>	<b>\$ 2.319</b>	<b>0,13</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	134	\$ (57)	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	82	(111)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	335	393	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	599	657	0,04
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	201	(527)	(0,03)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	514	465	0,03
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	23	(86)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	394	(1.008)	(0,06)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	112	175	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	562	1.122	0,06

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)		% des Nettvermögens
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	1.206	\$	1.169	0,06
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	349		37	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	283		(544)	(0,03)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	164		187	0,01
				\$	1.872	0,10
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				\$	1.872	0,10

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz (1,000) %	Fälligkeits- datum 20.12.2023	Nenn- betrag <sup>(3)</sup> € 200	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) \$ (5)		% des Nettvermögens 0,00
Koninklijke KPN NV						

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)		% des Nettvermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.12.2027	\$ 1.100	\$	25	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2026	900		(8)	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2027	1.000		17	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	2.100		(21)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.500		(22)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	700		5	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	€ 100		0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	300		4	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	1.600		4	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	400		2	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	\$ 600		8	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	300		7	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	800		20	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2026	3.000		(4)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2028	1.700		30	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	€ 1.000		4	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	600		(2)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 700		(11)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	2.200		(37)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	700		11	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	8.400		42	0,01
				\$	74	0,01

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)		% des Nettvermögens
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 800	\$	72	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	\$ 40.600		(522)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	800		254	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,026	02.01.2025	BRL 243.200		1.188	0,06
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 13.800		(865)	(0,05)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	600		(35)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	1.100		(65)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025	600		(34)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	300		(17)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,290	03.03.2025	200		(11)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	500		(37)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	70.100		(428)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2023	\$ 800		4	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,600	15.12.2050	€ 2.300		1.192	0,07
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	10.100		39	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	81.400		192	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	44.600		154	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	10.500		5	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,475	16.06.2031	\$ 2.600		221	0,01
					\$	1.307	0,07

## Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

\$ 1.376 0,08

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

- (2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 2.300	\$ 11	\$ 15	\$ 26	0,00

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	08.2023	AUD	\$	55	\$ 0	\$ 55	0,00	
	08.2023	£		706	0	(16)	0,00	
	08.2023	SEK		139	6	6	0,00	
BPS	07.2023	€		493.426	2	(7.314)	(0,40)	
	07.2023	\$	€	480.789	0	(2.281)	(0,12)	
	08.2023	€	\$	522.680	2.260	0	0,12	
BRC	08.2023	ZAR		777	15	15	0,00	
	08.2023	£		13.817	0	(187)	(0,01)	
	08.2023	\$	¥	823.780	0	(274)	(0,01)	
CBK	08.2023	ZAR	\$	947	24	24	0,00	
	07.2023	€		6.507	0	(109)	(0,01)	
	07.2023	\$	€	7.713	10	(8)	0,00	
CLY	08.2023	CAD	\$	15.327	0	(137)	(0,01)	
	08.2023	£		7.688	0	(152)	(0,01)	
	08.2023	SEK		1.046	62	0	0,00	
GLM	08.2023	\$	NOK	17.442	0	(42)	0,00	
	08.2023	1.888		19.785	0	(38)	0,00	
	08.2023	735		7.800	0	(6)	0,00	
JPM	08.2023	£	\$	46.447	0	(187)	(0,01)	
	08.2023	\$	¥	25.010	0	(14)	0,00	
	08.2023	271	NOK	2.876	0	(2)	0,00	
MBC	07.2023	€	\$	26.955	0	(465)	(0,03)	
	07.2023	\$	€	931	0	(5)	0,00	
	08.2023	CAD	\$	300	0	(1)	0,00	
MYI	08.2023	£		2.538	0	(34)	0,00	
	07.2023	€		99	0	0	0,00	
	07.2023	£		54	0	0	0,00	
SCX	07.2023	SEK		723	0	(2)	0,00	
	07.2023	\$	€	78	0	0	0,00	
	07.2023	1.309	£	1.037	9	9	0,00	
UAG	08.2023	2.461	¥	327.013	0	(184)	(0,01)	
	07.2023	954	€	870	0	(4)	0,00	
	08.2023	AUD	\$	153	0	0	0,00	
UAG	08.2023	£		687	0	(18)	0,00	
	08.2023	\$	£	1.122	6	6	0,00	
	08.2023	£	\$	40.601	0	(247)	(0,01)	
	10.2023	ZAR		1.655	50	0	0,00	
					\$ 2.499	\$ (11.737)	\$ (9.238)	(0,51)

#### ABGESICHERTE DEWISENTERMIKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF	\$	15	17	\$ 0	0,00
BPS	07.2023	65.476		73.211	25	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	\$ 97.835	CHF 88.514	\$ 1.102	\$ 0	\$ 1.102	0,06
	08.2023	73.204	65.284	0	(25)	(25)	0,00
CLY	07.2023	CHF 34.604	\$ 38.523	0	(155)	(155)	(0,01)
	08.2023	\$ 38.523	CHF 34.505	155	0	155	0,01
JPM	07.2023	225	203	2	0	2	0,00
MBC	07.2023	CHF 56	\$ 62	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 316	CHF 283	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	CHF 3.385	\$ 3.739	0	(44)	(44)	0,00
	07.2023	\$ 905	CHF 821	12	0	12	0,00
RYL	07.2023	CHF 4	\$ 4	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	\$ 69.771	CHF 62.694	305	0	305	0,02
UAG	07.2023	CHF 67.696	\$ 75.519	0	(149)	(149)	(0,01)
	07.2023	\$ 63.933	CHF 57.441	272	0	272	0,01
	08.2023	75.472	67.461	148	0	148	0,01
				\$ 2.022	\$ (373)	\$ 1.649	0,09

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 193	\$ 210	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 318.337	€ 296.209	4.828	0	4.828	0,27
BPS	07.2023	€ 281.493	\$ 308.511	1.409	(6)	1.403	0,08
	07.2023	\$ 317.783	€ 295.608	4.726	0	4.726	0,26
	08.2023	285.856	260.523	0	(1.237)	(1.237)	(0,07)
BRC	07.2023	€ 58.828	\$ 63.633	0	(549)	(549)	(0,03)
CBK	07.2023	277.901	301.953	10	(1.248)	(1.238)	(0,07)
	07.2023	\$ 1.500	€ 1.392	18	0	18	0,00
	08.2023	283.280	260.192	978	0	978	0,05
JPM	07.2023	€ 261.055	\$ 285.046	235	0	235	0,01
	07.2023	\$ 318.471	€ 297.868	6.504	0	6.504	0,36
	08.2023	285.445	261.055	0	(243)	(243)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 6.942	\$ 7.451	3	(126)	(123)	(0,01)
	07.2023	\$ 38.120	€ 35.592	710	0	710	0,04
MYI	07.2023	€ 58.582	\$ 63.565	0	(348)	(348)	(0,02)
SCX	07.2023	\$ 19.709	€ 18.416	384	0	384	0,02
				\$ 19.805	\$ (3.757)	\$ 16.048	0,88

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 157	\$ 199	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 38	£ 30	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	£ 37	\$ 47	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 64.640	£ 52.260	1.801	0	1.801	0,10
BRC	07.2023	£ 179	\$ 225	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	\$ 291	£ 234	6	0	6	0,00
CBK	07.2023	£ 113	\$ 144	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 252	£ 200	3	0	3	0,00
JPM	07.2023	£ 52.214	\$ 66.020	0	(363)	(363)	(0,02)
	08.2023	\$ 66.034	£ 52.214	362	0	362	0,02
MBC	07.2023	£ 56	\$ 71	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 65.069	£ 52.560	1.752	0	1.752	0,10
MYI	07.2023	64.210	51.663	1.472	0	1.472	0,08
				\$ 5.398	\$ (366)	\$ 5.032	0,28

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK 1.284.367	\$ 118.997	\$ 99	\$ (10)	\$ 89	0,00
	07.2023	\$ 10.315	SEK 110.528	3	(85)	(82)	0,00
	08.2023	114.226	1.231.185	0	(98)	(98)	(0,01)
BRC	07.2023	114	1.217	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2023	78.870	861.432	882	0	882	0,05
GLM	07.2023	444	4.789	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	75.679	815.016	0	(224)	(224)	(0,01)
MYI	07.2023	SEK 1.233.246	\$ 114.226	50	0	50	0,00
	07.2023	\$ 106.212	SEK 1.140.146	0	(655)	(655)	(0,04)
	08.2023	114.226	1.231.716	0	(49)	(49)	0,00
SCX	07.2023	SEK 2.214	\$ 207	2	0	2	0,00
	07.2023	\$ 75.470	SEK 816.396	113	0	113	0,01
				\$ 1.149	\$ (1.123)	\$ 26	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 13.543 0,74

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,000 % fällig am 01.08.2053	\$ 6.700	\$ (5.906)	(0,32)
4,500 % fällig am 01.08.2053	26.500	(25.492)	(1,41)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (31.398)</b>	<b>(1,73)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 2.095.487</b>	<b>115,18</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (276.138)</b>	<b>(15,18)</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 1.819.349</b>	<b>100,00</b>

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,87 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	4,850 %	25.05.2047	23.09.2021	\$ 1.324	\$ 1.015	0,06
Brookfield Property Finance ULC	7,125	13.02.2028	09.02.2023	820	770	0,04
Citigroup, Inc.	2,572	03.06.2031	29.12.2021	8.156	6.762	0,37
Citigroup, Inc.	5,746	25.01.2026	18.01.2022	2.000	1.992	0,11
Citigroup, Inc.	6,270	17.11.2033	04.04.2023	0	0	0,00
Deutsche Bank AG	1,447	01.04.2025	23.09.2021	2.003	1.901	0,11
Oracle Corp.	3,950	25.03.2051	22.03.2021	299	227	0,01
				<b>\$ 14.602</b>	<b>\$ 12.667</b>	<b>0,70</b>

(i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 151.489 USD (31. Dezember 2022: 74.895 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

(j) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 30.629 USD (31. Dezember 2022: 22.792 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen als Sicherheit für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 32.764 USD (31. Dezember 2022: 28.652 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.390 USD (31. Dezember 2022: 1.380 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)		Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)		Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)		Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0		\$ 2.107.775		\$ 0		\$ 2.107.775
Pensionsgeschäfte	0		2.319		0		2.319
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	921		15.870		0		16.791
Leerverkaufte Wertpapiere	0		(31.398)		0		(31.398)
<b>Summen</b>	<b>\$ 921</b>		<b>\$ 2.094.566</b>		<b>\$ 0</b>		<b>\$ 2.095.487</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)		Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)		Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)		Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0		\$ 1.489.771		\$ 0		\$ 1.489.771
Pensionsgeschäfte	0		15.240		0		15.240
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	3.729		11.595		0		15.324
Leerverkaufte Wertpapiere	0		(5.887)		0		(5.887)
<b>Summen</b>	<b>\$ 3.729</b>		<b>\$ 1.510.719</b>		<b>\$ 0</b>		<b>\$ 1.514.448</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,000 %	29.06.2023	03.07.2023	\$ (6.749)	\$ (6.751)	(0,37)
	5,180	15.06.2023	13.07.2023	(39.799)	(39.890)	(2,19)
	5,180	20.06.2023	13.07.2023	(90.619)	(90.763)	(4,99)
	5,190	16.06.2023	06.07.2023	(8.306)	(8.323)	(0,46)
	5,200	30.06.2023	06.07.2023	(5.684)	(5.685)	(0,31)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (151.412)</b>	<b>(8,32)</b>

## Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	4,900 %	28.06.2023	05.07.2023	\$ (13.806)	\$ (13.812)	(0,76)
	5,090	29.06.2023	06.07.2023	(10.036)	(10.039)	(0,55)
MSC	4,700	28.06.2023	05.07.2023	(6.980)	(6.982)	(0,38)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (30.833)</b>	<b>(1,69)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 18 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Derivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 4.808	\$ (3.670)	\$ 1.138	\$ 631	\$ (740)	\$ (109)
BPS	478	0	478	1	0	1
BRC	(984)	770	(214)	524	(240)	284
CBK	257	0	257	7.658	(7.770)	(112)
CLY	(38)	0	(38)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(7)	0	(7)	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	6.294	(5.460)	834	(244)	0	(244)
MBC	1.612	(770)	842	(1.588)	1.380	(208)
MYI	261	620	881	312	(100)	212
SCX	788	(220)	568	4.744	(4.520)	224
UAG	74	0	74	1.133	(520)	613

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	93,58	81,73
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	22,17	26,66
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,11	0,36
Pensionsgeschäfte	0,13	1,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	0,46
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,08	(0,30)
Freiverkehrfinanzderivate	0,74	0,96
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,73)	(0,43)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(8,32)	(5,54)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(1,69)	(5,54)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,85	0,41
Österreich	0,42	0,22
Belgien	1,37	0,65
Brasilien	k. A.	0,02
Kanada	1,97	1,75
Cayman-Inseln	0,10	0,27
Chile	0,37	0,44
Kolumbien	k. A.	0,09
Zypern	k. A.	0,08
Tschechische Republik	0,24	k. A.
Dänemark	0,87	0,79
Finnland	0,75	0,63
Frankreich	7,56	5,16
Deutschland	3,35	2,94
Guernsey, Kanalinseln	0,24	0,32
Hongkong	0,42	0,01

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Indien	0,66	0,96
Indonesien	0,04	k. A.
Irland	1,11	1,40
Israel	0,10	k. A.
Italien	1,65	1,33
Japan	3,90	3,85
Jersey, Kanalinseln	0,06	0,09
Luxemburg	0,99	1,23
Mauritius	0,25	0,18
Mexiko	0,31	0,32
Multinational	0,47	0,63
Niederlande	7,13	7,21
Norwegen	0,13	0,16
Peru	0,09	0,11
Philippinen	0,22	k. A.
Polen	0,08	k. A.
Rumänien	0,33	0,29
Serbien	0,09	0,13
Singapur	0,38	0,35
Südafrika	k. A.	0,02
Südkorea	2,10	1,02
Spanien	1,52	1,34
Supranational	2,87	2,90
Schweden	0,64	0,70
Schweiz	0,64	0,63
Thailand	0,01	k. A.
Großbritannien	9,66	8,14
USA	61,39	55,93
Jungferinseln (Britisch)	0,18	0,24
Kurzfristige Instrumente	0,35	5,81
Pensionsgeschäfte	0,13	1,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,10	0,46
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,01	(0,02)
Zinsswaps	0,07	(0,28)
Freiverkehrsfinaanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,51)	(0,50)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,25	1,46
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,73)	(0,43)
Sonstige Aktiva und Passiva	(15,18)	(10,55)
Nettovermögen	100,00	100,00





# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>Canada Square Funding PLC</b>				1,250 % fällig am 22.11.2027 (a)	£ 59.804	\$ 76.806	6,13	<b>US-SCHATZZOBIGATIONEN</b>			
5,316 % fällig am 17.01.2059	£ 3.849	\$ 4.865	0,39	4,250 % fällig am 07.12.2049	3.200	3.934	0,31	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (a)			
5,682 % fällig am 17.06.2058	1.713	2.166	0,17			141.187	11,27	0,125 % fällig am 15.07.2024	\$ 34.617	\$ 33.580	2,68
5,852 % fällig am 17.06.2058	1.415	1.791	0,14	Summe Großbritannien		196.282	15,66	0,125 % fällig am 15.10.2024 (c)	56.509	54.512	4,35
<b>Canterbury Finance PLC</b>								0,125 % fällig am 15.04.2025 (d)	54.685	52.030	4,15
5,377 % fällig am 16.05.2058	487	618	0,05					0,125 % fällig am 15.10.2025	52.370	49.658	3,96
<b>Eurosail PLC</b>								0,125 % fällig am 15.04.2025 (c)	53.237	49.930	3,98
3,619 % fällig am 13.03.2045	€ 730	786	0,06	<b>USA</b>				0,125 % fällig am 15.07.2026 (c)	77.561	72.873	5,82
3,736 % fällig am 10.06.2044	739	799	0,06	<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				0,125 % fällig am 15.10.2026 (c)	70.151	65.598	5,23
3,736 % fällig am 10.09.2044	983	1.060	0,08	Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				0,125 % fällig am 15.04.2027	22.452	20.787	1,66
5,140 % fällig am 13.03.2045	£ 905	1.138	0,09	6,050 % fällig am 25.10.2034	\$ 456	455	0,04	0,125 % fällig am 15.01.2030	2.240	2.010	0,16
<b>Great Hall Mortgages PLC</b>				Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				0,125 % fällig am 15.07.2030	7.335	6.581	0,53
5,152 % fällig am 18.03.2039	18	23	0,00	3,405 % fällig am 25.03.2036	26	26	0,00	0,125 % fällig am 15.07.2031	4.844	4.297	0,34
5,172 % fällig am 18.06.2038	450	568	0,05	Fremont Home Loan Trust				0,125 % fällig am 15.01.2032	1.641	1.446	0,12
<b>London Wall Mortgage Capital PLC</b>				5,885 % fällig am 25.07.2035	1	1	0,00	0,125 % fällig am 15.02.2051	350	234	0,02
5,502 % fällig am 15.05.2052	983	1.240	0,10	Renaissance Home Equity Loan Trust				0,250 % fällig am 15.01.2025 (c)	92.331	88.522	7,06
<b>Polaris PLC</b>				6,090 % fällig am 25.05.2034	1.925	1.733	0,14	0,250 % fällig am 15.02.2050	472	330	0,03
5,640 % fällig am 23.10.2059	2.802	3.538	0,28	Structured Asset Investment Loan Trust				0,375 % fällig am 15.07.2025 (d)	57.812	55.332	4,42
6,154 % fällig am 27.05.2057	689	877	0,07	6,100 % fällig am 25.10.2033	776	753	0,06	0,375 % fällig am 15.01.2027 (c)	69.186	64.934	5,18
<b>Precise Mortgage Funding PLC</b>								0,375 % fällig am 15.07.2027	47.738	44.763	3,57
5,657 % fällig am 16.10.2056	268	340	0,03	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,500 % fällig am 15.01.2028 (c)	55.211	51.660	4,12
6,065 % fällig am 12.12.2055	1.173	1.496	0,12	Sabine Pass Liquefaction LLC				0,625 % fällig am 15.01.2024	31	31	0,00
<b>RMAC Securities PLC</b>				5,750 % fällig am 15.05.2024	200	200	0,02	0,625 % fällig am 15.01.2026 (c)	72.033	68.699	5,48
5,134 % fällig am 12.06.2044	1.495	1.824	0,15					0,625 % fällig am 15.07.2032 (c)	6.368	5.856	0,47
<b>Rochester Financing PLC</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				0,750 % fällig am 15.07.2028	36.371	34.477	2,75
5,602 % fällig am 18.12.2044	2.951	3.707	0,30	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0,750 % fällig am 15.02.2045	1.932	1.598	0,13
<b>Stratton BTL Mortgage Funding PLC</b>				5,690 % fällig am 25.08.2036	0	0	0,00	0,875 % fällig am 15.01.2029	26.066	24.683	1,97
5,221 % fällig am 20.01.2054	4.047	5.119	0,41	5,790 % fällig am 25.10.2028	6	5	0,00	0,875 % fällig am 15.02.2047	754	633	0,05
<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>				Structured Asset Mortgage Investments Trust				1,375 % fällig am 15.02.2044	1.171	1.104	0,09
5,765 % fällig am 12.03.2052	754	955	0,08	5,626 % fällig am 19.04.2035	285	258	0,02	1,625 % fällig am 15.10.2027 (c)	63.482	62.569	4,99
<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>				5,646 % fällig am 19.07.2035	48	44	0,00	2,125 % fällig am 15.02.2041	831	892	0,07
5,841 % fällig am 20.07.2045	2.174	2.766	0,22	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
6,546 % fällig am 20.02.2054	562	715	0,06	5,730 % fällig am 25.07.2045	398	371	0,03	Summe USA		919.622	73,38
<b>Tower Bridge Funding PLC</b>				5,790 % fällig am 25.07.2045	76	72	0,01			1.032.466	82,39
5,527 % fällig am 20.11.2063	2.222	2.811	0,22								
5,629 % fällig am 20.12.2063	1.389	1.758	0,14	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
5,991 % fällig am 20.10.2064	4.500	5.753	0,46	Ginnie Mae				<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
<b>Tudor Rose Mortgages</b>				3,858 % fällig am 20.08.2068	1.085	1.057	0,08	AT+T, Inc.			
5,509 % fällig am 20.06.2048	1.516	1.917	0,15	5,452 % fällig am 20.08.2066	184	184	0,01	5,700 % fällig am 19.03.2024	3.800	3.638	0,29
<b>Twin Bridges PLC</b>				5,886 % fällig am 20.08.2072 - 20.04.2073	10.089	9.994	0,80	Summe kurzfristige Instrumente		3.638	0,29
6,115 % fällig am 22.12.2054	2.197	2.799	0,22	5,966 % fällig am 20.10.2072	5.037	4.991	0,40	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.697.365	135,45	
		55.095	4,39	6,067 % fällig am 20.03.2073	5.700	5.636	0,45				
				6,166 % fällig am 20.05.2073	3.200	3.203	0,26	<b>AKTIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Uniform Mortgage-Backed Security				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
United Kingdom Gilt				4,500 % fällig am 01.09.2052	19.690	18.946	1,51	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
0,125 % fällig am 22.03.2024 (a)	43.714	54.507	4,35	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				PIMCO Select Funds plc -			
0,125 % fällig am 22.03.2026 (a)	203	249	0,02	4,000 % fällig am 01.08.2053	30.500	28.650	2,29	PIMCO US Dollar Short-Term Floating			
0,125 % fällig am 22.11.2036 (a)	1.146	1.346	0,11	4,500 % fällig am 01.08.2053	37.700	36.265	2,89	NAV Fund (b)	18.999	189	0,02
0,125 % fällig am 22.11.2056 (a)	554	556	0,04					Summe Investmentfonds	\$ 189	0,02	
0,625 % fällig am 22.11.2042 (a)	1.526	1.845	0,15								
0,625 % fällig am 22.03.2045 (a)	819	962	0,08								
0,625 % fällig am 22.10.2050	1.900	982	0,08								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 7.529	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (7.680)	\$ 7.529	\$ 7.530	0,60
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						\$ (7.680)	\$ 7.529	\$ 7.530	0,60

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	16	\$ 6	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	326	(565)	(0,05)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	84	(86)	(0,01)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	110	\$ 118	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	476	468	0,04
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	56	(122)	(0,01)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	61	(6)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	1.342	1.323	0,11
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	37	(133)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	16	0	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	1.181	1.661	0,13
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	291	(275)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	543	411	0,03
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	51	(3)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	173	(341)	(0,03)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	222	92	0,01
				\$ 2.548	0,20

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 113,000	21.07.2023	214	\$ (151)	\$ (238)	(0,02)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ 2.310 0,18

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 500	\$ (5)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 1.900	\$ 170	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	34.500	(1.272)	(0,10)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,670	10.01.2033	4.100	62	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 3.582.000	(260)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	1.418.000	(70)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	\$ 4.300	(1.205)	(0,10)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	21.11.2053	2.400	(605)	(0,05)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	17.200	369	0,03
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	44.400	(798)	(0,06)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	1.900	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	2.700	(40)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	7.300	(58)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	68.600	412	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.07.2023	4.300	(17)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 2.200	(98)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	32.500	(540)	(0,04)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	16.300	40	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	79.500	126	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	53.200	(28)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,005	15.02.2025	18.100	1.802	0,14
Zahlung	CPTFEMU	1,355	15.02.2050	1.200	(135)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	1,375	15.02.2040	1.600	(213)	(0,02)
Erhalt	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	4.800	593	0,05
Erhalt	CPTFEMU	1,500	15.07.2031	7.040	901	0,07
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	800	(193)	(0,02)
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	1.500	75	0,01
Zahlung	CPTFEMU	2,421	15.05.2052	330	(54)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	1.600	78	0,01
Zahlung	CPTFEMU	2,488	15.05.2037	2.290	(175)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,550	15.04.2052	300	45	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,570	15.06.2032	1.200	51	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,580	15.03.2052	1.400	(185)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	2,590	15.12.2052	1.700	(97)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	3.000	140	0,01
Zahlung	CPTFEMU	2,700	15.04.2053	5.500	(10)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,720	15.06.2032	1.800	58	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,975	15.08.2027	19.700	226	0,02
Erhalt	CPTFEMU	3,000	15.05.2027	5.400	137	0,01
Erhalt	CPTFEMU	3,130	15.05.2027	100	3	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	CPTFEMU		3,520 %	15.09.2024	€ 5.200	\$ (56)	0,00
Zahlung	CPTFEMU		3,720	15.09.2024	3.300	(23)	0,00
Zahlung	CPTFEMU		3,850	15.09.2024	7.700	(48)	0,00
Erhalt	CPURNSA		1,794	24.08.2027	\$ 6.700	168	0,01
Erhalt	CPURNSA		1,798	25.08.2027	3.400	86	0,01
Zahlung	CPURNSA		1,883	20.11.2029	7.400	(202)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA		1,890	27.08.2027	6.500	167	0,01
Zahlung	CPURNSA		1,954	03.06.2029	4.700	(132)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA		1,998	25.07.2029	4.300	(124)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA		2,311	24.02.2031	6.600	208	0,02
Zahlung	CPURNSA		2,335	05.02.2028	6.110	(195)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA		2,353	09.05.2028	960	(31)	0,00
Zahlung	CPURNSA		2,364	10.05.2028	7.960	(257)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA		2,379	09.07.2028	1.900	(62)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA		2,419	05.03.2026	400	12	0,00
Erhalt	CPURNSA		2,690	01.06.2026	1.300	38	0,00
Erhalt	CPURNSA		2,703	25.05.2026	2.450	72	0,01
Erhalt	CPURNSA		2,768	13.05.2026	3.500	104	0,01
Erhalt	CPURNSA		2,813	14.05.2026	1.600	48	0,00
Zahlung	FRCPXT0B		1,280	15.11.2034	€ 1.700	(225)	(0,02)
Zahlung	FRCPXT0B		1,410	15.11.2039	2.000	(291)	(0,02)
Zahlung	UKRPI		3,330	15.01.2025	£ 400	(55)	0,00
Zahlung	UKRPI		3,346	15.05.2030	550	(55)	0,00
Zahlung	UKRPI		3,530	15.10.2031	7.260	(875)	(0,07)
Zahlung	UKRPI		3,566	15.03.2036	1.400	(62)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		3,850	15.09.2024	2.500	(364)	(0,03)
Erhalt	UKRPI		4,125	15.09.2032	480	24	0,00
Erhalt	UKRPI		4,130	15.09.2032	2.120	106	0,01
Zahlung	UKRPI		4,288	15.02.2032	2.200	(124)	(0,01)
Erhalt	UKRPI		4,480	15.09.2023	1.300	182	0,01
Erhalt	UKRPI		5,330	15.06.2024	8.800	386	0,03
Erhalt	UKRPI		6,440	15.05.2024	1.500	104	0,01
Erhalt	UKRPI		6,600	15.05.2024	2.200	143	0,01
						\$ (2.101)	(0,17)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ (2.106)</b>	<b>(0,17)</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	2,237 %	17.11.2023	8.700	\$ 540	\$ 1.909	0,15

##### VERKAUFSOPTIONEN

##### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.500	\$ (68)	\$ (85)	(0,01)
JPM	Cap - OTC CPURNSA	233,916	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	22.04.2024	1.000	(7)	0	0,00
	Cap - OTC CPURNSA	234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	100	(1)	0	0,00
						\$ (76)	\$ (85)	(0,01)

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	33.600	\$ (95)	\$ (39)	0,00
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,340	17.11.2023	43.000	(542)	(3.171)	(0,25)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420	21.09.2023	72.900	(415)	(312)	(0,03)
JPM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	12.09.2023	46.800	(131)	(54)	0,00
						\$ (1.183)	\$ (3.576)	(0,28)	

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 600	\$ (40)	\$ 40	\$ 0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.400	(3)	(12)	(15)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	894	(79)	77	(2)	0,00
					\$ (122)	\$ 105	\$ (17)	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückkehrwerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2023	AUD	441	\$ 289	\$ 0	\$ (5)	0,00	
	07.2023	\$	1.606	AUD 2.420	5	0	0,00	
	08.2023	AUD	2.420	\$ 1.607	0	(5)	0,00	
BOA	07.2023		3.551		0	(45)	0,00	
	07.2023	DKK	253.510	36.608	0	(537)	(0,04)	
	07.2023	€	13.541	14.578	0	(195)	(0,02)	
	07.2023	¥	202.000	1.452	55	0	55	0,00
	07.2023	NZD	2.917	1.770	0	(17)	(17)	0,00
	07.2023	SEK	45	4	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	\$	17.228	DKK 117.135	0	(65)	(0,01)	
	07.2023		3.593	£ 2.841	19	0	19	0,00
	08.2023	DKK	116.939	\$ 17.228	65	0	65	0,01
	07.2023	AUD	485	317	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	¥	8.169.087	58.798	2.278	0	2.278	0,18
	07.2023	NZD	69	42	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$	1.146	AUD 1.730	6	0	6	0,00
	07.2023		333.069	€ 303.979	0	(1.429)	(1.429)	(0,11)
	07.2023		2.284	£ 1.794	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	AUD	1.730	\$ 1.147	0	(6)	(6)	0,00
CBK	08.2023	€	303.979	333.537	1.442	0	1.442	0,11
	07.2023	AUD	1.533	1.000	0	(20)	(20)	0,00
	07.2023	CAD	3.086	2.265	0	(67)	(67)	(0,01)
	07.2023	DKK	900	129	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07.2023	€	2.928	3.142	0	(52)	(52)	(0,01)
	07.2023	£	3.483	4.406	0	(22)	(22)	0,00
	07.2023	AUD	3.411	2.230	0	(41)	(41)	0,00
MBC	07.2023	\$	19.934	¥ 2.850.740	0	(210)	(210)	(0,02)
	08.2023	¥	2.838.626	\$ 19.934	211	0	211	0,02
	09.2023	PEN	9.795	2.660	0	(26)	(26)	0,00
MYI	07.2023	€	3.029	3.277	0	(28)	(28)	0,00
	07.2023	£	165.640	205.040	0	(5.547)	(5.547)	(0,44)
	07.2023	SEK	1.394	129	0	0	0	0,00
RBC	07.2023	\$	4.954	€ 4.615	81	0	81	0,01
	07.2023	£	59	75	1	(1)	0	0,00
	07.2023	NZD	194	117	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	SEK	107.609	10.025	62	0	62	0,00
	07.2023	\$	15.314	DKK 104.463	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023		1.626	€ 1.492	1	0	1	0,00
	07.2023		1.767	£ 1.400	13	0	13	0,00
	07.2023		10.116	SEK 109.217	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	DKK	104.289	\$ 15.314	8	0	8	0,00
	08.2023	SEK	109.082	10.116	4	0	4	0,00
SCX	07.2023	\$	1.168	£ 914	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	AUD	4.816	\$ 3.147	0	(59)	(59)	(0,01)
	07.2023	NZD	7.598	4.613	0	(42)	(42)	0,00
SOG	07.2023	\$	2.359	AUD 3.554	6	0	6	0,00
	08.2023	AUD	3.554	\$ 2.361	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023		2.915	1.907	0	(33)	(33)	0,00
TOR	07.2023	€	289.096	310.992	0	(4.412)	(4.412)	(0,35)
	07.2023	AUD	1.543	1.009	0	(18)	(18)	0,00
	07.2023	\$	2.889	AUD 4.374	23	0	23	0,00
	07.2023		2.332	CAD 3.086	2	(2)	0	0,00
	07.2023		203.428	£ 160.091	104	0	104	0,01
	07.2023		38.333	¥ 5.519.964	0	(142)	(142)	(0,01)
	07.2023		6.564	NZD 10.778	39	0	39	0,00
	08.2023	AUD	4.374	\$ 2.891	0	(23)	(23)	0,00
	08.2023	CAD	3.085	2.332	2	(2)	0	0,00
	08.2023	£	160.091	203.472	0	(100)	(100)	(0,01)
UAG	08.2023	¥	5.496.554	38.333	143	0	143	0,01
	08.2023	NZD	10.778	6.563	0	(39)	(39)	0,00
	07.2023	AUD	353	231	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	\$	4.655	AUD 6.971	9	(24)	(15)	0,00
	08.2023	AUD	6.971	\$ 4.658	25	(10)	15	0,00
				\$ 4.604	\$ (13.266)	\$ (8.662)	(0,69)	

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF	\$	60	66	0	0,00
BPS	07.2023			4.263	4.766	2	0,00
	07.2023	\$	CHF	6.484	5.865	72	0,01
	08.2023			4.766	4.250	(2)	0,00
MBC	07.2023	CHF	\$	190	212	0	0,00
MYI	07.2023			192	212	(3)	0,00
	07.2023	\$	CHF	2	1	0	0,00
RBC	07.2023	CHF	\$	2	3	0	0,00
SCX	07.2023			39	44	0	0,00
	07.2023	\$	CHF	4.688	4.212	20	0,00
UAG	07.2023	CHF	\$	4.383	4.890	(10)	0,00
	07.2023	\$	CHF	4.229	3.800	18	0,00
	08.2023			4.870	4.353	10	0,00
				\$ 122	\$ (15)	\$ 107	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	\$	14.295	15.619	25	0,00
	07.2023	\$	€	208.813	194.298	3.166	0,25
BPS	07.2023	€	\$	191.441	209.717	876	0,07
	07.2023	\$	€	209.584	194.960	3.118	0,25
	08.2023			191.522	174.549	0	(0,07)
CBK	07.2023	€	\$	189.507	206.009	21	(0,06)
	08.2023	\$	€	188.532	173.166	651	0,05
JPM	07.2023	€	\$	173.166	189.080	156	0,01
	08.2023	\$	€	189.345	173.166	0	(0,01)
MBC	07.2023	€	\$	14.483	15.663	23	(0,01)
SOG	07.2023	\$	€	209.726	194.960	2.975	0,24
				\$ 11.011	\$ (1.938)	\$ 9.073	0,72

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	\$	10.645	13.529	0	0,00
	07.2023	\$	£	126	100	(5)	0,00
BPS	07.2023			54.951	44.420	1.525	0,12
BRC	07.2023	£	\$	1.645	2.084	2	0,00
	07.2023	\$	£	50	41	(9)	0,00
CBK	07.2023	£	\$	7.686	9.775	23	0,00
	07.2023	\$	£	95	76	(19)	0,00
JPM	07.2023	£	\$	33.814	42.754	1	0,00
	08.2023	\$	£	42.763	33.814	0	(0,02)
MBC	07.2023	£	\$	4.959	6.341	36	0,00
	07.2023	\$	£	54.559	44.074	1.475	0,12
MYI	07.2023			54.675	43.992	0	0,10
RBC	07.2023	£	\$	5.877	7.477	1.253	0,10
TOR	07.2023			34.384	43.692	5	0,00
	08.2023	\$	£	43.702	34.384	0	0,00
				\$ 4.579	\$ (292)	\$ 4.287	0,34

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$	SGD	146.236	197.875	0	0,00
GLM	07.2023			40.533	54.427	(25)	(0,02)
MBC	07.2023			133.531	180.414	(316)	(0,02)
SCX	07.2023			118.195	159.971	(222)	(0,02)
				\$ 8	\$ (563)	\$ (555)	(0,04)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 2.481 0,20

Summe Anlagen

\$ 1.707.768 136,28

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (454.611) (36,28)

Nettovermögen

\$ 1.253.157 100,00

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(b) Mit dem Fonds verbunden.

(c) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 408.709 USD (31. Dezember 2022: 183.180 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

(d) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 9.181 USD (31. Dezember 2022: 79.359 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen als Sicherheit für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 286 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 17.212 USD (31. Dezember 2022: 13.037 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 6.410 USD (31. Dezember 2022: 5.380 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

**Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.691.697	\$ 5.668	\$ 1.697.365
Investmentfonds	189	0	0	189
Pensionsgeschäfte	0	7.529	0	7.529
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.096	1.589	0	2.685
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.285</b>	<b>\$ 1.700.815</b>	<b>\$ 5.668</b>	<b>\$ 1.707.768</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.661.693	\$ 0	\$ 1.661.693
Investmentfonds	12.424	0	0	12.424
Pensionsgeschäfte	0	1.053	0	1.053
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2.256	18.777	0	21.033
<b>Summen</b>	<b>\$ 14.680</b>	<b>\$ 1.681.523</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 1.696.203</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens	
BOS	5,170 %	20.06.2023	13.07.2023	\$ (65.967)	\$ (66.071)	(5,27)	
		21.06.2023	13.07.2023	(92.213)	(92.345)	(7,37)	
		22.06.2023	13.07.2023	(73.094)	(73.189)	(5,84)	
		15.06.2023	13.07.2023	(72.713)	(72.880)	(5,82)	
		26.06.2023	17.07.2023	(20.757)	(20.772)	(1,66)	
		30.06.2023	13.07.2023	(51.678)	(51.685)	(4,12)	
		30.06.2023	03.07.2023	(13.640)	(13.642)	(1,09)	
		30.06.2023	06.07.2023	(18.305)	(18.308)	(1,46)	
		<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>				<b>\$ (408.892)</b>	<b>(32,63)</b>

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2023:**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
TDM	5,180 %	28.06.2023	12.07.2023	\$ (3.193)	\$ (3.194)	(0,26)
		29.06.2023	13.07.2023	(2.574)	(2.574)	(0,21)
		29.06.2023	06.07.2023	(3.442)	(3.444)	(0,27)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>				<b>\$ (9,212)</b>	<b>(0,74)</b>	

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 12 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.



Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Derivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (5)	\$ 10	\$ 5	\$ 1.129	\$ (820)	\$ 309
BOA	2.465	(2.050)	415	2.665	(2.510)	155
BPS	6.981	(6.190)	791	(530)	450	(80)
BRC	(31)	0	(31)	166	0	166
CBK	(251)	280	29	6.045	(6.000)	45
DUB	(1.262)	1.020	(242)	(1.270)	1.230	(40)
FAR	(312)	430	118	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(401)	290	(111)	1.583	(1.500)	83
GST	0	0	0	(1.050)	1.130	80
JPM	(125)	0	(125)	(314)	640	326
MBC	(4.343)	3.280	(1.063)	(485)	340	(145)
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(12)	30	18
MYI	1.325	(950)	375	(2.046)	1.530	(516)
RBC	(1)	0	(1)	317	(280)	37
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	773	(450)	323
SAL	(15)	10	(5)	(11)	10	(1)
SCX	(73)	0	(73)	5.105	0,88	185
SOG	(1.470)	1.090	(380)	k. A.	(4.920)	k. A.
TOR	(13)	0	(13)	31	(60)	(29)
UAG	12	0	12	(40)	20	(20)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	126,66	114,97
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	8,79	6,69
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,13
Investmentfonds	0,02	0,91
Pensionsgeschäfte	0,60	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,18	0,26
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,17)	0,40
Freiverkehrsfinanzderivate	0,20	0,88
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(32,63)	(19,18)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,74)	(5,83)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,02	1,01
Kanada	0,17	0,16
Cayman-Inseln	0,42	0,55
Dänemark	2,92	3,10
Frankreich	7,08	5,15
Deutschland	3,96	4,63
Irland	4,42	3,76
Italien	9,47	6,49
Japan	5,14	5,03
Luxemburg	0,18	0,17
Niederlande	0,20	0,19
Neuseeland	0,56	0,52
Peru	0,02	0,09
Slowenien	0,05	0,04
Spanien	0,40	0,35
Schweden	0,86	0,82
Schweiz	0,24	k. A.
Großbritannien	15,66	14,56
USA	82,39	75,17
Kurzfristige Instrumente	0,29	k. A.
Investmentfonds	0,02	0,91
Pensionsgeschäfte	0,60	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,20	0,26
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,02)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,17)	0,40
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,15	0,27
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,28)	(0,57)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,69)	(0,55)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,03	1,74
Sonstige Aktiva und Passiva	(36,28)	(24,32)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Australia Government International Bond				
0,250 % fällig am 21.11.2032	AUD 18.952	\$ 11.060	0,44	
0,750 % fällig am 21.11.2027	19.495	12.601	0,50	
2,000 % fällig am 21.08.2035	4.902	3.361	0,14	
Summe Australien		27.022	1,08	
<b>BELGIEN</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Belgium Government International Bond				
1,400 % fällig am 22.06.2053	€ 2.500	1.742	0,07	
<b>KANADA</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Canadian Government Real Return Bond				
0,500 % fällig am 01.12.2050				
(b)	CAD 9.264	5.604	0,22	
1,250 % fällig am 01.12.2047 (b)	11.769	8.527	0,34	
1,500 % fällig am 01.12.2044 (b)	10.875	8.224	0,33	
3,000 % fällig am 01.12.2036 (b)	4.251	3.786	0,15	
4,000 % fällig am 01.12.2031 (b)	12.833	11.585	0,46	
Summe Kanada		37.726	1,50	
<b>CAYMAN INSELN</b>				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
BlueMountain CLO Ltd.				
6,340 % fällig am 15.07.2031	\$ 3.600	3.553	0,14	
Catamaran CLO Ltd.				
6,373 % fällig am 22.04.2030	6.527	6.488	0,26	
Denali Capital CLO Ltd.				
6,310 % fällig am 15.04.2031	498	491	0,02	
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
6,373 % fällig am 15.09.2037	4.732	4.669	0,19	
Magnetite Ltd.				
6,240 % fällig am 15.04.2031	589	586	0,02	
OZLM Ltd.				
6,348 % fällig am 16.05.2030	4.517	4.485	0,18	
Regatta Funding Ltd.				
6,330 % fällig am 17.07.2031	6.000	5.947	0,24	
Starwood Commercial Mortgage Trust				
6,296 % fällig am 15.07.2038	3.255	3.228	0,13	
Venture CLO Ltd.				
6,311 % fällig am 07.09.2030	1.121	1.112	0,04	
6,350 % fällig am 20.01.2029	2.747	2.728	0,11	
Voya CLO Ltd.				
6,162 % fällig am 18.01.2029	1.536	1.529	0,06	
Summe Cayman Inseln		34.816	1,39	
<b>DANEMARK</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
DLR Kredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 3.349	361	0,02	
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	49	5	0,00	
1,000 % fällig am 01.10.2053	12	1	0,00	
1,500 % fällig am 01.10.2050	37	4	0,00	
1,500 % fällig am 01.10.2053	8.549	943	0,04	
2,500 % fällig am 01.10.2047	3	0	0,00	
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
0,500 % fällig am 01.10.2043	27.907	3.094	0,12	
0,500 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	
1,000 % fällig am 01.10.2050	3.069	304	0,01	
1,500 % fällig am 01.10.2053	119.227	12.607	0,50	
2,500 % fällig am 01.10.2047	15	2	0,00	
Nykredit Realkredit A/S				
0,500 % fällig am 01.10.2053	13	1	0,00	
1,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	
1,000 % fällig am 01.10.2053	24	2	0,00	
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	
1,500 % fällig am 01.10.2053	13.724	1.450	0,06	
2,000 % fällig am 01.10.2053	49.231	5.625	0,22	
2,500 % fällig am 01.10.2047	3	0	0,00	
3,000 % fällig am 01.10.2053	11.849	1.526	0,06	
3,500 % fällig am 01.10.2053	56.276	7.534	0,30	
5,000 % fällig am 01.10.2053	4.374	631	0,03	

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 4.926	\$ 519	0,02	
1,000 % fällig am 01.10.2053	48.829	4.879	0,19	
1,500 % fällig am 01.10.2050	51.006	5.470	0,22	
1,500 % fällig am 01.10.2053	109.225	11.486	0,46	
2,500 % fällig am 01.04.2047	8	1	0,00	
		56.445	2,25	
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Denmark Government International Bond				
0,100 % fällig am 15.11.2023 (b)	109.791	16.107	0,64	
Summe Dänemark		72.552	2,89	
<b>FRANKREICH</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
France Government International Bond				
0,100 % fällig am 01.03.2025 (b)	€ 33.701	36.107	1,44	
0,100 % fällig am 01.03.2026 (b)	33.397	35.710	1,42	
0,100 % fällig am 01.03.2028 (b)	39.880	42.717	1,70	
0,100 % fällig am 01.03.2029 (b)	8.255	8.767	0,35	
0,100 % fällig am 01.03.2032 (b)	3.024	3.224	0,13	
0,100 % fällig am 25.07.2036 (b)	14.739	15.123	0,60	
0,100 % fällig am 25.07.2038 (b)	746	759	0,03	
0,550 % fällig am 01.03.2039 (b)	9.354	10.182	0,41	
0,700 % fällig am 25.07.2030 (b)	28.660	31.858	1,27	
1,800 % fällig am 25.07.2040 (b)	19.365	25.154	1,00	
1,850 % fällig am 25.07.2027 (b)	13.884	15.921	0,63	
Summe Frankreich		225.522	8,98	
<b>DEUTSCHLAND</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Landwirtschaftliche Rentenbank				
0,875 % fällig am 15.12.2026	£ 7.600	8.215	0,33	
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Bundesrepublik Deutschland				
0,100 % fällig am 15.04.2046 (b)	€ 13.564	15.380	0,61	
Summe Deutschland		23.595	0,94	
<b>IRLAND</b>				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
Adagio CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.10.2031	1.700	1.819	0,07	
3,965 % fällig am 10.10.2031	5.800	6.209	0,25	
4,541 % fällig am 20.07.2036	11.600	12.656	0,50	
Ares European CLO				
3,837 % fällig am 15.10.2030	7.353	7.873	0,31	
Ares European CLO DAC				
3,957 % fällig am 15.10.2031	2.200	2.359	0,09	
4,050 % fällig am 20.04.2032	600	642	0,03	
Armada Euro CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.07.2031	4.398	4.694	0,19	
4,083 % fällig am 15.11.2031	5.510	5.888	0,23	
Avoca CLO DAC				
3,885 % fällig am 12.01.2031	5.483	5.875	0,23	
Bain Capital Euro CLO DAC				
3,980 % fällig am 20.04.2032	3.652	3.922	0,16	
Black Diamond CLO DAC				
4,303 % fällig am 15.05.2032	7.400	7.899	0,31	
Blackrock European CLO DAC				
4,426 % fällig am 15.12.2032	1.900	2.019	0,08	
BNPP AM Euro CLO DAC				
4,031 % fällig am 22.07.2032	3.150	3.358	0,13	
Bosphorus CLO DAC				
4,346 % fällig am 15.12.2030	2.484	2.669	0,11	
Cairn CLO DAC				
3,842 % fällig am 30.04.2031	3.450	3.688	0,15	
3,957 % fällig am 15.10.2031	4.500	4.812	0,19	
4,212 % fällig am 20.10.2028	115	125	0,01	
Carlyle Euro CLO DAC				
3,877 % fällig am 15.01.2031	4.082	4.359	0,17	
3,953 % fällig am 15.08.2030	2.898	3.091	0,12	
4,213 % fällig am 15.08.2032	5.400	5.759	0,23	

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				
3,927 % fällig am 15.07.2030	944	1.015	0,04	
Contego CLO DAC				
3,851 % fällig am 23.01.2030	€ 1.097	\$ 1.173	0,05	
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
4,008 % fällig am 27.01.2031	988	1.059	0,04	
4,156 % fällig am 15.09.2031	2.799	2.989	0,12	
Dryden Euro CLO DAC				
3,837 % fällig am 15.04.2033	4.200	4.482	0,18	
4,183 % fällig am 15.05.2034	2.500	2.669	0,11	
Euro-Galaxy CLO DAC				
3,831 % fällig am 24.04.2034	5.600	5.950	0,24	
Harvest CLO DAC				
1,040 % fällig am 15.07.2031	1.000	995	0,04	
3,880 % fällig am 20.10.2031	2.200	2.351	0,09	
3,937 % fällig am 15.07.2031	7.400	7.879	0,31	
4,027 % fällig am 15.01.2032	3.700	3.950	0,16	
Jubilee CLO DAC				
3,777 % fällig am 15.04.2030	600	639	0,03	
3,827 % fällig am 15.04.2031	1.700	1.810	0,07	
4,326 % fällig am 15.12.2029	267	288	0,01	
Laurelin DAC				
3,920 % fällig am 20.10.2031	3.800	4.071	0,16	
Madison Park Euro Funding DAC				
3,977 % fällig am 15.07.2032	7.300	7.768	0,31	
Man GLG Euro CLO DAC				
3,857 % fällig am 15.10.2030	2.638	2.826	0,11	
4,047 % fällig am 15.01.2030	396	426	0,02	
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,940 % fällig am 20.10.2031	1.900	2.019	0,08	
OCF Euro CLO DAC				
4,091 % fällig am 22.09.2034	7.300	7.757	0,31	
Palmer Square European Loan Funding DAC				
3,897 % fällig am 15.10.2031	4.034	4.314	0,17	
3,907 % fällig am 15.07.2031	2.188	2.331	0,09	
Purple Finance CLO DAC				
4,061 % fällig am 25.01.2031	1.081	1.168	0,05	
Segovia European CLO DAC				
3,945 % fällig am 18.01.2031	881	944	0,04	
4,080 % fällig am 20.07.2032	6.400	6.803	0,27	
Tikehau CLO DAC				
4,144 % fällig am 04.08.2034	3.500	3.731	0,15	
Toro European CLO DAC				
4,133 % fällig am 15.02.2034	10.300	10.937	0,44	
		182.060	7,25	
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				
European Loan Conduit DAC				
4,358 % fällig am 17.02.2030	2.389	2.552	0,10	
Glenbeigh Issuer DAC				
4,350 % fällig am 24.06.2050	12.205	13.253	0,53	
Primrose Residential DAC				
4,189 % fällig am 24.03.2061	7.223	7.826	0,31	
Shamrock Residential DAC				
4,289 % fällig am 24.12.2059	4.514	4.877	0,19	
4,689 % fällig am 24.02.2071	6.844	7.424	0,30	
		35.932	1,43	
Summe Irland		217.992	8,68	
<b>ITALIEN</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
UniCredit SpA				
3,375 % fällig am 31.01.2027	7.000	7.536	0,30	
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
0,400 % fällig am 15.05.2030 (b)	26.207	26.154	1,04	
1,250 % fällig am 15.09.2032 (b)	9.302	9.764	0,39	
1,300 % fällig am 15.05.2028 (b)	58.612	62.740	2,50	
1,400 % fällig am 26.05.2025 (b)	70.272	75.914	3,02	
2,400 % fällig am 15.05.2039 (b)	40.342	46.185	1,84	
		220.757	8,79	
Summe Italien		228.293	9,09	

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Real Return Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>JAPAN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Japan Government International Bond			
0,005 % fällig am 10.03.2031 (b)	¥ 962.016	\$ 7.139	0,29
0,100 % fällig am 10.03.2025 (b)	363.460	2.596	0,10
0,100 % fällig am 10.03.2026 (b)	3.537.688	25.639	1,02
0,100 % fällig am 10.03.2028 (b)	3.367.695	24.559	0,98
0,100 % fällig am 10.03.2029 (b)	5.928.919	43.420	1,73
Summe Japan		103.353	4,12

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>NIEDERLANDE</b>			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Eurosail BV			
4,677 % fällig am 17.10.2040	€ 923	1.007	0,04
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
BNP Bank NV			
0,500 % fällig am 21.12.2026	£ 7.700	8.201	0,33
Niederlandse Waterschapsbank NV			
0,875 % fällig am 30.09.2026	7.500	8.196	0,32
		16.397	0,65
Summe Niederlande		17.404	0,69

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>NEUSEELAND</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
New Zealand Government International Bond			
2,000 % fällig am 20.09.2025	NZD 68.806	42.096	1,68
3,000 % fällig am 20.09.2030	53	34	0,00
Summe Neuseeland		42.130	1,68

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>PERU</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Peru Government International Bond			
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 1.200	325	0,01

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>SLOWENIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nova Ljubljanska Banka d.d.			
3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 1.100	1.020	0,04

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>SPANIEN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
BBVA Consumer Auto			
0,270 % fällig am 20.07.2031	578	615	0,02

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Spain Government International Bond			
0,000 % fällig am 31.01.2028 (a)	9.600	9.049	0,36
0,500 % fällig am 31.10.2031	200	174	0,01
0,700 % fällig am 30.11.2033 (b)	17.689	18.479	0,74
0,850 % fällig am 30.07.2037	400	305	0,01
1,000 % fällig am 30.11.2030 (b)	2.765	3.010	0,12
1,450 % fällig am 31.10.2027	13.400	13.568	0,54
3,150 % fällig am 30.04.2033	228	244	0,01
3,550 % fällig am 31.10.2033	160	176	0,01
3,900 % fällig am 30.07.2039	500	558	0,02
		45.563	1,82
Summe Spanien		46.178	1,84

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>SCHWEDEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Sweden Government International Bond			
0,125 % fällig am 01.06.2026	SEK 115.086	10.352	0,41
0,125 % fällig am 01.12.2027	16.719	1.496	0,06
0,125 % fällig am 01.06.2032	57.120	4.987	0,20
1,000 % fällig am 01.06.2025	128.411	11.813	0,47
Summe Schweden		28.648	1,14

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>SCHWEIZ</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
UBS Group AG			
2,125 % fällig am 13.10.2026	€ 900	\$ 915	0,04
2,875 % fällig am 02.04.2032	700	667	0,03
4,177 % fällig am 16.01.2026	300	322	0,01
6,373 % fällig am 15.07.2026	\$ 750	745	0,03
7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 1.000	1.210	0,05
Summe Schweiz		3.859	0,16

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Alba PLC			
5,191 % fällig am 17.03.2039	£ 1.940	2.372	0,09
Atlas Funding PLC			
5,432 % fällig am 25.07.2058	4.670	5.934	0,24
Canada Square Funding PLC			
5,316 % fällig am 17.01.2059	8.889	11.237	0,45
Canterbury Finance PLC			
5,377 % fällig am 16.05.2058	1.083	1.375	0,06
Eurosail PLC			
3,619 % fällig am 13.03.2045	€ 1.462	1.576	0,06
3,736 % fällig am 10.06.2044	1.541	1.667	0,07
3,736 % fällig am 10.09.2044	1.965	2.119	0,08
5,140 % fällig am 13.03.2045	£ 2.035	2.557	0,10
Great Hall Mortgages PLC			
5,152 % fällig am 18.03.2039	24	31	0,00
5,172 % fällig am 18.06.2038	17	22	0,00
London Wall Mortgage Capital PLC			
5,502 % fällig am 15.05.2052	2.294	2.894	0,12
Polaris PLC			
5,631 % fällig am 23.12.2058	4.606	5.830	0,23
5,640 % fällig am 23.10.2059	10.553	13.325	0,53
Precise Mortgage Funding PLC			
6,065 % fällig am 12.12.2055	3.293	4.201	0,17
Rochester Financing PLC			
5,602 % fällig am 18.12.2044	6.689	8.403	0,34
Stratton BTL Mortgage Funding PLC			
5,221 % fällig am 20.01.2054	4.130	5.224	0,21
Stratton Mortgage Funding PLC			
5,765 % fällig am 12.03.2052	1.634	2.070	0,08
Towd Point Mortgage Funding PLC			
5,635 % fällig am 20.10.2051	2.782	3.542	0,14
5,841 % fällig am 20.07.2045	2.233	2.808	0,11
Tower Bridge Funding PLC			
5,527 % fällig am 20.11.2063	2.157	2.728	0,11
5,629 % fällig am 20.12.2063	3.212	4.065	0,16
Twin Bridges PLC			
6,115 % fällig am 12.12.2054	5.179	6.599	0,26
		90.579	3,61

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
United Kingdom Gilt			
0,125 % fällig am 10.08.2028 (b)	36.163	44.223	1,76
0,125 % fällig am 10.08.2031 (b)	19.798	24.473	0,98
0,125 % fällig am 22.03.2039 (b)	8.037	9.116	0,36
0,125 % fällig am 10.08.2041 (b)	10.801	12.006	0,48
0,125 % fällig am 22.03.2044 (b)	13.884	14.833	0,59
0,125 % fällig am 22.03.2046 (b)	7.083	7.393	0,29
0,125 % fällig am 10.08.2048 (b)	5.600	5.765	0,23
0,125 % fällig am 22.03.2051 (b)	17.724	17.948	0,72
0,125 % fällig am 22.11.2056 (b)	7.806	7.828	0,31
0,125 % fällig am 22.03.2058 (b)	14.358	14.367	0,57
0,125 % fällig am 22.11.2065 (b)	9.799	9.909	0,39
0,125 % fällig am 22.03.2068 (b)	14.624	14.798	0,59
0,125 % fällig am 22.03.2073 (b)	2.659	2.867	0,11
0,250 % fällig am 22.03.2052 (b)	19.715	20.759	0,83
0,375 % fällig am 22.03.2062 (b)	17.886	19.719	0,79
0,500 % fällig am 22.03.2050 (b)	11.664	13.178	0,53
0,500 % fällig am 22.10.2061	6.200	2.502	0,10
0,625 % fällig am 22.03.2040 (b)	21.787	26.671	1,06
0,625 % fällig am 22.11.2042 (b)	14.818	17.914	0,71
0,625 % fällig am 22.03.2045 (b)	16.791	19.727	0,79
0,625 % fällig am 22.10.2050	2.400	1.240	0,05
0,750 % fällig am 22.03.2034 (b)	29.844	38.352	1,53
0,750 % fällig am 22.11.2047 (b)	11.621	13.972	0,56
1,125 % fällig am 22.11.2037 (b)	21.925	29.146	1,16

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>USA</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Accredited Mortgage Loan Trust			
5,410 % fällig am 25.09.2036	\$ 1.322	1.300	0,05
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
6,200 % fällig am 25.12.2033	1.164	1.135	0,05
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,110 % fällig am 25.10.2035	1.678	1.503	0,06
Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
6,090 % fällig am 25.06.2029	8	8	0,00
Asset-Backed Funding Certificates Trust			
5,290 % fällig am 25.10.2036	6.455	5.894	0,23
5,750 % fällig am 25.10.2034	260	261	0,01
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
6,543 % fällig am 15.04.2033	167	164	0,01
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
4,807 % fällig am 25.05.2035	221	219	0,01
Carrington Mortgage Loan Trust			
5,400 % fällig am 25.04.2036	12.546	11.023	0,44
CIT Mortgage Loan Trust			
6,500 % fällig am 25.10.2037	61	61	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust			
5,440 % fällig am 25.09.2036	434	410	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,095 % fällig am 25.10.2034	823	779	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
5,840 % fällig am 25.10.2035 ^	3.100	2.773	0,11
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
6,110 % fällig am 25.02.2036	7.529	7.342	0,29
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
4,599 % fällig am 25.01.2032	1	1	0,00
Ellington Loan Acquisition Trust			
6,250 % fällig am 25.05.2037	793	759	0,03
Encore Credit Receivables Trust			
6,050 % fällig am 25.01.2036	1.400	1.318	0,05
First Franklin Mortgage Loan Trust			
5,460 % fällig am 25.07.2036	898	848	0,03
6,020 % fällig am 25.09.2035	1.218	1.199	0,05
Home Equity Asset Trust			
6,005 % fällig am 25.08.2034	55	53	0,00
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
5,790 % fällig am 25.03.2036	1.786	1.756	0,07
HSI Asset Securitization Corp. Trust			
5,470 % fällig am 25.05.2037	219	218	0,01
Lehman XS Trust			
7,450 % fällig am 25.12.2037	1.730	1.753	0,07
Massachusetts Educational Financing Authority			
6,205 % fällig am 25.04.2038	36	36	0,00
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
5,810 % fällig am 25.01.2035	1.537	1.488	0,06
New Century Home Equity Loan Trust			
5,870 % fällig am 25.10.2035	732	699	0,03
5,915 % fällig am 25.02.2035	1.963	1.794	0,07
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
5,585 % fällig am 25.03.2036	649	637	0,03
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,945 % fällig am 25.07.2035	47	46	0,00
Saxon Asset Securities Trust			
1,942 % fällig am 25.05.2035	3.444	3.166	0,13
5,460 % fällig am 25.09.2037	819	773	0,03
		49.416	1,97
Summe Großbritannien		637.121	25,38

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
Eversource Energy				Structured Asset Securities Corp.				0,250 % fällig am 15.02.2050			
2,900 % fällig am 01.10.2024	\$ 100	\$ 96	0,00	5,500 % fällig am 25.03.2035	198	169	0,01	0,375 % fällig am 15.07.2025	32.103	30.727	1,22
Lehman Brothers Holdings, Inc.				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				0,375 % fällig am 15.01.2027	24.811	23.286	0,93
0,000 % fällig am 05.03.2010 ^	€ 950	6	0,00	5,690 % fällig am 25.12.2045	20	20	0,00	0,375 % fällig am 15.07.2027	16.020	15.022	0,60
0,000 % fällig am 05.04.2011 ^	10	0	0,00	5,710 % fällig am 25.11.2045	664	608	0,02	0,500 % fällig am 15.04.2024	7.817	7.628	0,30
		102	0,00			13.548	0,54	0,500 % fällig am 15.01.2028 (d)	110.334	103.236	4,11
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
Banc of America Funding Trust				Fannie Mae				0,625 % fällig am 15.01.2024	22.714	22.330	0,89
3,826 % fällig am 20.01.2047	\$ 1.033	882	0,04	4,633 % fällig am 01.12.2030	\$ 1	\$ 1	0,00	0,625 % fällig am 15.02.2043	34.867	32.066	1,28
Bear Stearns ALT-A Trust				4,944 % fällig am 01.09.2044	20	19	0,00	0,750 % fällig am 15.07.2028	14.222	11.678	0,47
4,202 % fällig am 25.09.2035 ^	58	36	0,00	Freddie Mac				0,750 % fällig am 15.02.2042	39.827	37.753	1,50
Citigroup Mortgage Loan Trust				3,759 % fällig am 01.09.2036	19	19	0,00	0,750 % fällig am 15.02.2045	20.269	17.239	0,69
3,974 % fällig am 25.09.2037 ^	213	187	0,01	3,928 % fällig am 01.10.2036	24	24	0,00	0,875 % fällig am 15.02.2049	25.877	21.408	0,85
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				5,176 % fällig am 25.10.2044	212	195	0,01	0,875 % fällig am 15.01.2029	1.946	1.843	0,07
6,430 % fällig am 25.09.2035	2	2	0,00	5,280 % fällig am 25.10.2044	4	4	0,00	0,875 % fällig am 15.02.2047	20.230	16.992	0,68
Countrywide Alternative Loan Trust				5,290 % fällig am 25.09.2031	7	6	0,00	1,000 % fällig am 15.02.2046	29.429	25.557	1,02
6,000 % fällig am 25.04.2037	830	708	0,03	5,793 % fällig am 15.12.2037	129	127	0,01	1,000 % fällig am 15.02.2048	18.949	16.318	0,65
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				6,049 % fällig am 01.07.2036	51	51	0,00	1,000 % fällig am 15.02.2049	\$ 16.513	\$ 14.218	0,57
3,519 % fällig am 30.11.2037	1.172	1.076	0,04	Ginnie Mae				1,125 % fällig am 15.01.2033 (d)	26.678	25.577	1,02
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				2,875 % fällig am 20.04.2030	2	3	0,00	1,375 % fällig am 15.02.2044 (d)	33.538	31.622	1,26
5,737 % fällig am 19.10.2045	2.544	2.176	0,09	3,000 % fällig am 20.05.2030	2	2	0,00	1,500 % fällig am 15.02.2053	8.163	7.933	0,32
GreenPoint Mortgage Funding Trust				3,375 % fällig am 20.05.2030	24	24	0,00	1,625 % fällig am 15.10.2027 (d)	74.848	73.771	2,94
5,590 % fällig am 25.06.2045	75	70	0,00	3,858 % fällig am 20.08.2068	1.793	1.746	0,07	2,000 % fällig am 15.01.2026	17.379	17.150	0,68
GSR Mortgage Loan Trust				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				2,125 % fällig am 15.02.2040	15.493	16.636	0,66
4,070 % fällig am 25.09.2035	45	43	0,00	4,000 % fällig am 01.08.2053	57.400	53.918	2,15	2,125 % fällig am 15.02.2041 (d)	39.294	42.199	1,68
Impac CMB Trust				4,500 % fällig am 01.08.2053	100.400	96.580	3,84	2,375 % fällig am 15.01.2025	27.017	26.738	1,07
5,790 % fällig am 25.03.2035	1.085	994	0,04			152.719	6,08	3,625 % fällig am 15.04.2028 (d)	55.098	59.159	2,36
JPMorgan Mortgage Trust				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				<b>AKTIEN</b>			
4,319 % fällig am 25.07.2035	168	159	0,01	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				0,125 % fällig am 15.07.2024	28.103	27.263	1,09	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
5,632 % fällig am 20.10.2029	10	10	0,00	0,125 % fällig am 15.10.2024	31.801	30.677	1,22	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO</b>			
6,053 % fällig am 15.08.2032	117	109	0,00	0,125 % fällig am 15.04.2025 (d)	97.698	92.954	3,70	<b>US Dollar Short-Term Floating</b>			
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0,125 % fällig am 15.10.2025	25.016	23.721	0,94	<b>NAV Fund (c)</b>			
5,840 % fällig am 25.08.2036	3.768	3.544	0,14	0,125 % fällig am 15.04.2026 (d)	55.851	52.382	2,09	1.020.375	10.161	0,40	
OBX Trust				0,125 % fällig am 15.07.2026	37.556	35.286	1,41	<b>Summe Investmentfonds</b>			
5,800 % fällig am 25.06.2057	168	160	0,01	0,125 % fällig am 15.10.2026 (d)	43.956	41.102	1,64	<b>\$ 3.401.577 135,49</b>			
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				0,125 % fällig am 15.04.2027	19.229	17.803	0,71	<b>Summe USA</b>			
6,950 % fällig am 25.04.2035	820	788	0,03	0,125 % fällig am 15.01.2030 (d)	75.921	68.133	2,71	<b>1.645.769 65,55</b>			
Sequoia Mortgage Trust				0,125 % fällig am 15.07.2030	26.026	23.351	0,93	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>			
5,846 % fällig am 19.10.2026	4	4	0,00	0,125 % fällig am 15.01.2031	8.739	7.770	0,31	<b>\$ 3.401.577 135,49</b>			
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				0,125 % fällig am 15.07.2031 (d)	187.959	166.759	6,64	<b>Summe kurzfristige Instrumente</b>			
4,263 % fällig am 25.08.2047	1.661	1.559	0,06	0,125 % fällig am 15.01.2032	30.309	26.697	1,06	<b>6.510 0,26</b>			
4,984 % fällig am 25.09.2034	257	244	0,01	0,125 % fällig am 15.02.2051	14.458	9.660	0,38	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>			
				0,125 % fällig am 15.02.2052	3.705	2.461	0,10	<b>\$ 3.401.577 135,49</b>			
				0,250 % fällig am 15.01.2025	16.007	15.347	0,61	<b>\$ 3.401.577 135,49</b>			
				0,250 % fällig am 15.07.2029 (d)	73.214	66.881	2,66	<b>\$ 3.401.577 135,49</b>			

<b>PENSIONSGESCHÄFTE</b>						Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermö- gens
Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch				
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 2.272	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (2.317)	\$ 2.272	\$ 2.272	0,09
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (2.317)</b>	<b>\$ 2.272</b>	<b>\$ 2.272</b>	<b>0,09</b>

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Real Return Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	205	\$ 84	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	43	(18)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	811	1.494	0,06
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	180	(198)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	36	36	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	203	(280)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	102	101	0,01
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	261	(27)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	3.063	2.718	0,11
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	48	(174)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	129	285	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	865	1.029	0,04
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	1.481	2.891	0,12
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	442	553	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	42	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	147	(290)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	339	44	0,00
				\$ 8.249	0,33

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 113,000	21.07.2023	388	\$ (274)	\$ (432)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 7.817	0,31

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 800	\$ 47	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 4.800	\$ (434)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 10.717.000	(771)	(0,03)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	3.683.000	(181)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,840	21.11.2028	\$ 19.700	1.880	0,07
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	13.400	(3.758)	(0,15)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	21.11.2053	7.400	(2.090)	(0,08)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	32.200	692	0,03
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	82.600	(1.486)	(0,06)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	9.000	(13)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	5.300	(78)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	16.700	(132)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	134.900	809	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.07.2023	13.400	(53)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 6.500	(291)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	68.400	(663)	(0,03)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	47.600	113	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	119.200	121	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	150.500	(80)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,710	15.03.2033	5.900	1.675	0,07
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	25.700	1.119	0,04
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	12.900	625	0,02
Zahlung	CPTFEMU	2,570	15.06.2032	1.300	1	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	20.300	950	0,04
Zahlung	CPTFEMU	2,680	15.04.2053	6.400	(94)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,700	15.04.2053	8.500	0	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,720	15.06.2032	63.300	1.539	0,06
Erhalt	CPTFEMU	2,975	15.08.2027	17.800	246	0,01
Zahlung	CPTFEMU	3,520	15.09.2024	23.800	(296)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	3,720	15.09.2024	6.400	(44)	0,00

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	CPTFEMU		3,850 %	15.09.2024	€ 27.600	\$ (172)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA		1,760	04.11.2029	\$ 23.300	(3.512)	(0,14)
Zahlung	CPURNSA		1,883	20.11.2029	300	(42)	0,00
Zahlung	CPURNSA		1,954	03.06.2029	6.200	(824)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA		1,998	25.07.2029	1.800	(228)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA		2,311	24.02.2031	6.500	699	0,03
Erhalt	CPURNSA		2,314	26.02.2026	14.400	1.421	0,06
Zahlung	CPURNSA		2,364	10.05.2028	800	(69)	0,00
Zahlung	CPURNSA		2,370	06.06.2028	12.900	(1.118)	(0,05)
Zahlung	CPURNSA		2,379	09.07.2028	700	(59)	0,00
Erhalt	CPURNSA		2,573	26.08.2028	2.200	136	0,01
Erhalt	CPURNSA		2,645	10.09.2028	3.600	195	0,01
Erhalt	CPURNSA		2,690	01.06.2026	2.300	172	0,01
Erhalt	CPURNSA		2,703	25.05.2026	8.980	672	0,03
Erhalt	CPURNSA		2,768	13.05.2026	13.900	1.014	0,04
Erhalt	CPURNSA		2,813	14.05.2026	20.100	1.420	0,06
Zahlung	UKRPI		3,835	15.10.2032	£ 22.800	(1.968)	(0,08)
Erhalt	UKRPI		4,140	15.10.2031	14.200	1.520	0,06
Zahlung	UKRPI		4,143	15.10.2032	22.800	(1.765)	(0,07)
Erhalt	UKRPI		4,250	15.11.2031	17.860	1.962	0,08
Erhalt	UKRPI		4,300	15.01.2032	6.000	403	0,01
Erhalt	UKRPI		4,615	15.02.2027	12.300	772	0,03
Erhalt	UKRPI		5,200	15.06.2024	5.500	359	0,01
Erhalt	UKRPI		5,330	15.06.2024	11.900	737	0,03
Erhalt	UKRPI		6,290	15.03.2024	5.500	461	0,02
Erhalt	UKRPI		6,440	15.05.2024	2.200	152	0,01
Zahlung	UKRPI		6,500	15.03.2024	26.700	(2.088)	(0,08)
Erhalt	UKRPI		6,600	15.05.2024	5.400	350	0,01
						\$ (94)	0,00
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ (47)</b>	<b>0,00</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnahmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,237 %	17.11.2023	27.000	\$ 1.676	\$ 5.924	0,24

##### VERKAUFSoPTIONEN

##### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	7.800	\$ (356)	\$ (439)	(0,02)
JPM	Cap - OTC CPURNSA	233,916	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	22.04.2024	37.600	(273)	0	0,00
	Cap - OTC CPURNSA	234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	3.100	(22)	0	0,00
						\$ (651)	\$ (439)	(0,02)

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	61.100	\$ (174)	\$ (70)	0,00
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,340	17.11.2023	133.200	(1.678)	(9.825)	(0,39)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420	21.09.2023	138.300	(787)	(591)	(0,02)
JPM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	12.09.2023	85.400	(239)	(99)	(0,01)
						\$ (2.878)	\$ (10.585)	(0,42)	

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Real Return Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 12.200	\$ (713)	\$ 711	\$ (2)	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.500	(5)	(23)	(28)	0,00
					\$ (718)	\$ 688	\$ (30)	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2023	AUD	\$	940	615	\$ 0	0,00	
	07.2023	\$	AUD	3.434	5.175	11	0,00	
BOA	08.2023	AUD	\$	5.175	3.437	0	0,00	
	07.2023			8.748	5.707	0	0,01	
BPS	07.2023	CAD		51.867	38.118	0	0,04	
	07.2023	DKK		130.252	18.809	0	0,01	
	07.2023	€		40.946	44.049	0	0,03	
	07.2023	NZD		17.742	10.764	0	0,01	
	07.2023	\$	DKK	33.332	226.631	0	0,01	
	07.2023		£	5.602	4.430	30	0,00	
	08.2023	DKK	\$	226.252	33.332	126	0,01	
	07.2023	¥		13.178.675	94.855	3.676	0,15	
	07.2023	\$	AUD	2.450	3.699	12	0,00	
	07.2023		€	1.475	1.356	5	0,00	
BRC	07.2023		£	7.091	5.561	0	0,00	
	08.2023	AUD	\$	3.699	2.452	0	0,00	
CBK	07.2023	NZD		418	251	0	0,00	
	07.2023	AUD		3.267	2.131	0	0,00	
IND	07.2023	€		5.417	5.813	0	0,00	
	07.2023	£		4.190	5.259	0	0,00	
	07.2023	DKK		382.791	55.253	0	0,03	
	07.2023	AUD		7.269	4.752	0	0,00	
	07.2023	NZD		4.075	2.513	16	0,00	
	07.2023	\$	DKK	3.021	20.815	28	0,00	
	07.2023		€	755.430	691.849	0	0,03	
	07.2023		£	641.676	507.494	3.527	0,14	
	07.2023		¥	31.382	4.487.945	0	0,01	
	07.2023		NZD	42.427	69.621	226	0,01	
MBC	08.2023	€	\$	691.849	756.486	645	0,02	
	08.2023	£		507.494	641.812	0	0,14	
	08.2023	¥		4.468.874	31.382	332	0,01	
	08.2023	NZD		69.621	42.424	0	0,01	
	09.2023	PEN		8.962	2.434	0	0,00	
	07.2023	€		9.704	10.499	0	0,00	
	07.2023	SEK		3.780	351	1	0,00	
	07.2023	\$	€	16.916	15.739	262	0,01	
	07.2023		£	37.839	30.364	764	0,03	
	07.2023	£	\$	548.131	681.252	0	0,62	
MYI	07.2023	NZD		1.178	713	0	0,00	
	07.2023	SEK		291.863	27.189	168	0,01	
	07.2023	\$	DKK	29.630	202.115	0	0,00	
	07.2023		€	1.412	1.296	2	0,00	
	07.2023		£	11.728	9.373	189	0,01	
	07.2023		SEK	27.554	297.493	0	0,00	
	08.2023	DKK	\$	201.778	29.630	16	0,00	
	08.2023	SEK		297.124	27.554	12	0,00	
	07.2023	AUD		10.261	6.705	0	0,01	
	07.2023	NZD		46.208	28.055	0	0,01	
SCX	07.2023	SEK		1.389	128	0	0,00	
	07.2023	\$	AUD	5.046	7.601	14	0,00	
	08.2023	AUD	\$	7.601	5.050	0	0,00	
	07.2023			6.212	4.064	0	0,00	
SOG	07.2023	€		652.877	702.325	0	0,40	
	07.2023	AUD		3.287	2.150	0	0,00	
	07.2023	\$	AUD	6.178	9.354	48	0,00	
	07.2023		CAD	39.201	51.871	27	0,00	
TOR	07.2023		¥	60.348	8.690.127	0	0,01	
	08.2023	AUD	\$	9.354	6.183	0	0,00	
	08.2023	CAD		51.850	39.201	28	0,00	
	08.2023	¥		8.653.272	60.348	225	0,01	
	07.2023	AUD		752	493	0	0,00	
	07.2023	\$	AUD	9.954	14.908	21	0,00	
UAG	07.2023		\$	14.908	9.962	52	0,00	
	08.2023	AUD	\$	14.908	9.962	52	0,00	
					\$ 10.463	\$ (34.856)	\$ (24.393)	(0,97)



## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend und Investor CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 8	CHF 7	\$ 0		\$ 0	0,00
BPS	07.2023	CHF 29.237	\$ 32.691	11	0	11	0,00
	07.2023	\$ 44.078	CHF 39.879	497	0	497	0,02
	08.2023	32.691	29.154	0	(11)	(11)	0,00
IND	07.2023	CHF 15.453	\$ 17.203	0	(69)	(69)	0,00
	08.2023	\$ 17.203	CHF 15.409	69	0	69	0,00
JPM	07.2023	657	594	7	0	7	0,00
MBC	07.2023	CHF 19	\$ 21	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 118	CHF 106	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CHF 1.713	\$ 1.892	0	(22)	(22)	0,00
RBC	07.2023	\$ 8	CHF 7	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	4	3	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	31.135	27.976	136	0	136	0,01
UAG	07.2023	CHF 30.223	\$ 33.716	0	(67)	(67)	0,00
	07.2023	\$ 27.989	CHF 25.149	122	0	122	0,00
	08.2023	33.716	30.137	66	0	66	0,00
				\$ 908	\$ (169)	\$ 739	0,03

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklasse Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 116	\$ 77	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 34	AUD 53	1	0	1	0,00
	08.2023	77	116	0	0	0	0,00
BOA	07.2023	DKK 212	\$ 31	0	0	0	0,00
	07.2023	¥ 70	1	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK 3.055	283	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 43	AUD 66	1	0	1	0,00
	07.2023	828	CAD 1.127	23	0	23	0,00
	07.2023	17	DKK 117	0	0	0	0,00
	07.2023	68	NZD 111	1	0	1	0,00
	07.2023	2	SEK 21	0	0	0	0,00
	08.2023	31	DKK 212	0	0	0	0,00
	08.2023	283	SEK 3.051	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	AUD 83	\$ 55	0	0	0	0,00
	07.2023	€ 8.688	9.519	41	0	41	0,00
	07.2023	\$ 0	DKK 0	0	0	0	0,00
	07.2023	1.266	¥ 175.905	0	(48)	(48)	(0,01)
	07.2023	2	NZD 3	0	0	0	0,00
	08.2023	55	AUD 83	0	0	0	0,00
	08.2023	9.532	€ 8.688	0	(41)	(41)	0,00
CBK	07.2023	144	134	2	0	2	0,00
IND	07.2023	50	DKK 343	1	0	1	0,00
JPM	07.2023	¥ 59.880	\$ 419	4	0	4	0,00
	08.2023	\$ 419	¥ 59.626	0	(4)	(4)	0,00
MBC	07.2023	CAD 68	\$ 50	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	£ 514	640	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	\$ 10.211	£ 8.249	276	0	276	0,02
	07.2023	4	SEK 39	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	DKK 189	\$ 28	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 4	NZD 7	0	0	0	0,00
	07.2023	279	SEK 2.992	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	28	DKK 189	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD 170	\$ 113	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 176	NZD 290	2	0	2	0,00
	08.2023	113	AUD 170	0	0	0	0,00
SOG	07.2023	227	347	4	0	4	0,00
	07.2023	9.202	€ 8.554	131	0	131	0,01
TOR	07.2023	AUD 209	\$ 138	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CAD 750	565	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	£ 7.736	9.830	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	NZD 412	251	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 120	AUD 184	2	0	2	0,00
	08.2023	138	209	1	0	1	0,00
	08.2023	565	CAD 750	2	0	2	0,00
	08.2023	9.832	£ 7.736	5	0	5	0,00
	08.2023	251	NZD 412	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	AUD 114	\$ 75	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 28	AUD 42	0	0	0	0,00
	08.2023	75	114	0	0	0	0,00
				\$ 498	\$ (119)	\$ 379	0,02

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Global Real Return Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 5.432	\$ 5.924	\$ 8	\$ (10)	\$ (2)	0,00
	07.2023	\$ 401.643	€ 373.724	6.089	0	6.089	0,23
BPS	07.2023	€ 375.124	\$ 411.005	1.748	(3)	1.745	0,07
	07.2023	\$ 401.431	€ 373.420	5.971	(1)	5.970	0,24
CBK	08.2023	407.371	371.269	0	(1.762)	(1.762)	(0,07)
	07.2023	€ 393.961	\$ 427.971	7	(1.846)	(1.839)	(0,07)
JPM	08.2023	\$ 395.113	€ 362.910	1.365	0	1.365	0,05
	07.2023	€ 370.713	\$ 404.781	334	0	334	0,01
MBC	07.2023	\$ 32.087	€ 30.011	655	0	655	0,02
	08.2023	405.347	370.713	0	(346)	(346)	(0,01)
SOG	07.2023	€ 7.537	\$ 8.124	5	(104)	(99)	0,00
	07.2023	\$ 207	€ 194	4	0	4	0,00
	07.2023	401.628	373.351	5.698	0	5.698	0,23
				\$ 21.884	\$ (4.072)	\$ 17.812	0,70

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend and R Class GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 705	\$ 887	\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	0,00
BPS	07.2023	£ 571	\$ 706	0	(20)	(20)	0,00
	07.2023	\$ 110.483	£ 89.321	3.076	(1)	3.075	0,12
BRC	07.2023	£ 503	\$ 630	0	(10)	(10)	0,00
CBK	07.2023	1.149	1.451	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	\$ 2.360	£ 1.849	1	(10)	(9)	0,00
JPM	07.2023	£ 89.037	\$ 112.579	0	(619)	(619)	(0,02)
	08.2023	\$ 112.603	£ 89.037	618	0	618	0,02
MBC	07.2023	111.239	89.852	2.995	(1)	2.994	0,11
MYI	07.2023	£ 81	\$ 100	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	\$ 110.059	£ 88.553	2.523	0	2.523	0,10
TOR	07.2023	£ 89.242	\$ 113.400	0	(58)	(58)	0,00
	08.2023	\$ 113.425	£ 89.242	56	0	56	0,00
				\$ 9.269	\$ (741)	\$ 8.528	0,33

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$ 58.438	SGD 79.073	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	0,00
GLM	07.2023	SGD 6.452	\$ 4.807	40	0	40	0,00
	07.2023	\$ 1.185	SGD 1.597	0	(6)	(6)	0,00
JPM	07.2023	SGD 77.974	\$ 57.622	6	0	6	0,00
	07.2023	\$ 9.900	SGD 13.399	1	0	1	0,00
MBC	08.2023	57.622	77.899	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	53.127	71.780	0	(88)	(88)	0,00
MYI	07.2023	SGD 75.541	\$ 55.906	89	0	89	0,00
	08.2023	\$ 55.906	SGD 75.472	0	(84)	(84)	0,00
UAG	07.2023	57.315	77.535	0	(24)	(24)	0,00
				\$ 136	\$ (217)	\$ (81)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (2.146) (0,09)

Summe Anlagen

\$ 3.419.634 136,20

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (908.965) (36,20)

Nettovermögen

\$ 2.510.669 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(c) Mit dem Fonds verbunden.

(d) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 791.485 USD (31. Dezember 2022: 734.559 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 9.544 USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen als Sicherheit für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 101 USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 30.047 USD (31. Dezember 2022: 24.192 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 17.910 USD (31. Dezember 2022: 21.490 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.401.573	\$ 4	\$ 3.401.577
Investmentfonds	10.161	0	0	10.161
Pensionsgeschäfte	0	2.272	0	2.272
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	3.780	1.844	0	5.624
<b>Summen</b>	<b>\$ 13.941</b>	<b>\$ 3.405.689</b>	<b>\$ 4</b>	<b>\$ 3.419.634</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.391.396	\$ 0	\$ 3.391.396
Investmentfonds	7.043	0	0	7.043
Pensionsgeschäfte	0	2.245	0	2.245
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(4.808)	18.214	0	13.406
<b>Summen</b>	<b>\$ 2.235</b>	<b>\$ 3.411.855</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 3.414.090</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,180 %	14.06.2023	05.07.2023	\$ (10.841)	\$ (10.867)	(0,43)
BSN	5,180	04.05.2023	06.07.2023	(544.125)	(548.666)	(21,85)
CIB	5,170	15.06.2023	27.07.2023	(19.174)	(19.218)	(0,77)
GRE	5,170	20.06.2023	06.07.2023	(34.190)	(34.244)	(1,37)
NOM	5,200	17.05.2023	17.07.2023	(177.163)	(178.315)	(7,10)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (791.310)</b>	<b>(31,52)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Derivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (10)	\$ 0	\$ (10)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	3.934	(2.880)	1.054	3.056	(2.990)	66
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	110	0	110
BPS	13.047	(11.300)	1.747	(381)	580	199
BRC	(25)	0	(25)	(156)	130	(26)
CBK	(699)	630	(69)	11.029	(10.872)	157
DUB	(3.901)	3.710	(191)	(3.859)	3.720	(139)
FAR	(591)	810	219	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(405)	270	(135)	(1.194)	610	(584)
GST	(2)	0	(2)	(2.425)	2.410	(15)
IND	(834)	850	16	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	518	(530)	(12)	(2.608)	2.180	(428)
MBC	4.005	(2.910)	1.095	8.954	(8.240)	714
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(36)	90	54
MYI	(12.764)	8.350	(4.414)	(3.890)	2.910	(980)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	44	0	44
SAL	(28)	130	102	(20)	130	110
SCX	(241)	60	(181)	(7.751)	7.310	(441)
SOG	(4.201)	3.100	(1.101)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(38)	0	(38)	(270)	1.420	1.150
UAG	89	0	89	18	0	18

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	118,68	115,82
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	16,79	15,81
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,02	0,25
Investmentfonds	0,40	0,27
Pensionsgeschäfte	0,09	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,31	(0,09)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	0,58
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,09)	0,02
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(31,52)	(30,96)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,37)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,08	1,83
Belgien	0,07	0,07
Kanada	1,50	1,46
Cayman-Inseln	1,39	1,58
Dänemark	2,89	4,20
Frankreich	8,98	7,82
Deutschland	0,94	0,86
Irland	8,68	8,54
Italien	9,09	7,79
Japan	4,12	4,27
Luxemburg	k. A.	0,02
Niederlande	0,69	0,71
Neuseeland	1,68	1,63
Peru	0,01	0,07
Slowenien	0,04	0,04
Spanien	1,84	1,71
Schweden	1,14	1,15
Schweiz	0,16	k. A.
Großbritannien	25,38	25,93
USA	65,55	62,20
Kurzfristige Instrumente	0,26	k. A.
Investmentfonds	0,40	0,27
Pensionsgeschäfte	0,09	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,33	(0,09)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,02)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen –		
Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,00	0,58
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,24	0,46
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,02)	(0,02)
Zinsswapoptionen	(0,42)	(0,88)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,97)	(0,96)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,08	1,42
Sonstige Aktiva und Passiva	(36,20)	(32,75)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS				
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>															
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>															
American Airlines, Inc. 10,000 % fällig am 20.04.2028	\$ 65.500	\$ 66.986	0,10	Surgery Center Holdings, Inc. 8,896 % fällig am 31.08.2026	8.962	8.961	0,01	7,437 % fällig am 02.11.2033	35.850	38.805	0,06				
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 6,896 % fällig am 15.01.2025	21.326	21.338	0,03	Syniverse Holdings, Inc. 12,242 % fällig am 13.05.2027	30.101	27.684	0,04	7,750 % fällig am 15.09.2023 (j)(k)	48.538	47.684	0,07				
7,396 % fällig am 01.12.2027	4.113	4.113	0,01	Team Health Holdings, Inc. 7,943 % fällig am 06.02.2024	22.185	19.730	0,03	Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 15.000	\$ 12.766	0,02				
Carnival Corp. 7,168 % fällig am 30.06.2025	€ 61.232	66.623	0,10	TransDigm, Inc. 8,492 % fällig am 22.02.2027	\$ 36.758	\$ 36.813	0,06	BNP Paribas Issuance BV 0,000 % fällig am 09.04.2029	\$ 10	1.638.261	2,54				
8,217 % fällig am 30.06.2025	\$ 128.780	128.720	0,20	8,492 % fällig am 24.08.2028	83.591	83.639	0,13	CaixaBank S.A. 6,208 % fällig am 18.01.2029	64.050	63.955	0,10				
8,467 % fällig am 18.10.2028	20.382	20.238	0,03	U.S. Renal Care, Inc. 10,192 % fällig am 26.06.2026	23.013	10.797	0,02	CIFI Holdings Group Co. Ltd. 4,375 % fällig am 12.04.2027 ^	2.000	232	0,00				
Cengage Learning, Inc. 9,880 % fällig am 14.07.2026	28.816	28.299	0,04	10,693 % fällig am 26.06.2026	6.541	3.069	0,00	4,450 % fällig am 17.08.2026 ^	1.700	193	0,00				
Charter Communications Operating LLC 6,795 % - 6,834 % fällig am 01.02.2027	36.956	36.778	0,06	United Airlines, Inc. 9,292 % fällig am 21.04.2028	19.902	19.924	0,03	4,800 % fällig am 17.05.2028 ^	700	81	0,00				
Delos Finance SARL 7,288 % fällig am 06.10.2023	8.226	8.232	0,01	Veritas U.S., Inc. 10,217 % fällig am 01.09.2025	1.986	1.629	0,00	5,250 % fällig am 13.05.2026 ^	1.100	128	0,00				
Diamond Sports Group LLC 13,064 % fällig am 25.05.2026	4.030	3.119	0,00	Wesco Aircraft Holdings, Inc. TBD % - 13,725 % fällig am 01.03.2024 y	7.020	7.020	0,01	5,950 % fällig am 20.10.2025 ^	1.300	151	0,00				
Directv Financing LLC 10,217 % fällig am 02.08.2027	37.426	36.672	0,06	Westmoreland Coal Co. (15,000 % PIK) TBD % fällig am 15.03.2029 (d)	4.405	3.249	0,01	6,000 % fällig am 16.07.2025 ^	2.000	227	0,00				
Emerald TopCo, Inc. 8,584 % fällig am 24.07.2026	3.576	3.484	0,01	Windstream Services LLC 11,452 % fällig am 21.09.2027	27.250	25.513	0,04	6,450 % fällig am 07.11.2024 ^	3.300	388	0,00				
Envision Healthcare Corp. 16,070 % fällig am 29.04.2027	48.738	58.121	0,09	Wm Morrison Supermarkets Ltd. 8,073 % fällig am 04.11.2027	€ 112.376	105.508	0,16	Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % fällig am 31.07.2023 ^	€ 30.000	4.623	0,01				
16,695 % fällig am 28.04.2028 ^	126.964	93.585	0,15	Zayo Group Holdings, Inc. 8,217 % fällig am 09.03.2027	\$ 1.317	1.038	0,00	Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,700 % fällig am 12.07.2026	\$ 8.400	2.572	0,00				
iHeartCommunications, Inc. 8,217 % fällig am 01.05.2026	256.669	222.965	0,35			1.637.429	2,54	3,125 % fällig am 22.10.2025	13.400	4.223	0,01				
8,469 % fällig am 01.05.2026	23.246	20.248	0,03	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
Instant Brands Holdings, Inc. TBD % fällig am 12.04.2028 ^	250	55	0,00	<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
15,217 % fällig am 12.12.2023	104	96	0,00	Adler Financing SARL 12,500 % fällig am 30.06.2025	€ 903	1.011	0,00	CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	€ 2.200	1.309	0,00				
Intelsat Jackson Holdings S.A. 9,443 % fällig am 01.02.2029	83.574	83.342	0,13	AGFC Capital Trust 7,010 % fällig am 15.01.2067	\$ 23.000	12.400	0,02	2,750 % fällig am 12.05.2026	2.600	2.309	0,00				
IQVIA, Inc. 5,598 % fällig am 07.03.2024	€ 5.000	5.456	0,01	AGPS BondCo PLC 5,000 % fällig am 27.04.2027 ^	€ 1.100	426	0,00	2,750 % fällig am 22.01.2028	£ 1.700	1.448	0,00				
Lealand Finance Co. BV 8,193 % fällig am 28.06.2024	\$ 2.771	2.217	0,00	5,500 % fällig am 13.11.2026 ^	200	84	0,00	Credit Suisse AG 0,495 % fällig am 02.02.2024	\$ 17.400	16.742	0,03				
Lealand Finance Co. BV (2,666 % bar oder 3,000 % PIK) 3,000 % - 1,193 % fällig am 30.06.2025 (d)	6.605	3.853	0,01	Ambac Assurance Corp. 5,100 % (j)	\$ 0	0	0,00	5,500 % fällig am 20.08.2026	€ 179.400	198.934	0,31				
Poseidon BidCo S.A.S 8,848 % fällig am 14.07.2028	€ 103.800	110.981	0,17	American Assets Trust LP 3,375 % fällig am 01.02.2031	5.500	4.308	0,01	6,500 % fällig am 08.04.2024	\$ 59.125	58.909	0,09				
PUG LLC 8,525 % fällig am 12.02.2027	\$ 13.119	11.736	0,02	Armor Holdco, Inc. 8,500 % fällig am 15.11.2029	800	665	0,00	0,808.2023 (k)	\$ 59.125	58.909	0,09				
9,443 % fällig am 12.02.2027	980	889	0,00	Army Hawaii Family Housing Trust Certificates 5,593 % fällig am 15.06.2050	102.600	71.245	0,11	Credit Suisse AG AT1 Claim ^	138.872	5.555	0,01				
Redstone Holdco 2 LP 10,005 % fällig am 27.04.2028	7.192	6.020	0,01	Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	33.840	25.075	0,04	Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	€ 39.900	32.298	0,05				
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % fällig am 16.11.2025	5.539	5.143	0,01	Asian Development Bank 4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN 99.000	5.459	0,01	1,750 % fällig am 19.11.2030	5.000	4.317	0,01				
SCUR-Alpha 1503 GmbH 9,087 % fällig am 29.03.2030	€ 62.100	64.775	0,10	Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	\$ 165.597	139.794	0,22	2,129 % fällig am 24.11.2026 (m)	\$ 24.300	21.631	0,03				
10,602 % fällig am 28.03.2030	\$ 113.416	107.603	0,17	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,875 % fällig am 09.01.2026	€ 33.400	32.452	0,05	3,035 % fällig am 28.05.2032 (m)(n)	45.920	36.192	0,06				
Serta Simmons Bedding LLC 8,098 % - 8,117 % fällig am 08.11.2023	1.410	60	0,00	2,625 % fällig am 28.04.2025	5.400	5.531	0,01	3,547 % fällig am 18.09.2031	20.300	16.871	0,03				
Sierra Hamilton LLC 15,000 % fällig am 12.09.2023	1	1	0,00	3,625 % fällig am 24.09.2024	4.800	5.089	0,01	6,720 % fällig am 18.01.2029	34.800	34.877	0,05				
Sigma Bidco BV 6,239 % fällig am 02.07.2025	€ 8.990	9.621	0,02	6,750 % fällig am 02.03.2026	129.460	141.565	0,22	EPR Properties 4,750 % fällig am 15.12.2026	7.623	6.944	0,01				
Sotera Health Holdings LLC 8,023 % fällig am 11.12.2026	\$ 17.409	17.188	0,03	7,677 % fällig am 18.01.2028	5.000	4.597	0,01	4,950 % fällig am 15.04.2028	2.170	1.941	0,00				
SS&C European Holdings SARL 6,967 % fällig am 16.04.2025	8.421	8.425	0,01	8,000 % fällig am 22.01.2030	26.444	25.942	0,04	Erste Group Bank AG 4,250 % fällig am 15.10.2027 (j)(k)	€ 29.000	24.131	0,04				
SS&C Technologies, Inc. 6,967 % fällig am 16.04.2025	14.950	14.956	0,02	8,500 % fällig am 10.09.2030	12.200	12.047	0,02	Essential Properties LP 2,950 % fällig am 15.07.2031	\$ 4.000	3.002	0,01				
Sunshine Luxembourg SARL 9,092 % fällig am 01.10.2026	10.958	10.917	0,02	Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 95.500	25.261	0,04	Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,950 % fällig am 03.03.2031	CAD 3.940	2.588	0,00				
				Banco Espirito Santo S.A. 2,625 % fällig am 08.05.2017 ^	€ 16.200	4.330	0,01	Ford Motor Credit Co. LLC 2,748 % fällig am 14.06.2024	£ 17.601	21.417	0,03				
				4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	8.100	2.165	0,00	Gateway Casinos & Entertainment Ltd. 5,000 % fällig am 12.03.2038	CAD 47.146	32.302	0,05				
				Bank of Nova Scotia 4,900 % fällig am 04.06.2025 (j)(k)	\$ 3.346	3.167	0,01	GLP Capital LP 3,250 % fällig am 15.01.2032	\$ 4.100	3.315	0,01				
				Barclays PLC 4,972 % fällig am 16.05.2029	79.515	75.216	0,12	4,000 % fällig am 15.01.2031	15.815	13.687	0,02				
								5,250 % fällig am 01.06.2025	3.502	3.433	0,01				
								5,300 % fällig am 15.01.2029	16.214	15.453	0,02				
								Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % fällig am 15.03.2028	11.640	10.564	0,02				
								HSBC Holdings PLC 2,357 % fällig am 18.08.2031	46.700	37.304	0,06				

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
2,804 % fällig am 24.05.2032	\$ 25.700	\$ 20.799	0,03	5,952 % fällig am 22.03.2038	13.055	10.968	0,02	10,500 % fällig am 15.02.2028	72.952	72.439	0,11
2,848 % fällig am 04.06.2031	3.600	2.989	0,00	5,982 % fällig am 22.12.2035	2.180	1.799	0,00	VICI Properties LP			
3,973 % fällig am 22.05.2030	46.600	41.889	0,07	6,002 % fällig am 22.03.2038	9.208	7.872	0,01	3,500 % fällig am 15.02.2025	42.516	40.662	0,06
4,583 % fällig am 19.06.2029	15.300	14.413	0,02	6,032 % fällig am 23.09.2035	6.666	5.833	0,01	3,750 % fällig am 15.02.2027	39.100	35.903	0,06
5,402 % fällig am 11.08.2033	7.000	6.848	0,01	6,132 % fällig am 23.03.2035	10.000	8.650	0,01	3,875 % fällig am 15.02.2029	13.080	11.490	0,02
6,254 % fällig am 09.03.2034	126.700	129.945	0,20	6,381 % fällig am 03.07.2033	499	462	0,00	4,125 % fällig am 15.08.2030	10.116	8.916	0,01
Huarong Finance Co. Ltd.				6,452 % fällig am 22.03.2038	739	699	0,00	4,250 % fällig am 01.12.2026	31.400	29.402	0,05
4,500 % fällig am 29.05.2029	4.216	3.383	0,01	Realkredit Danmark A/S				4,500 % fällig am 01.09.2026	11.028	10.428	0,02
Hudson Pacific Properties LP				2,500 % fällig am 01.04.2047	DKK 0	0	0,00	4,500 % fällig am 15.01.2028	900	828	0,00
3,950 % fällig am 01.11.2027	2.700	1.966	0,00	Santander UK Group Holdings PLC				4,625 % fällig am 15.06.2025	5.648	5.462	0,01
5,950 % fällig am 15.02.2028	1.600	1.273	0,00	2,469 % fällig am 11.01.2028	\$ 5.600	4.894	0,01	4,625 % fällig am 01.12.2029	32.600	29.626	0,05
InCaps Funding Ltd.				3,823 % fällig am 03.11.2028	17.900	16.128	0,03	5,625 % fällig am 01.05.2024	9.505	9.455	0,02
7,496 % fällig am 01.06.2033	2.203	2.027	0,00	6,534 % fällig am 10.01.2029	47.000	47.371	0,07	5,750 % fällig am 01.02.2027	25.355	24.841	0,04
International Finance Corp.				6,750 % fällig am				Voyager Aviation Holdings LLC			
8,000 % fällig am 09.10.2023	IDR129.400.000	8.668	0,01	24.06.2024 (i)(k)	£ 65.803	78.472	0,12	8,500 % fällig am 09.05.2026	4.668	3.688	0,01
Intesa Sanpaolo SpA				SBA Tower Trust				Yango Group Co. Ltd.			
8,248 % fällig am 21.11.2033	\$ 3.900	4.099	0,01	2,836 % fällig am 15.01.2050	\$ 5.885	5.590	0,01	6,900 % fällig am 31.10.2022 ^ CNY	50.000	366	0,00
KBC Group NV				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.							
5,796 % fällig am 19.01.2029	7.150	7.108	0,01	5,125 % fällig am 29.10.2022 ^	6.100	366	0,00				
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.				Seazen Group Ltd.				<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
3,250 % fällig am 12.11.2027	€ 9.400	9.100	0,01	4,450 % fällig am 13.07.2025	1.900	988	0,00	Air Canada Pass-Through Trust			
Lloyds Banking Group PLC				6,000 % fällig am 12.08.2024	5.000	3.573	0,01	5,250 % fällig am 01.10.2030	\$ 27.653	26.843	0,04
7,875 % fällig am				SLM Corp.				Alaska Airlines Pass-Through Trust			
27.06.2029 (i)(k)	£ 28.220	31.827	0,05	4,200 % fällig am 29.10.2025	2.686	2.498	0,00	4,800 % fällig am 15.02.2029	15.979	15.371	0,02
Morgan Stanley				SLM Student Loan Trust				Altice Financing S.A.			
0,000 % fällig am				4,076 % fällig am 15.12.2033	€ 11.621	11.700	0,02	5,750 % fällig am 15.08.2029	71.503	55.465	0,09
02.04.2032 (m)	\$ 68.500	42.809	0,07	Societe Generale S.A.				Altice France S.A.			
National Health Investors, Inc.				2,889 % fällig am 09.06.2032	\$ 14.300	11.216	0,02	8,125 % fällig am 01.02.2027	24.392	21.149	0,03
3,000 % fällig am 01.02.2031	9.900	7.609	0,01	6,446 % fällig am 10.01.2029	51.300	51.429	0,08	Amdocs Ltd.			
Nationwide Building Society				6,447 % fällig am 12.01.2027	42.900	42.824	0,07	2,538 % fällig am 15.06.2030	3.500	2.925	0,01
3,960 % fällig am 18.07.2030	163.883	145.589	0,23	6,691 % fällig am 10.01.2034	137.100	139.676	0,22	American Airlines Pass-Through Trust			
4,302 % fällig am 08.03.2029	34.100	31.625	0,05	Standard Chartered PLC				2,875 % fällig am 11.01.2036	17.916	15.014	0,02
NatWest Group PLC				2,678 % fällig am 29.06.2032	3.500	2.745	0,00	3,000 % fällig am 15.04.2030	1.694	1.504	0,00
4,445 % fällig am 08.05.2030	121.125	111.446	0,17	Stichting AK Rabobank Certificaten				3,150 % fällig am 15.08.2033	754	658	0,00
4,892 % fällig am 18.05.2029	62.833	59.837	0,09	5,000 % (i)	€ 206.326	209.289	0,32	3,350 % fällig am 15.04.2031	10.219	9.097	0,01
5,076 % fällig am 27.01.2030	134.670	128.589	0,20	Sunac China Holdings Ltd.				3,375 % fällig am 01.11.2028	23.990	21.540	0,03
6,016 % fällig am 02.03.2034	62.800	63.177	0,10	6,500 % fällig am 10.01.2025 ^	\$ 1.700	257	0,00	3,575 % fällig am 15.07.2029	3.734	3.465	0,01
Navient Corp.				6,500 % fällig am 26.01.2026 ^	600	91	0,00	3,700 % fällig am 01.04.2028	30.769	27.707	0,04
5,625 % fällig am 25.01.2025	3.549	3.233	0,01	6,650 % fällig am 03.08.2024 ^	700	103	0,00	4,000 % fällig am 15.08.2030	5.254	4.559	0,01
New Metro Global Ltd.				7,500 % fällig am 01.02.2024 ^	800	120	0,00	Amgen, Inc.			
4,500 % fällig am 02.05.2026	4.600	1.944	0,00	8,350 % fällig am 19.04.2023 ^	5.300	784	0,00	5,600 % fällig am 02.03.2043	12.200	12.245	0,02
4,625 % fällig am 15.10.2025	800	404	0,00	SVB Financial Group				5,750 % fällig am 02.03.2063	4.300	4.365	0,01
4,800 % fällig am 15.12.2024	7.900	5.409	0,01	3,125 % fällig am 05.06.2030 ^	300	198	0,00	Baptist Healthcare System Obligated Group			
6,800 % fällig am 05.08.2023	3.100	3.023	0,00	U.S. Capital Funding Ltd.				3,540 % fällig am 15.08.2050	13.100	9.712	0,02
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				5,491 % fällig am 10.07.2043	5.056	3.824	0,01	Boeing Co.			
2,750 % fällig am 09.03.2028	21.400	17.604	0,03	6,049 % fällig am 01.08.2034	400	394	0,00	5,705 % fällig am 01.05.2040	40.715	40.644	0,06
Nomura Holdings, Inc.				UBS AG				5,805 % fällig am 01.05.2050	151.967	151.541	0,24
2,172 % fällig am 14.07.2028	14.968	12.641	0,02	5,125 % fällig am 15.05.2024	49.785	49.025	0,08	5,930 % fällig am 01.05.2060	114.118	113.112	0,18
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				(k)				6,125 % fällig am 15.02.2033	14.822	15.463	0,02
2,000 % fällig am 01.10.2047	DKK 0	0	0,00	UBS Group AG				British Airways Pass-Through Trust			
Nykredit Realkredit A/S				2,746 % fällig am 11.02.2033	3.116	2.429	0,00	2,900 % fällig am 15.09.2036	7.256	5.998	0,01
2,000 % fällig am 01.07.2037	DKK 0	\$ 0	0,00	2,875 % fällig am 02.04.2032	€ 1.500	1.428	0,00	3,300 % fällig am 15.06.2034	3.327	2.892	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	3,091 % fällig am 14.05.2032	\$ 57.350	46.416	0,07	3,800 % fällig am 20.03.2033	2.449	2.233	0,00
OneMain Finance Corp.				3,750 % fällig am 26.03.2025	20.900	20.014	0,03	4,250 % fällig am 15.05.2034	6.536	5.974	0,01
6,125 % fällig am 15.03.2024	\$ 14.595	14.558	0,02	3,869 % fällig am 12.01.2029	5.750	5.203	0,01	Broadcom, Inc.			
Park Aerospace Holdings Ltd.				4,194 % fällig am 01.04.2031	35.450	31.571	0,05	2,450 % fällig am 15.02.2031	44.100	35.885	0,06
5,500 % fällig am 15.02.2024	13.831	13.677	0,02	5,959 % fällig am 12.01.2034	93.281	92.849	0,14	2,600 % fällig am 15.02.2033	13.200	10.325	0,02
Preferred Term Securities Ltd.				6,373 % fällig am 15.07.2026	32.250	32.054	0,05	3,137 % fällig am 15.11.2035	3.818	2.930	0,00
5,752 % fällig am 22.12.2036	373	338	0,00	6,442 % fällig am 11.08.2028	115.850	116.375	0,18	3,187 % fällig am 15.11.2036	69.706	52.720	0,08
5,842 % fällig am 22.06.2037	14.382	12.440	0,02	6,537 % fällig am 12.08.2033	102.073	104.626	0,16	3,419 % fällig am 15.04.2033	18.100	15.145	0,02
5,852 % fällig am 22.03.2037	16.877	14.852	0,02	7,375 % fällig am 07.09.2033	€ 24.000	31.982	0,05	3,469 % fällig am 15.04.2034	78.431	64.366	0,10
5,852 % fällig am 22.09.2037	16.562	13.506	0,02	7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 124.330	\$ 150.435	0,23	3,500 % fällig am 15.02.2041	7.475	5.597	0,01
5,862 % fällig am 22.12.2036	20.162	18.750	0,03	9,016 % fällig am 15.11.2033	\$ 38.550	46.236	0,07	4,300 % fällig am 15.11.2032	8.400	7.708	0,01
5,892 % fällig am 22.09.2036	1.323	1.200	0,00	UniCredit SpA				California Institute of Technology			
5,902 % fällig am 22.12.2035	9.433	8.584	0,01	7,830 % fällig am 04.12.2023	324.870	326.823	0,51	4,283 % fällig am 01.09.2116	9.100	6.916	0,01
5,902 % fällig am 22.03.2038	9.188	8.361	0,01	Unique Pub Finance Co. PLC				Carvana Co.			
5,922 % fällig am 22.09.2037	11.820	8.983	0,01	7,395 % fällig am 28.03.2024	€ 2.282	2.909	0,00	4,875 % fällig am 01.09.2029	4.012	2.280	0,00
5,932 % fällig am 23.09.2035	711	702	0,00	Uniti Group LP				5,500 % fällig am 15.04.2027	40.694	27.277	0,04
5,932 % fällig am 22.03.2037	13.164	9.609	0,02	4,750 % fällig am 15.04.2028	\$ 11.366	9.443	0,01				









BESCHREIBUNG	PAR (0000)	MARKT- WERT (0000)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (0000)	MARKT- WERT (0000)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (0000)	MARKT- WERT (0000)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
2,000 % fällig am 15.08.2025	\$ 110.000	\$ 103	0,16	Atlas Funding PLC				3,896 % fällig am 25.02.2036	\$	\$ 245	0,00
2,000 % fällig am 15.11.2026	9.100	8.419	0,01	5,432 % fällig am 25.07.2058	£ 21.016	\$ 26.703	0,04	3,942 % fällig am 25.09.2035		299	0,00
2,125 % fällig am 15.05.2025	132.200	125.577	0,19	5,937 % fällig am 20.01.2061	24.753	31.501	0,05	3,993 % fällig am 20.11.2046		639	0,00
2,250 % fällig am 15.11.2025	57.430	54.271	0,08	Atrium Hotel Portfolio Trust				4,020 % fällig am 25.08.2035	1.328	1.268	0,00
2,250 % fällig am 15.02.2027	262.600	244.249	0,38	6,373 % fällig am 15.12.2036	\$ 3.300	3.187	0,01	4,153 % fällig am 25.07.2035		638	0,00
2,375 % fällig am 31.03.2029 (n)	139.700	127.569	0,20	6,943 % fällig am 15.12.2036	4.000	3.775	0,01	4,370 % fällig am 25.07.2035		1.000	0,00
2,375 % fällig am 15.05.2029	255.400	232.918	0,36	7,743 % fällig am 15.06.2035	47.513	45.225	0,07	6,000 % fällig am 25.03.2037		595	0,00
2,625 % fällig am 31.01.2026	631.400	601.014	0,93	Avon Finance PLC				6,000 % fällig am 25.05.2037		208	0,00
2,750 % fällig am 15.08.2032	832.400	763.256	1,18	5,809 % fällig am 20.09.2048	£ 52.113	66.237	0,10	6,000 % fällig am 25.07.2046		18	0,00
2,875 % fällig am 15.08.2028	500	471	0,00	Banc of America Alternative Loan Trust				Barclays Commercial Mortgage Securities Trust			
2,875 % fällig am 15.05.2032	171.690	159.219	0,25	5,500 % fällig am 25.12.2035	\$ 158	134	0,00	3,965 % fällig am 10.08.2033		7.400	6,853
4,000 % fällig am 31.10.2029	592.900	591.487	0,92	5,550 % fällig am 25.01.2037	1.814	1.406	0,00	7,084 % fällig am 15.07.2037		10.000	9,705
		13.161.880	20,40	5,913 % fällig am 25.10.2036	10.004	2.930	0,01	7,584 % fällig am 15.07.2037		28.583	27,246
				6,000 % fällig am 25.11.2035	210	177	0,00	BCAP LLC Trust			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				6,000 % fällig am 25.04.2037	366	296	0,00	0,000 % fällig am 26.08.2036	1.237	479	0,00
1211 Avenue of the Americas Trust				6,000 % fällig am 25.06.2037	500	415	0,00	3,194 % fällig am 26.01.2037		4.198	3,579
3,901 % fällig am 10.08.2035	1.500	1.398	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2046	661	582	0,00	3,598 % fällig am 26.07.2037		3.516	3,105
4,230 % fällig am 10.08.2035	9.600	8.732	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2046	1.514	1.110	0,00	3,762 % fällig am 26.02.2036		791	788
4,280 % fällig am 10.08.2035	7.400	6.466	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2046	1.409	1.186	0,00	3,784 % fällig am 26.03.2037		0	0,00
20 Times Square Trust				6,500 % fällig am 25.03.2036	1.973	1.741	0,00	4,081 % fällig am 26.07.2037		575	516
3,203 % fällig am 15.05.2035	54.000	43.192	0,07	Banc of America Funding Corp.				4,203 % fällig am 26.04.2047		2.775	2,503
280 Park Avenue Mortgage Trust				4,401 % fällig am 25.09.2048	1.657	1.540	0,00	4,590 % fällig am 26.03.2037		191	184
6,062 % fällig am 15.09.2034	700	679	0,00	Banc of America Funding Trust				5,250 % fällig am 26.05.2037		2.763	1,427
6,432 % fällig am 15.09.2034	2.000	1.803	0,00	3,616 % fällig am 20.09.2035	2.471	1.944	0,00	5,430 % fällig am 25.04.2037		1.547	1,402
Adjustable Rate Mortgage Trust				3,689 % fällig am 20.04.2037	7.143	6.349	0,01	5,490 % fällig am 25.01.2037		2.635	2,426
3,048 % fällig am 25.08.2035	311	227	0,00	3,758 % fällig am 26.10.2036	9.922	9.023	0,02	5,500 % fällig am 26.02.2036		908	655
3,280 % fällig am 25.09.2035	2.432	1.948	0,00	3,771 % fällig am 20.07.2047	849	813	0,00	5,510 % fällig am 25.03.2037		6.039	5,408
4,189 % fällig am 25.05.2036	119	104	0,00	3,818 % fällig am 25.05.2036	218	191	0,00	5,530 % fällig am 25.10.2036		54	52
4,328 % fällig am 25.04.2035	5	5	0,00	3,821 % fällig am 20.06.2047	4.797	4.143	0,01	5,570 % fällig am 25.04.2037		61	55
4,501 % fällig am 25.01.2036	523	413	0,00	3,826 % fällig am 20.01.2047	157	131	0,00	5,570 % fällig am 25.05.2047		228	210
4,521 % fällig am 25.01.2036	40	37	0,00	3,846 % fällig am 20.11.2035	3.103	2.622	0,01	5,650 % fällig am 25.02.2047		1.035	897
4,645 % fällig am 25.03.2037	835	696	0,00	3,847 % fällig am 20.05.2035	760	663	0,00	6,250 % fällig am 26.08.2036		3.187	1,482
5,390 % fällig am 25.08.2036	11.970	4.411	0,01	3,858 % fällig am 20.11.2034	6	6	0,00	6,450 % fällig am 25.09.2047		1.064	932
5,490 % fällig am 25.05.2036	5.682	2.215	0,00	3,902 % fällig am 20.09.2046	86	71	0,00	7,550 % fällig am 25.10.2047		2.454	2,046
5,570 % fällig am 25.06.2037	2.746	3.280	0,01	3,925 % fällig am 27.08.2036	16.884	15.568	0,03	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
5,670 % fällig am 25.01.2036	263	245	0,00	3,967 % fällig am 20.05.2036	1.210	1.136	0,00	3,735 % fällig am 25.05.2047		117	87
5,690 % fällig am 25.02.2036	177	104	0,00	4,046 % fällig am 20.02.2036	41	33	0,00	3,793 % fällig am 25.08.2047		1.472	1,258
6,100 % fällig am 25.08.2035	1.298	1.118	0,00	4,102 % fällig am 20.11.2034	38	36	0,00	3,887 % fällig am 25.05.2047		3.070	2,751
6,119 % fällig am 25.11.2037	781	545	0,00	4,120 % fällig am 20.11.2035	232	215	0,00	3,889 % fällig am 25.07.2036		201	171
6,300 % fällig am 25.01.2035	1.524	1.258	0,00	4,171 % fällig am 20.05.2036	252	226	0,00	3,970 % fällig am 25.03.2035		9	9
6,300 % fällig am 25.03.2035	1.893	1.590	0,00	4,365 % fällig am 20.06.2032	3	3	0,00	3,986 % fällig am 25.10.2046		1.583	1,322
Alba PLC				4,416 % fällig am 20.01.2047	1.649	1.530	0,00	4,065 % fällig am 25.04.2033		33	32
5,191 % fällig am 17.03.2039	£ 6.363	7.781	0,01	4,627 % fällig am 20.07.2036	127	119	0,00	4,221 % fällig am 25.08.2035		642	522
5,235 % fällig am 25.11.2042	957	1.163	0,00	5,210 % fällig am 25.01.2037	2.250	1.936	0,00	4,271 % fällig am 25.02.2047		2.393	2,113
5,262 % fällig am 17.03.2039	2.826	3.421	0,01	5,250 % fällig am 25.04.2037	3.233	2.634	0,01	4,403 % fällig am 25.10.2033		1	1
5,312 % fällig am 17.03.2039	7.054	8.321	0,01	5,358 % fällig am 26.05.2037	6.806	5.983	0,01	4,572 % fällig am 25.02.2036		2.254	1,978
Alliance Bancorp Trust				5,398 % fällig am 26.07.2036	5.061	4.095	0,01	4,582 % fällig am 25.06.2035		39	36
5,630 % fällig am 25.07.2037	\$ 981	837	0,00	5,477 % fällig am 20.02.2047	3.239	2.816	0,01	4,586 % fällig am 25.10.2035		440	423
American Home Mortgage Assets Trust				5,500 % fällig am 26.07.2035	121	104	0,00	4,831 % fällig am 25.06.2035		14	13
3,209 % fällig am 25.11.2035	1.077	815	0,00	5,500 % fällig am 25.01.2036	35	33	0,00	5,137 % fällig am 25.07.2034		1	1
4,676 % fällig am 25.02.2047	24.723	10.146	0,02	5,500 % fällig am 25.03.2036	50	42	0,00	6,662 % fällig am 25.12.2046		4.170	3,400
4,896 % fällig am 25.11.2046	30.753	9.490	0,02	5,537 % fällig am 20.10.2036	7.844	6.264	0,01	Bear Stearns ALT-A Trust			
4,916 % fällig am 25.10.2046	4.176	2.934	0,01	5,537 % fällig am 20.12.2046	2.420	1.997	0,00	3,695 % fällig am 25.05.2036		978	716
5,270 % fällig am 25.10.2046	6.102	5.387	0,01	5,577 % fällig am 20.04.2047	690	547	0,00	3,744 % fällig am 25.04.2037		261	195
5,275 % fällig am 25.03.2047	1.286	1.143	0,00	5,577 % fällig am 20.05.2047	6.811	6.027	0,01	3,817 % fällig am 25.11.2036		5.036	2,663
5,340 % fällig am 25.10.2046	10.293	6.417	0,01	5,577 % fällig am 20.06.2047	541	428	0,00	3,859 % fällig am 25.09.2035		1.685	695
5,340 % fällig am 25.12.2046	5.296	4.494	0,01	5,710 % fällig am 25.07.2037	196	179	0,00	3,866 % fällig am 25.08.2046		4.481	3,212
5,360 % fällig am 25.10.2046	3.953	2.185	0,00	5,717 % fällig am 20.06.2047	2.224	1.774	0,00	3,877 % fällig am 25.01.2047		550	261
5,530 % fällig am 25.09.2046	2.345	2.003	0,00	5,730 % fällig am 25.07.2037	4.542	3.878	0,01	3,953 % fällig am 25.09.2035		3.547	1,499
5,730 % fällig am 25.08.2037	1.791	1.610	0,00	5,750 % fällig am 25.11.2035	1.926	1.764	0,00	3,987 % fällig am 25.09.2047		19.830	11,846
6,750 % fällig am 25.11.2046	5.639	4.889	0,01	5,750 % fällig am 25.03.2036	0	0	0,00	4,040 % fällig am 25.12.2046		156	103
American Home Mortgage Investment Trust				5,750 % fällig am 25.03.2036	110	85	0,00	4,116 % fällig am 25.08.2036		7.335	3,835
5,340 % fällig am 25.05.2047	2.147	1.182	0,00	5,750 % fällig am 25.08.2036	194	165	0,00	4,117 % fällig am 25.10.2035		751	637
5,430 % fällig am 25.03.2046	7.493	6.471	0,01	5,757 % fällig am 20.05.2047	1.565	1.399	0,00	4,195 % fällig am 25.05.2035		352	333
5,510 % fällig am 25.12.2046	7.198	6.040	0,01	5,763 % fällig am 25.10.2036	185	161	0,00	4,202 % fällig am 25.09.2035		1.569	976
5,550 % fällig am 25.03.2046	2.897	2.492	0,01	5,773 % fällig am 25.05.2037	85	76	0,00	4,331 % fällig am 25.09.2034		225	194
5,750 % fällig am 25.09.2045	7.326	6.462	0,01	5,846 % fällig am 25.01.2037	188	163	0,00	4,363 % fällig am 25.01.2037		592	504
5,750 % fällig am 25.11.2045	5.528	4.009	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2036	564	389	0,00	4,365 % fällig am 25.01.2036		577	526
5,883 % fällig am 25.09.2035	12.380	6.847	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2036	222	180	0,00	4,433 % fällig am 25.07.2035		327	240
5,975 % fällig am 25.02.2045	7.343	6.709	0,01	6,000 % fällig am 25.09.2036	628	532	0,00	4,577 % fällig am 25.09.2035		1.432	1,177
6,500 % fällig am 25.03.2047	759	564	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2037	1.414	1.108	0,00	5,044 % fällig am 25.10.2033		2	2
6,950 % fällig am 25.06.2036	7.599	1.290	0,00	6,000 % fällig am 26.10.2037	1.290	1.131	0,00	5,470 % fällig am 25.08.2036		5.880	5,021
7,129 % fällig am 25.09.2035	3.406	1.525	0,00	6,347 % fällig am 25.01.2037	588	522	0,00	5,470 % fällig am 25.06.2046		3.160	2,727
7,369 % fällig am 25.12.2036	4.233	3.504	0,01	6,479 % fällig am 25.10.2036	498	423	0,00	5,470 % fällig am 25.01.2047		1.792	1,432

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,870 % fällig am 25.08.2035	\$ 4.782	\$ 4.458	0,01	ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust	\$ 600	\$ 508	0,00	5,750 % fällig am 25.04.2037	\$ 3.722	\$ 3.349	0,01
6,125 % fällig am 25.07.2035	1.500	1.357	0,00	4,042 % fällig am 25.08.2037 ^	5.538	5.083	0,01	5,800 % fällig am 25.12.2036	1.676	1.349	0,00
6,275 % fällig am 25.01.2035	1.666	1.539	0,00	5,610 % fällig am 25.08.2037 ^	1	5.711	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2036	925	800	0,00
6,800 % fällig am 25.09.2034	1.111	1.068	0,00	Chester A PLC				6,000 % fällig am 25.09.2036	197	171	0,00
<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>				0,000 % fällig am 17.03.2046 (f)(m)	£ 13.675	15.221	0,02	6,000 % fällig am 25.10.2036 ^	206	177	0,00
5,125 % fällig am 25.03.2034	342	351	0,00	0,000 % fällig am 20.05.2046 (m)	1	5.711	0,01	6,000 % fällig am 25.11.2036	3.301	2.947	0,01
5,500 % fällig am 25.08.2035	1.778	1.093	0,00	5,702 % fällig am 17.03.2046 (m)	51.712	65.956	0,10	6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	423	365	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2035	162	138	0,00	6,152 % fällig am 17.03.2046 (m)	14.727	18.645	0,03	6,000 % fällig am 25.08.2037	6.526	5.639	0,01
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	2.884	1.461	0,00	6,652 % fällig am 17.03.2046 (m)	13.675	17.191	0,03	<b>Commercial Mortgage Trust</b>			
5,550 % fällig am 25.10.2034	56	47	0,00	7,152 % fällig am 17.03.2046 (m)	8.415	10.491	0,02	0,250 % fällig am 10.04.2047 (a)	58.900	53	0,00
5,750 % fällig am 25.11.2034 ^	1.531	1.315	0,00	7,902 % fällig am 17.03.2046 (m)	4.207	5.163	0,01	1,108 % fällig am 10.08.2046 (a)	6.232	0	0,00
6,500 % fällig am 25.03.2037	1.471	1.248	0,00	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				1,450 % fällig am 10.10.2049 (a)	66.785	2.052	0,00
<b>Bear Stearns Mortgage Funding Trust</b>				5,037 % fällig am 25.08.2035	\$ 725	564	0,00	3,140 % fällig am 10.10.2036	10.000	8.730	0,01
5,290 % fällig am 25.03.2037	2.385	2.057	0,00	5,300 % fällig am 25.12.2036	246	217	0,00	3,178 % fällig am 10.02.2035	29.775	27.663	0,04
5,310 % fällig am 25.12.2046	2.942	2.416	0,00	5,330 % fällig am 25.05.2036	738	659	0,00	3,505 % fällig am 10.08.2048	7.213	6.853	0,01
5,310 % fällig am 25.06.2047	2.750	2.314	0,00	5,350 % fällig am 25.01.2036	671	603	0,00	3,651 % fällig am 10.02.2049	13.901	13.155	0,02
5,320 % fällig am 25.06.2047	6.610	5.581	0,01	5,350 % fällig am 25.10.2036	958	855	0,00	3,732 % fällig am 10.08.2049	13.175	12.317	0,02
5,330 % fällig am 25.10.2036	960	814	0,00	5,380 % fällig am 25.10.2035	705	653	0,00	3,961 % fällig am 10.05.2051	39.998	37.148	0,06
5,340 % fällig am 25.01.2037	10.128	9.198	0,02	5,400 % fällig am 25.10.2035	710	663	0,00	6,293 % fällig am 15.09.2033	10.849	9.954	0,02
5,550 % fällig am 25.02.2037 ^	8.959	8.084	0,01	5,420 % fällig am 25.05.2035	581	552	0,00	<b>Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust</b>			
6,500 % fällig am 25.09.2047	11.038	10.033	0,02	5,430 % fällig am 25.01.2035	327	309	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	282	168	0,00
<b>Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust</b>				5,450 % fällig am 25.08.2035	118	108	0,00	6,250 % fällig am 25.08.2037	1.203	636	0,00
3,484 % fällig am 26.12.2046 ^	1.822	1.375	0,00	5,470 % fällig am 25.05.2035	160	149	0,00	7,000 % fällig am 25.01.2037 ^	287	62	0,00
4,098 % fällig am 26.01.2036 ^	1.530	1.226	0,00	5,510 % fällig am 25.03.2035	155	149	0,00	<b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>			
<b>BellaVista Mortgage Trust</b>				5,730 % fällig am 25.10.2035	336	304	0,00	1,350 % fällig am 25.09.2037 (a)	831	119	0,00
5,874 % fällig am 22.01.2045	480	411	0,00	5,830 % fällig am 25.10.2034	398	368	0,00	1,800 % fällig am 25.10.2037 ^ (a)	1.577	285	0,00
<b>BNPP Mortgage Securities LLC Trust</b>				<b>Citigroup Commercial Mortgage Trust</b>				3,324 % fällig am 25.05.2035 ^	1.997	1.477	0,00
6,000 % fällig am 27.08.2037	1.143	398	0,00	0,452 % fällig am 11.03.2047 (a)	25.416	34	0,00	3,369 % fällig am 25.10.2035 ^	165	142	0,00
<b>Braemar Hotels &amp; Resorts Trust</b>				3,635 % fällig am 10.05.2035	7.410	6.445	0,01	3,716 % fällig am 25.07.2021 ^	4	3	0,00
6,138 % fällig am 15.06.2035	262	260	0,00	6,468 % fällig am 15.12.2036	4.150	4.076	0,01	4,003 % fällig am 25.09.2034 ^	1.124	1.059	0,00
<b>Brants Bridge PLC</b>				7,118 % fällig am 15.12.2036	6.675	6.416	0,01	4,008 % fällig am 25.06.2037 ^	7.356	6.236	0,01
0,000 % fällig am 14.06.2066 (c)	£ 22.000	27.836	0,04	8,118 % fällig am 15.12.2036	4.000	3.826	0,01	4,024 % fällig am 25.03.2047 ^	884	796	0,00
<b>Bridgegate Funding PLC</b>				<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b>				4,047 % fällig am 25.03.2047	701	607	0,00
6,716 % fällig am 16.10.2062	62.868	79.837	0,12	3,126 % fällig am 25.02.2037	3.198	2.362	0,00	4,048 % fällig am 20.11.2035	9.226	8.576	0,01
7,466 % fällig am 16.10.2062	44.065	55.332	0,09	3,223 % fällig am 25.03.2037 ^	274	236	0,00	4,241 % fällig am 25.09.2034	33	31	0,00
8,466 % fällig am 16.10.2062	25.165	31.673	0,05	3,564 % fällig am 25.08.2047 ^	235	202	0,00	4,290 % fällig am 25.04.2036 ^	196	167	0,00
9,466 % fällig am 16.10.2062	18.898	23.706	0,04	3,584 % fällig am 25.03.2037 ^	4.104	3.525	0,01	4,826 % fällig am 25.11.2046	5.696	4.839	0,01
<b>BWAY Mortgage Trust</b>				3,839 % fällig am 25.10.2035 ^	75	65	0,00	4,916 % fällig am 25.06.2046	4.646	3.747	0,01
2,917 % fällig am 10.01.2035	\$ 20.818	15.842	0,03	3,853 % fällig am 25.04.2036	761	450	0,00	4,976 % fällig am 25.12.2035	964	860	0,00
<b>BX Trust</b>				3,915 % fällig am 25.05.2042	945	862	0,00	4,976 % fällig am 25.02.2036	135	124	0,00
6,243 % fällig am 15.05.2030	8.100	8.019	0,01	3,953 % fällig am 20.02.2036	1.731	1.530	0,00	5,000 % fällig am 25.08.2035 ^	2.484	1.760	0,00
7,413 % fällig am 15.05.2035	662	648	0,00	3,974 % fällig am 25.08.2037	2.232	1.931	0,00	5,250 % fällig am 25.06.2035	701	542	0,00
8,468 % fällig am 15.07.2034	26.941	26.872	0,04	4,001 % fällig am 25.03.2037 ^	1.267	1.096	0,00	5,250 % fällig am 25.06.2035 ^	704	544	0,00
9,568 % fällig am 15.07.2034	2.662	2.642	0,01	4,100 % fällig am 25.03.2036 ^	330	301	0,00	5,250 % fällig am 25.10.2035	218	150	0,00
<b>BXP Trust</b>				4,145 % fällig am 25.01.2082	25.909	22.478	0,04	5,286 % fällig am 20.07.2035 ^	76	67	0,00
3,379 % fällig am 13.06.2039	90.000	80.777	0,13	4,155 % fällig am 25.06.2036 ^	1.313	1.215	0,00	5,326 % fällig am 25.08.2035 ^	363	289	0,00
<b>Canada Square Funding PLC</b>				4,213 % fällig am 25.11.2036 ^	2.134	1.916	0,02	5,337 % fällig am 20.02.2047 ^	1.750	1.366	0,00
5,316 % fällig am 17.01.2059	£ 3.282	4.148	0,01	4,223 % fällig am 25.04.2037 ^	1.537	1.338	0,00	5,347 % fällig am 20.03.2047	6.155	5.070	0,01
5,682 % fällig am 17.06.2058	15.541	19.652	0,03	4,288 % fällig am 25.07.2037 ^	1.246	1.086	0,00	5,352 % fällig am 20.12.2046 ^	8.605	7.211	0,01
5,852 % fällig am 17.06.2058	13.964	17.666	0,03	4,408 % fällig am 25.09.2064	13.614	10.565	0,02	5,356 % fällig am 25.11.2047 ^	4.292	3.544	0,01
6,152 % fällig am 17.12.2057	10.497	13.371	0,02	4,418 % fällig am 25.08.2035 ^	378	313	0,00	5,376 % fällig am 25.08.2035 ^	693	651	0,00
<b>Canterbury Finance PLC</b>				4,423 % fällig am 25.07.2036 ^	130	94	0,00	5,390 % fällig am 25.06.2036	1.762	1.596	0,00
5,377 % fällig am 16.05.2058	4.457	5.660	0,01	5,138 % fällig am 25.11.2036	536	398	0,00	5,390 % fällig am 25.12.2046	676	588	0,00
7,111 % fällig am 16.05.2056	1.842	2.348	0,00	5,278 % fällig am 25.08.2036	11.161	4.599	0,01	5,410 % fällig am 25.03.2047 ^	4.532	3.523	0,01
<b>Cascade Funding Mortgage Trust</b>				5,280 % fällig am 25.06.2036	5.410	5.084	0,01	5,430 % fällig am 25.08.2037	6.904	6.046	0,01
4,000 % fällig am 25.10.2068	\$ 9.410	9.109	0,02	5,470 % fällig am 25.09.2036	343	323	0,00	5,430 % fällig am 25.04.2047	5.725	5.100	0,01
<b>Chase Mortgage Finance Trust</b>				5,470 % fällig am 25.01.2037	3.390	2.893	0,01	5,437 % fällig am 20.09.2046	5.259	3.792	0,01
3,883 % fällig am 25.12.2035 ^	2.059	1.882	0,00	5,500 % fällig am 25.09.2035	908	880	0,00	5,450 % fällig am 25.08.2035 ^	266	168	0,00
3,938 % fällig am 25.12.2035 ^	91	78	0,00	5,650 % fällig am 25.09.2036	3.182	3.003	0,01	5,450 % fällig am 25.11.2035 ^	782	83	0,00
3,948 % fällig am 25.01.2036 ^	530	466	0,00	5,655 % fällig am 25.07.2036 ^	1.539	1.169	0,00	5,470 % fällig am 25.09.2047	3.403	2.957	0,01
3,962 % fällig am 25.03.2037 ^	761	708	0,00	5,750 % fällig am 25.11.2035 ^	2.527	1.896	0,00	5,490 % fällig am 25.05.2047	3.378	2.911	0,01
4,086 % fällig am 25.03.2037 ^	2.925	2.725	0,01	6,000 % fällig am 25.12.2035	1.293	1.224	0,00	5,500 % fällig am 25.04.2035	2.382	2.000	0,00
4,477 % fällig am 25.07.2037	151	92	0,00	6,000 % fällig am 25.11.2036	44	42	0,00	5,500 % fällig am 25.05.2035 ^	3.033	2.331	0,00
4,529 % fällig am 25.07.2037	513	394	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2037	1.367	537	0,00	5,500 % fällig am 25.06.2035 ^	2.502	2.051	0,00
4,725 % fällig am 25.02.2037	188	178	0,00	<b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>				5,500 % fällig am 25.06.2035 ^	3.450	2.479	0,01
4,739 % fällig am 25.02.2037	1.220	1.163	0,00	3,827 % fällig am 25.04.2035	407	383	0,00	5,500 % fällig am 25.06.2035 ^	863	502	0,00
5,165 % fällig am 25.02.2037	1.120	1.057	0,00	3,928 % fällig am 25.05.2035	163	157	0,00	5,500 % fällig am 25.07.2035 ^	279	205	0,00
5,250 % fällig am 25.05.2035	0	0	0,00	3,994 % fällig am 25.12.2035 ^	521	342	0,00	5,500 % fällig am 25.08.2035 ^	1.616	1.307	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035	2.177	1.638	0,00	4,326 % fällig am 25.08.2035	2.167	1.802	0,00	5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	2.856	2.271	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2036	2.751	1.281	0,00	<b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates</b>				5,500 % fällig am 25.10.2035	4.748	3.540	0,01
6,000 % fällig am 25.11.2036 ^	943	414	0,00	3,626 % fällig am 25.09.2035 ^	1.324	1.148	0,00	5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	1.924	1.181	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	2.501	1.200	0,00								

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,500 % fällig am 25.04.2036	\$ 519	\$ 404	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	\$ 15.873	\$ 8.246	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2037	\$	\$ 1.622	0,00
5,500 % fällig am 25.05.2036 ^	2.140	877	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2047 ^	2.145	1.090	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2037	1.279	944	0,00
5,500 % fällig am 25.10.2036 ^	1.489	693	0,00	6,050 % fällig am 25.12.2036 ^	779	261	0,00	6,000 % fällig am 25.01.2038 ^	6.775	3.279	0,01
5,500 % fällig am 25.11.2036	5.146	4.249	0,01	6,170 % fällig am 25.03.2037 ^	955	544	0,00	6,250 % fällig am 25.09.2036 ^	475	207	0,00
5,500 % fällig am 25.04.2037 ^	491	268	0,00	6,250 % fällig am 25.02.2036 ^	70	54	0,00	6,500 % fällig am 25.12.2037	4.820	2.119	0,00
5,510 % fällig am 25.09.2046	1.908	1.662	0,00	6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	407	196	0,00	6,537 % fällig am 20.02.2036 ^	1.657	1.516	0,00
5,510 % fällig am 25.05.2047	297	256	0,00	6,500 % fällig am 25.08.2032	7	7	0,00	<b>Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust</b>			
5,510 % fällig am 25.06.2047	4.772	3.948	0,01	6,500 % fällig am 25.09.2037 ^	9.273	3.811	0,01	4,237 % fällig am 25.01.2034 ^	187	153	0,00
5,520 % fällig am 25.02.2037 ^	747	228	0,00	6,610 % fällig am 25.11.2035	6.458	5.932	0,01	5,570 % fällig am 25.07.2036	335	306	0,00
5,530 % fällig am 25.07.2046 ^	1.385	1.341	0,00	6,750 % fällig am 25.10.2036 ^	1.406	422	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2035 ^	321	303	0,00
5,530 % fällig am 25.08.2046	14.571	12.247	0,02	7,000 % fällig am 25.10.2037	5.680	2.152	0,00	<b>Countrywide Mortgage-Backed Securities, Inc.</b>			
5,550 % fällig am 25.05.2036	4.089	3.517	0,01	7,500 % fällig am 25.07.2036	1.808	1.265	0,00	5,945 % fällig am 27.11.2035	265	245	0,00
5,550 % fällig am 25.12.2036 ^	4.183	896	0,00	<b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust</b>				<b>Countrywide, Inc.</b>			
5,550 % fällig am 25.04.2037 ^	2.048	662	0,00	5,630 % fällig am 25.04.2036 ^	794	670	0,00	5,693 % fällig am 27.11.2035	0	0	0,00
5,570 % fällig am 25.07.2046	4.691	4.160	0,01	5,870 % fällig am 25.11.2035	121	116	0,00	<b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b>			
5,570 % fällig am 25.07.2046 ^	1.121	930	0,00	<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>				3,672 % fällig am 25.06.2046	23.780	21.663	0,03
5,576 % fällig am 25.08.2035 ^	1.833	1.460	0,00	2,050 % fällig am 25.05.2036				4,255 % fällig am 25.03.2033	71	67	0,00
5,577 % fällig am 20.03.2046	5.134	4.205	0,01	(a)	335	52	0,00	5,000 % fällig am 25.07.2035 ^	591	538	0,00
5,577 % fällig am 20.05.2046 ^	15.819	13.425	0,02	2,961 % fällig am 25.02.2035	2.013	1.637	0,00	5,500 % fällig am 25.07.2035	1.417	1.294	0,00
5,590 % fällig am 25.09.2047	4.444	3.842	0,01	3,250 % fällig am 25.05.2047	2.466	2.077	0,00	6,000 % fällig am 25.12.2035	1.869	868	0,00
5,610 % fällig am 25.03.2036	3.112	3.006	0,01	3,413 % fällig am 20.01.2035	61	53	0,00	6,500 % fällig am 25.12.2035 ^	426	217	0,00
5,610 % fällig am 25.11.2036 ^	3.395	2.946	0,01	3,514 % fällig am 25.04.2035 ^	1.715	1.319	0,00	7,000 % fällig am 25.12.2035 ^	1.296	264	0,00
5,621 % fällig am 25.06.2035	2.003	1.774	0,00	3,656 % fällig am 25.03.2037	361	330	0,00	7,000 % fällig am 27.11.2036 ^	4.856	773	0,00
5,623 % fällig am 20.07.2035	1.653	1.535	0,00	3,673 % fällig am 25.11.2037	1.436	1.332	0,00	<b>Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates</b>			
5,630 % fällig am 25.07.2035	1.314	1.052	0,00	3,677 % fällig am 20.02.2036	2.388	2.049	0,00	4,053 % fällig am 25.10.2033	5	5	0,00
5,630 % fällig am 25.01.2037	3.351	2.731	0,01	3,680 % fällig am 20.09.2036 ^	2.312	2.002	0,00	5,582 % fällig am 25.07.2035	2.136	2.028	0,00
5,650 % fällig am 25.07.2036 ^	2.285	996	0,00	3,718 % fällig am 20.03.2036	423	343	0,00	<b>Credit Suisse Mortgage Capital Certificates</b>			
5,650 % fällig am 25.09.2036	111	46	0,00	3,787 % fällig am 25.04.2037 ^	1.642	1.479	0,00	3,424 % fällig am 27.02.2046	6.564	3.679	0,01
5,650 % fällig am 25.05.2037 ^	1.780	599	0,00	3,793 % fällig am 20.02.2036	739	647	0,00	3,519 % fällig am 30.11.2037	7.521	6.905	0,01
5,650 % fällig am 25.05.2037	149	65	0,00	3,797 % fällig am 20.04.2036	1.143	997	0,00	3,778 % fällig am 26.08.2036	4.228	3.644	0,01
5,650 % fällig am 25.06.2037	3.497	2.931	0,01	3,810 % fällig am 25.11.2034	35	31	0,00	3,809 % fällig am 27.07.2037	730	708	0,00
5,650 % fällig am 25.09.2037	831	334	0,00	3,876 % fällig am 25.11.2037	1.614	1.426	0,00	3,910 % fällig am 27.02.2036	2.486	1.769	0,00
5,650 % fällig am 25.07.2046	2.668	2.358	0,00	3,906 % fällig am 20.04.2035	115	110	0,00	3,975 % fällig am 27.01.2036	3.219	3.065	0,01
5,670 % fällig am 25.07.2035	1.275	1.114	0,00	3,910 % fällig am 20.04.2035	538	500	0,00	4,255 % fällig am 26.06.2036	3.332	2.869	0,01
5,670 % fällig am 25.12.2035	1.037	935	0,00	3,927 % fällig am 20.06.2036	1.710	1.476	0,00	4,409 % fällig am 27.07.2037	1.010	932	0,00
5,690 % fällig am 25.01.2036	2.481	2.232	0,00	3,929 % fällig am 20.05.2036	1.518	1.426	0,00	4,847 % fällig am 27.11.2036	13.173	15.690	0,03
5,690 % fällig am 25.07.2036	2.735	2.330	0,00	3,937 % fällig am 20.05.2036 ^	1.145	1.020	0,00	5,300 % fällig am 29.09.2036	292	281	0,00
5,710 % fällig am 25.08.2035	2.943	2.615	0,01	4,012 % fällig am 20.12.2035	344	312	0,00	5,418 % fällig am 27.10.2036	8.855	6.659	0,01
5,710 % fällig am 25.02.2037	4.928	4.081	0,01	4,028 % fällig am 25.01.2036 ^	189	175	0,00	5,750 % fällig am 26.12.2035	399	290	0,00
5,710 % fällig am 25.10.2046	7.334	6.773	0,01	4,041 % fällig am 20.09.2035	1.378	1.234	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	856	717	0,00
5,710 % fällig am 25.08.2047 ^	5.612	4.576	0,01	4,070 % fällig am 20.12.2035	45	42	0,00	18,431 % fällig am 27.11.2037	480	480	0,00
5,730 % fällig am 25.02.2036 ^	1.110	983	0,00	4,172 % fällig am 20.09.2035	84	69	0,00	<b>Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust</b>			
5,750 % fällig am 25.07.2035 ^	121	78	0,00	4,241 % fällig am 20.10.2034	222	190	0,00	5,500 % fällig am 25.08.2036 ^	1.157	833	0,00
5,750 % fällig am 25.10.2035	511	376	0,00	4,249 % fällig am 25.08.2034 ^	390	350	0,00	5,942 % fällig am 25.02.2037 ^	1.037	257	0,00
5,750 % fällig am 25.12.2035	1.762	1.338	0,00	4,344 % fällig am 20.06.2035	4	4	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2021 ^	11	5	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2036	1.379	1.241	0,00	4,344 % fällig am 20.06.2035	16	15	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2036 ^	4.025	1.816	0,00
5,750 % fällig am 25.05.2036	3.291	1.394	0,00	4,366 % fällig am 19.01.2034	8	7	0,00	6,396 % fällig am 25.04.2036	278	150	0,00
5,750 % fällig am 25.05.2036 ^	5.663	2.394	0,00	4,630 % fällig am 20.10.2034	398	351	0,00	6,421 % fällig am 25.10.2037	4.347	2.697	0,01
5,750 % fällig am 25.10.2036	641	249	0,00	4,741 % fällig am 20.07.2034	141	129	0,00	<b>Credit Suisse Mortgage Capital Trust</b>			
5,750 % fällig am 25.03.2037	579	518	0,00	5,450 % fällig am 25.05.2036	335	102	0,00	2,500 % fällig am 25.07.2057	59.164	51.586	0,08
5,750 % fällig am 25.03.2037 ^	2.955	1.618	0,00	5,500 % fällig am 25.05.2035	586	480	0,00	2,873 % fällig am 25.12.2048	12.380	10.546	0,02
5,750 % fällig am 25.06.2037	10.662	4.955	0,01	5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	414	376	0,00	2,995 % fällig am 25.07.2057	3.608	2.738	0,01
5,763 % fällig am 20.11.2035	1.399	1.303	0,00	5,500 % fällig am 25.10.2035 ^	913	557	0,00	3,076 % fällig am 25.02.2056	156.511	124.398	0,19
5,770 % fällig am 25.08.2035 ^	1.361	1.215	0,00	5,550 % fällig am 25.11.2035 ^	494	310	0,00	3,105 % fällig am 25.07.2057	52.865	31.474	0,05
5,790 % fällig am 25.11.2035	807	649	0,00	5,550 % fällig am 25.09.2037 ^	2.355	1.614	0,00	3,257 % fällig am 25.07.2058	276.092	215.153	0,33
5,803 % fällig am 20.11.2035	8.144	7.015	0,01	5,550 % fällig am 25.04.2046	2.283	1.922	0,00	3,398 % fällig am 25.09.2048	12.912	10.878	0,02
5,830 % fällig am 25.09.2035	633	378	0,00	5,630 % fällig am 25.03.2036	3.774	3.463	0,01	3,726 % fällig am 25.10.2058	521	439	0,00
5,850 % fällig am 25.09.2035	4.466	4.038	0,01	5,730 % fällig am 25.04.2035	1.129	1.043	0,00	3,806 % fällig am 25.06.2048	47.608	39.409	0,06
5,850 % fällig am 25.05.2036	4.162	1.872	0,00	5,730 % fällig am 25.04.2035	103	92	0,00	4,277 % fällig am 25.04.2058	51.550	46.950	0,07
6,000 % fällig am 25.03.2027 ^	20	19	0,00	5,750 % fällig am 25.12.2035 ^	1.308	667	0,00	4,281 % fällig am 25.09.2057	29.631	25.252	0,04
6,000 % fällig am 25.11.2034	3.585	3.512	0,01	5,750 % fällig am 25.06.2037	1.910	1.009	0,00	4,878 % fällig am 25.09.2057	1.248	1.073	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2034	736	656	0,00	5,770 % fällig am 25.03.2035	1.242	1.063	0,00	4,953 % fällig am 01.06.2050	102.687	101.821	0,16
6,000 % fällig am 25.02.2035	1.352	1.153	0,00	5,790 % fällig am 25.03.2035	1.606	1.413	0,00	5,943 % fällig am 15.07.2032	31.309	29.860	0,05
6,000 % fällig am 25.08.2035 ^	55	25	0,00	5,810 % fällig am 25.02.2035	2.047	1.647	0,00	6,193 % fällig am 15.07.2032	22.200	21.021	0,03
6,000 % fällig am 25.12.2035 ^	3.831	2.898	0,01	5,830 % fällig am 25.03.2035 ^	11	10	0,00	7,093 % fällig am 15.07.2032	9.193	8.348	0,01
6,000 % fällig am 25.01.2036 ^	2.024	1.464	0,00	5,830 % fällig am 25.04.2046	6.827	2.048	0,00	<b>DBUS Mortgage Trust</b>			
6,000 % fällig am 25.02.2036	1.681	1.464	0,00	5,850 % fällig am 25.02.2035	2.727	2.380	0,00	3,452 % fällig am 10.10.2034	2.000	1.809	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2036	3.198	1.480	0,00	5,850 % fällig am 25.05.2036 ^	262	121	0,00	<b>DBWF Mortgage Trust</b>			
6,000 % fällig am 25.04.2036 ^	6.496	3.290	0,01	5,870 % fällig am 25.03.2035	684	597	0,00	6,276 % fällig am 19.12.2030	23.789	23.470	0,04
6,000 % fällig am 25.04.2036	1.561	863	0,00	5,890 % fällig am 25.02.2035	2.475	2.138	0,00	7,646 % fällig am 19.12.2030	9.300	9.096	0,02
6,000 % fällig am 25											



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,530 % fällig am 25.10.2036 ^	\$ 15.823	\$ 4.945	0,01	Fondo de Titulización de Activos UCI	€ 10.745	11.044	0,02	HarborView Mortgage Loan Trust	2.180	1.190	0,00
5,530 % fällig am 25.12.2036	1.951	696	0,00	3,672 % fällig am 16.06.2049				3,827 % fällig am 19.06.2036 ^	343	319	0,00
5,530 % fällig am 25.02.2037 ^	2.396	2.063	0,00	FWD Securitization Trust				4,061 % fällig am 19.11.2034	19	14	0,00
5,530 % fällig am 25.08.2047	5.777	5.170	0,01	2,240 % fällig am 25.01.2050	\$ 6.599	5.996	0,01	4,201 % fällig am 19.07.2035 ^	552	521	0,00
5,630 % fällig am 25.01.2047	2.695	2.457	0,01	GC Pastor Hipotecario FTA				4,596 % fällig am 19.12.2035 ^	147	54	0,00
5,710 % fällig am 25.08.2036	3.386	3.054	0,01	3,721 % fällig am 21.06.2046	€ 1.359	1.281	0,00	4,720 % fällig am 25.02.2036 ^	1.899	1.616	0,00
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				Glen Securities Finance DAC				4,826 % fällig am 19.12.2036 ^	16.874	14.945	0,02
3,238 % fällig am 25.08.2035 ^	622	553	0,00	5,342 % fällig am 28.10.2038	3.538	3.806	0,01	5,337 % fällig am 19.11.2046 ^	881	649	0,00
3,910 % fällig am 25.02.2036 ^	367	262	0,00	6,342 % fällig am 28.10.2038	2.673	2.844	0,01	5,347 % fällig am 19.09.2037	8.823	7.731	0,01
4,042 % fällig am 25.10.2035	2.042	1.806	0,00	7,142 % fällig am 28.10.2038	1.277	1.361	0,00	5,417 % fällig am 19.03.2037	4.773	4.293	0,01
5,350 % fällig am 25.11.2035 ^	2	1	0,00	Glenbeigh Issuer DAC				5,457 % fällig am 25.01.2047	11.909	10.792	0,02
5,500 % fällig am 25.11.2035	783	749	0,00	4,350 % fällig am 24.06.2050	7.304	7.931	0,01	5,476 % fällig am 19.09.2035 ^	98	86	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	645	522	0,00	GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.				5,497 % fällig am 19.12.2036 ^	524	490	0,00
Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust				5,456 % fällig am 10.03.2051	\$ 18.169	16.582	0,03	5,537 % fällig am 19.01.2038	9.667	8.952	0,02
6,005 % fällig am 25.10.2036 ^	1.316	1.063	0,00	5,550 % fällig am 10.08.2038	19.032	17.996	0,03	5,567 % fällig am 19.12.2036	36.251	30.293	0,05
6,445 % fällig am 25.02.2036 ^	3.773	3.288	0,01	GMAC Mortgage Corp. Loan Trust				5,577 % fällig am 19.11.2036	13.602	11.854	0,02
Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				3,281 % fällig am 19.04.2036 ^	302	236	0,00	5,597 % fällig am 19.05.2035	3.001	2.747	0,01
4,813 % fällig am 25.06.2036	251	213	0,00	3,351 % fällig am 19.11.2035 ^	59	50	0,00	5,657 % fällig am 19.01.2036	3.195	1.980	0,00
4,813 % fällig am 25.06.2036 ^	1.889	1.642	0,00	3,742 % fällig am 18.03.2035	15	13	0,00	5,697 % fällig am 19.03.2035	618	607	0,00
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.				4,750 % fällig am 19.07.2035	148	127	0,00	5,717 % fällig am 20.10.2045	3.845	2.468	0,01
6,500 % fällig am 27.07.2037	527	416	0,00	Great Hall Mortgages PLC				5,746 % fällig am 19.04.2034	67	60	0,00
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				4,102 % fällig am 18.06.2039	€ 800	784	0,00	5,777 % fällig am 19.09.2035	8.655	4.663	0,01
6,125 % fällig am 25.06.2034	241	237	0,00	4,772 % fällig am 18.06.2039	8.800	8.603	0,01	5,777 % fällig am 19.11.2035	159	115	0,00
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates				5,152 % fällig am 18.03.2039	€ 3.074	3.875	0,01	5,797 % fällig am 19.08.2045	2.470	1.913	0,00
4,057 % fällig am 27.06.2037	510	453	0,00	5,166 % fällig am 18.06.2039	95	120	0,00	5,837 % fällig am 19.01.2035	160	151	0,00
Domi BV				5,172 % fällig am 18.06.2038	2.005	2.529	0,01	5,976 % fällig am 19.10.2035	6.639	3.861	0,01
4,376 % fällig am 15.06.2051	€ 5.523	6.029	0,01	5,644 % fällig am 18.06.2039	\$ 192	190	0,00	5,976 % fällig am 19.01.2036 ^	957	407	0,00
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				5,802 % fällig am 18.03.2039	€ 1.710	1.952	0,00	6,150 % fällig am 25.10.2037	11.940	11.051	0,02
5,347 % fällig am 19.10.2036	\$ 6.164	5.112	0,01	6,277 % fällig am 18.06.2039	2.000	2.277	0,00	6,226 % fällig am 19.07.2045	19	16	0,00
5,357 % fällig am 19.10.2036	3.907	2.736	0,01	GreenPoint Mortgage Funding Trust				6,507 % fällig am 20.06.2035	901	783	0,00
5,737 % fällig am 19.10.2045	3.216	2.751	0,01	5,550 % fällig am 25.10.2046	\$ 6.771	6.209	0,01	6,697 % fällig am 19.02.2036	1.853	1.002	0,00
5,897 % fällig am 19.10.2045	2.860	2.638	0,01	5,570 % fällig am 25.04.2036	295	253	0,00	Harbour			
5,977 % fällig am 19.09.2044	7	6	0,00	5,590 % fällig am 25.06.2045	694	648	0,00	5,358 % fällig am 28.01.2054	€ 20.691	26.202	0,04
Dragon Finance BV				5,670 % fällig am 25.10.2045	3.327	3.262	0,01	5,457 % fällig am 28.01.2054	14.500	18.183	0,03
4,571 % fällig am 13.07.2023	€ 1.299	1.651	0,00	5,730 % fällig am 25.02.2036	1.420	1.276	0,00	Hilton Orlando Trust			
Dutch Property Finance BV				5,770 % fällig am 25.10.2045	2.447	2.228	0,00	9,093 % fällig am 15.12.2034	\$ 2.213	2.128	0,00
3,892 % fällig am 28.07.2054	€ 11.868	12.915	0,02	Grifonas Finance PLC				Hipocot FTA			
4,168 % fällig am 28.04.2064	48.969	53.555	0,08	3,513 % fällig am 28.08.2039	€ 18.519	19.242	0,03	3,351 % fällig am 24.10.2039	€ 1.725	1.862	0,00
Eurohome UK Mortgages PLC				GS Mortgage Securities Corp. Trust				HomeBanc Mortgage Trust			
5,137 % fällig am 15.06.2044	€ 3.332	4.070	0,01	3,419 % fällig am 10.10.2032	\$ 91	89	0,00	3,864 % fällig am 25.04.2037	\$ 538	483	0,00
5,351 % fällig am 15.09.2044	5.250	6.322	0,01	4,744 % fällig am 10.10.2032	35.288	33.096	0,05	4,203 % fällig am 25.04.2047	1.037	899	0,00
5,601 % fällig am 15.09.2044	7.250	8.504	0,01	GS Mortgage Securities Corp. Trust				5,670 % fällig am 25.01.2036	561	534	0,00
European Loan Conduit DAC				6,990 % fällig am 15.07.2025	12.349	12.064	0,02	5,885 % fällig am 25.01.2036	6.736	5.704	0,01
4,358 % fällig am 17.02.2030	€ 64.025	68.395	0,11	8,193 % fällig am 15.11.2032	19.350	18.476	0,03	5,890 % fällig am 25.12.2034	59	55	0,00
Eurosaill PLC				GSC Capital Corp. Mortgage Trust				Hops Hill PLC			
3,629 % fällig am 13.03.2045	37	40	0,00	5,550 % fällig am 25.02.2036 ^	1.670	1.514	0,00	5,854 % fällig am 27.05.2054	€ 25.818	32.867	0,05
3,709 % fällig am 13.03.2045	5.450	5.691	0,01	GSMP Mortgage Loan Trust				HSI Asset Loan Obligation Trust			
3,766 % fällig am 15.12.2044	732	787	0,00	3,731 % fällig am 25.06.2034	4.227	3.896	0,01	1,480 % fällig am 25.12.2036			
3,936 % fällig am 10.09.2044	3.200	3.292	0,01	5,500 % fällig am 25.03.2035	6.094	5.331	0,01	(a)	\$ 1.493	145	0,00
5,140 % fällig am 13.03.2045	€ 1.362	1.711	0,01	5,500 % fällig am 25.09.2035	7.076	5.988	0,01	5,520 % fällig am 25.12.2036	1.915	385	0,00
5,150 % fällig am 13.03.2045	2	2	0,00	5,550 % fällig am 25.06.2034	1.356	1.193	0,00	Impac CMB Trust			
5,433 % fällig am 10.09.2044	1.200	1.442	0,00	7,059 % fällig am 20.10.2032	1.246	1.086	0,00	5,690 % fällig am 25.05.2035	176	163	0,00
5,760 % fällig am 13.09.2045	12.771	15.421	0,03	GSMSC Resecuritization Trust				5,780 % fällig am 25.02.2036	1.520	1.217	0,00
5,940 % fällig am 13.06.2045	11.883	14.911	0,02	3,126 % fällig am 26.04.2037	9.344	2.596	0,01	5,790 % fällig am 25.11.2034	1.173	1.134	0,00
5,989 % fällig am 13.06.2045	1.321	1.535	0,00	4,310 % fällig am 26.08.2035	90	90	0,00	5,790 % fällig am 25.03.2035	2.560	2.346	0,00
Finsbury Square PLC				5,318 % fällig am 26.09.2036	8.104	5.388	0,01	5,830 % fällig am 25.01.2035	1.998	1.868	0,00
5,689 % fällig am 16.12.2071	4.206	5.321	0,01	GSR Mortgage Loan Trust				6,060 % fällig am 25.10.2034	335	327	0,00
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				3,575 % fällig am 25.03.2047 ^	5.635	3.679	0,01	Impac Secured Assets CMN Owner Trust			
4,203 % fällig am 25.09.2035 ^	\$ 156	129	0,00	3,704 % fällig am 25.05.2037 ^	1.304	752	0,00	5,450 % fällig am 25.03.2033	220	210	0,00
4,386 % fällig am 25.03.2035	613	383	0,00	3,733 % fällig am 25.04.2036 ^	3.713	2.553	0,01	Impac Secured Assets Corp.			
4,732 % fällig am 25.11.2035 ^	1.579	1.039	0,00	3,845 % fällig am 25.05.2037	2.928	2.693	0,01	5,790 % fällig am 25.03.2036	1.289	1.029	0,00
4,767 % fällig am 25.02.2037 ^	395	225	0,00	3,935 % fällig am 25.01.2036	839	821	0,00	6,575 % fällig am 25.02.2035	335	336	0,00
4,878 % fällig am 25.02.2036	112	84	0,00	4,310 % fällig am 25.05.2037 ^	122	104	0,00	Impac Secured Assets Trust			
5,118 % fällig am 25.01.2037 ^	797	594	0,00	4,660 % fällig am 25.07.2035	11	11	0,00	5,370 % fällig am 25.05.2037 ^	560	440	0,00
5,139 % fällig am 25.11.2036 ^	820	592	0,00	5,024 % fällig am 25.10.2035 ^	86	77	0,00	5,550 % fällig am 25.11.2036	526	521	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035	71	37	0,00	5,380 % fällig am 25.05.2037	12.202	6.259	0,01	5,630 % fällig am 25.03.2037	4.554	3.747	0,01
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	687	305	0,00	5,500 % fällig am 25.06.2035	2.046	1.858	0,00	5,630 % fällig am 25.09.2037 ^	2.763	2.295	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	379	164	0,00	5,500 % fällig am 25.07.2035	494	445	0,00	5,670 % fällig am 25.01.2037	8.753	7.008	0,01
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	365	154	0,00	5,590 % fällig am 25.08.2046	18.042	4.359	0,01	5,690 % fällig am 25.11.2036	6.342	4.864	0,01
6,250 % fällig am 25.11.2036	2.082	696	0,00	5,670 % fällig am 25.08.2046	15.076	3.959	0,01	5,690 % fällig am 25.02.2037 ^	4.971	4.423	0,01
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				5,750 % fällig am 25.03.2036 ^	228	203	0,00	5,850 % fällig am 25.05.2036	399	341	0,00
3,379 % fällig am 25.11.2036 ^	380	259	0,00	5,750 % fällig am 25.05.2037 ^	139	301	0,00	5,870 % fällig am 25.09.2037	2.357	1.929	0,00
3,858 % fällig am 25.07.2037 ^	238	154	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2036	1.804	933	0,00	IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust			
4,032 % fällig am 25.01.2036 ^	28	16	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2036	1.880	1.117	0,00	3,686 % fällig am 25.01.2032	1	1	0,00
4,267 % fällig am 25.09.2035	5	5	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	459	299	0,00	IndyMac Mortgage Loan Trust			
4,283 % fällig am 25.11.2037 ^	458	398	0,00	6,250 % fällig am 25.08.2036	2.179	762	0,00	3,0			

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES	
			NETTO- VERMÖ- GENS	GENS				NETTO- VERMÖ- GENS	GENS				NETTO- VERMÖ- GENS	GENS
3,233 % fällig am 25.08.2037 ^	\$ 4.695	\$ 3.592	0,01	0,01	4,549 % fällig am 05.07.2033	3.809	3.364	0,01	0,01	6,000 % fällig am 25.12.2036	\$ 1.124	\$ 939	0,00	0,00
3,261 % fällig am 25.06.2036	5.568	3.690	0,01	0,01	4,950 % fällig am 05.07.2033	38.900	33.614	0,05	0,05	6,050 % fällig am 25.12.2035 ^	592	359	0,00	0,00
3,314 % fällig am 25.07.2037	6.867	5.975	0,01	0,01	5,337 % fällig am 15.05.2047	1.105	1.034	0,00	0,00	Lehman XS Trust				
3,317 % fällig am 25.05.2037 ^	1.561	1.285	0,00	0,00	5,350 % fällig am 05.07.2033	19.100	8.401	0,01	0,01	4,976 % fällig am 25.11.2035	94	90	0,00	0,00
3,335 % fällig am 25.04.2037	3.641	3.012	0,01	0,01	6,293 % fällig am 15.12.2036	7.170	15.017	0,02	0,02	5,390 % fällig am 25.08.2036 ^	52	52	0,00	0,00
3,365 % fällig am 25.05.2035 ^	226	180	0,00	0,00	6,743 % fällig am 15.02.2035	2.184	2.104	0,00	0,00	5,420 % fällig am 25.02.2036	314	281	0,00	0,00
3,438 % fällig am 25.03.2036 ^	3.449	2.442	0,01	0,01	7,063 % fällig am 05.07.2033	10.109	9.028	0,02	0,02	5,450 % fällig am 25.11.2035	4.318	4.235	0,01	0,01
3,442 % fällig am 25.08.2037	2.781	1.894	0,00	0,00	JPMorgan Mortgage Trust					5,476 % fällig am 25.03.2047	2.909	2.739	0,01	0,01
3,446 % fällig am 25.08.2036	158	124	0,00	0,00	3,655 % fällig am 27.07.2037	456	412	0,00	0,00	5,530 % fällig am 25.12.2036	5.441	4.293	0,01	0,01
3,457 % fällig am 25.04.2037	6.836	5.776	0,01	0,01	3,853 % fällig am 25.05.2036 ^	40	34	0,00	0,00	5,530 % fällig am 25.09.2046	121	103	0,00	0,00
3,482 % fällig am 25.08.2035	63	47	0,00	0,00	3,859 % fällig am 25.04.2037 ^	3	2	0,00	0,00	5,550 % fällig am 25.08.2046	4.235	3.886	0,01	0,01
3,534 % fällig am 25.11.2035 ^	35	24	0,00	0,00	3,881 % fällig am 25.01.2037 ^	1.336	1.082	0,00	0,00	5,550 % fällig am 25.11.2046 ^	768	705	0,00	0,00
3,549 % fällig am 25.03.2037 ^	16	13	0,00	0,00	3,904 % fällig am 25.10.2036	201	145	0,00	0,00	5,550 % fällig am 25.03.2047	14.531	12.439	0,02	0,02
3,558 % fällig am 25.05.2037 ^	2.025	1.377	0,00	0,00	3,909 % fällig am 25.11.2035 ^	760	662	0,00	0,00	5,550 % fällig am 25.06.2047 ^	5.683	4.728	0,01	0,01
3,561 % fällig am 25.09.2036	1.413	966	0,00	0,00	3,909 % fällig am 25.11.2035	2.511	2.185	0,00	0,00	5,560 % fällig am 25.08.2046	8.175	7.431	0,01	0,01
3,570 % fällig am 25.09.2036 ^	104	88	0,00	0,00	3,912 % fällig am 25.08.2036 ^	186	157	0,00	0,00	5,570 % fällig am 25.11.2046	13.337	11.644	0,02	0,02
3,641 % fällig am 25.05.2036 ^	155	136	0,00	0,00	3,912 % fällig am 25.08.2036	102	75	0,00	0,00	5,590 % fällig am 25.06.2047	5.746	5.187	0,01	0,01
3,651 % fällig am 25.01.2037 ^	159	128	0,00	0,00	3,921 % fällig am 25.11.2035 ^	1.760	1.445	0,00	0,00	5,650 % fällig am 25.08.2037	2.870	2.620	0,01	0,01
3,688 % fällig am 25.09.2035 ^	292	197	0,00	0,00	3,927 % fällig am 25.05.2036	1.337	1.103	0,00	0,00	5,670 % fällig am 25.02.2046 ^	8.731	7.737	0,01	0,01
3,695 % fällig am 25.07.2036	3.383	2.408	0,00	0,00	3,937 % fällig am 25.08.2035	613	609	0,00	0,00	6,050 % fällig am 25.08.2047 ^	10.055	8.434	0,01	0,01
3,699 % fällig am 25.12.2035	3.421	2.596	0,01	0,01	3,942 % fällig am 25.05.2036	2.724	2.313	0,00	0,00	6,850 % fällig am 25.09.2047	1.464	1.266	0,00	0,00
3,747 % fällig am 25.06.2037 ^	6.312	4.383	0,01	0,01	3,954 % fällig am 25.05.2037 ^	382	333	0,00	0,00	London Wall Mortgage Capital PLC				
3,778 % fällig am 25.11.2035 ^	1.444	1.163	0,00	0,00	4,035 % fällig am 25.04.2036 ^	2.914	2.518	0,01	0,01	5,502 % fällig am 15.05.2052	£ 9.139	11.528	0,02	0,02
3,789 % fällig am 25.09.2036 ^	126	106	0,00	0,00	4,106 % fällig am 25.09.2035	353	322	0,00	0,00	Ludgate Funding PLC				
3,860 % fällig am 25.05.2035 ^	58	42	0,00	0,00	4,176 % fällig am 25.04.2035 ^	306	277	0,00	0,00	3,212 % fällig am 01.01.2061	€ 2.894	3.018	0,01	0,01
3,967 % fällig am 25.09.2037	12.865	9.737	0,02	0,02	4,177 % fällig am 25.08.2036	3.634	3.058	0,01	0,01	3,292 % fällig am 01.01.2061	792	795	0,00	0,00
4,335 % fällig am 25.08.2034	79	71	0,00	0,00	4,197 % fällig am 25.05.2037	1.418	1.246	0,00	0,00	3,362 % fällig am 01.01.2061	2.639	2.629	0,01	0,01
5,310 % fällig am 25.04.2037	944	820	0,00	0,00	4,274 % fällig am 25.06.2034	14	13	0,00	0,00	3,752 % fällig am 01.01.2061	10.687	11.141	0,02	0,02
5,340 % fällig am 25.04.2037	1.588	1.381	0,00	0,00	4,288 % fällig am 25.10.2037	2.429	1.915	0,00	0,00	3,764 % fällig am 01.01.2061	1.658	1.664	0,00	0,00
5,390 % fällig am 25.07.2036	4.540	4.281	0,01	0,01	4,700 % fällig am 25.07.2035	271	241	0,00	0,00	4,670 % fällig am 01.01.2061	£ 5.806	6.819	0,01	0,01
5,400 % fällig am 25.09.2037	4.245	3.981	0,01	0,01	5,500 % fällig am 25.07.2036	2.913	1.574	0,00	0,00	5,030 % fällig am 01.01.2061	3.653	4.446	0,01	0,01
5,410 % fällig am 25.10.2036	2.545	2.184	0,00	0,00	5,750 % fällig am 25.01.2036 ^	981	485	0,00	0,00	5,068 % fällig am 01.12.2060	961	1.161	0,00	0,00
5,490 % fällig am 25.01.2037 ^	7.984	6.721	0,01	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2037	2.646	1.437	0,00	0,00	5,178 % fällig am 01.12.2060	2.163	2.540	0,01	0,01
5,500 % fällig am 25.06.2036	2.769	2.161	0,00	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	4.858	2.839	0,01	0,01	Luminent Mortgage Trust				
5,510 % fällig am 25.08.2036	8.134	5.828	0,01	0,01	6,250 % fällig am 25.08.2037	5.086	1.593	0,00	0,00	5,430 % fällig am 25.01.2037 ^	\$ 2.367	1.955	0,00	0,00
5,510 % fällig am 25.02.2037 ^	5.732	5.102	0,01	0,01	6,500 % fällig am 25.01.2035	1.363	1.363	0,00	0,00	5,490 % fällig am 25.12.2036	2.884	2.950	0,01	0,01
5,510 % fällig am 25.07.2047	3.364	2.341	0,00	0,00	6,500 % fällig am 25.07.2036 ^	219	89	0,00	0,00	5,510 % fällig am 25.12.2036 ^	95	86	0,00	0,00
5,530 % fällig am 25.10.2036	5.079	2.153	0,00	0,00	6,500 % fällig am 25.08.2036	4.390	1.589	0,00	0,00	5,530 % fällig am 25.06.2046	876	733	0,00	0,00
5,550 % fällig am 25.06.2046	5.667	4.534	0,01	0,01	JPMorgan Resecuritization Trust					5,550 % fällig am 25.02.2046	1.757	1.338	0,00	0,00
5,550 % fällig am 25.11.2046	6.400	5.776	0,01	0,01	4,500 % fällig am 26.04.2037	1.389	679	0,00	0,00	Madison Avenue Mortgage Trust				
5,570 % fällig am 25.11.2036	155	144	0,00	0,00	4,716 % fällig am 26.09.2036	259	225	0,00	0,00	3,294 % fällig am 15.08.2034	8.074	7.430	0,01	0,01
5,570 % fällig am 25.02.2046	5.027	3.740	0,01	0,01	5,428 % fällig am 26.09.2037	1.292	969	0,00	0,00	Mansard Mortgages PLC				
5,570 % fällig am 25.04.2046	2.654	2.386	0,00	0,00	5,750 % fällig am 26.05.2037	127	57	0,00	0,00	4,765 % fällig am 15.04.2047	£ 1.980	2.423	0,01	0,01
5,570 % fällig am 25.05.2046	7.592	6.753	0,01	0,01	6,000 % fällig am 26.09.2036	515	398	0,00	0,00	6,251 % fällig am 15.12.2049	3.273	3.971	0,01	0,01
5,590 % fällig am 25.04.2046	382	344	0,00	0,00	Jupiter Mortgage PLC					7,001 % fällig am 15.12.2049	2.909	3.614	0,01	0,01
5,610 % fällig am 25.04.2035	271	237	0,00	0,00	5,891 % fällig am 20.07.2060	£ 5.900	7.480	0,01	0,01	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
5,650 % fällig am 25.11.2036	3.671	3.590	0,01	0,01	Kinbane DAC					3,234 % fällig am 25.02.2035	\$ 159	132	0,00	0,00
5,670 % fällig am 25.07.2035	5.781	4.102	0,01	0,01	4,263 % fällig am 25.09.2062	€ 42.653	46.173	0,07	0,07	3,352 % fällig am 01.01.2061	479	408	0,00	0,00
5,690 % fällig am 25.10.2036	2.069	885	0,00	0,00	Kirkby RMBS PLC					3,515 % fällig am 25.03.2035	100	89	0,00	0,00
5,730 % fällig am 25.01.2036	3.007	2.055	0,00	0,00	0,000 % fällig am 22.02.2045	£ 1	2.645	0,01	0,01	3,904 % fällig am 25.03.2035	51	39	0,00	0,00
5,750 % fällig am 25.07.2035	1.092	889	0,00	0,00	2,250 % fällig am 22.02.2045	4.258	1.085	0,00	0,00	4,267 % fällig am 25.09.2034	818	724	0,00	0,00
5,930 % fällig am 25.12.2034	780	618	0,00	0,00	5,668 % fällig am 22.02.2045	27.490	33.693	0,05	0,05	6,250 % fällig am 25.05.2046	7.382	3.208	0,01	0,01
5,950 % fällig am 25.07.2046	4.658	4.090	0,01	0,01	6,868 % fällig am 22.02.2045	13.150	15.441	0,03	0,03	7,480 % fällig am 25.12.2035	805	789	0,00	0,00
5,970 % fällig am 25.11.2034 ^	1.011	872	0,00	0,00	Landmark Mortgage Securities PLC					MASTR Alternative Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	680	501	0,00	0,00	3,767 % fällig am 17.06.2038	€ 12	13	0,00	0,00	5,500 % fällig am 25.04.2035	2.290	2.125	0,00	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	195	81	0,00	0,00	5,222 % fällig am 17.06.2039	£ 5.590	6.838	0,01	0,01	5,750 % fällig am 25.08.2035 ^	1.341	727	0,00	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037	782	333	0,00	0,00	5,242 % fällig am 17.06.2038	21	27	0,00	0,00	6,500 % fällig am 25.05.2034	64	61	0,00	0,00
6,010 % fällig am 25.09.2034	44	37	0,00	0,00	Lanebrook Mortgage Transaction PLC					MASTR Asset Securitization Trust				
6,500 % fällig am 25.07.2037 ^	370	123	0,00	0,00	5,965 % fällig am 12.06.2057	15.511	19.750	0,03	0,03	5,000 % fällig am 25.07.2019	0	0	0,00	0,00
6,500 % fällig am 25.09.2037 ^	1.783	1.086	0,00	0,00	Lansdowne Mortgage Securities PLC					6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	164	107	0,00	0,00
6,500 % fällig am 25.10.2037	2.701	1.489	0,00	0,00	3,826 % fällig am 15.06.2045	€ 3.155	3.234	0,01	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	1.600			

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
4,674 % fällig am 25.12.2035	\$ 24	\$ 22	0,00	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				5,091 % fällig am 25.11.2037	\$ 446	\$ 372	0,00
4,674 % fällig am 25.12.2035	1.909	1.821	0,00	4,880 % fällig am 25.06.2036	\$ 272	206	0,00	5,336 % fällig am 25.09.2045	428	384	0,00
5,610 % fällig am 25.04.2029	425	393	0,00	5,034 % fällig am 25.05.2035	1.587	812	0,00	5,350 % fällig am 25.05.2037	100	88	0,00
5,810 % fällig am 25.06.2028	0	0	0,00	5,400 % fällig am 25.06.2037	613	530	0,00	5,400 % fällig am 25.03.2037 ^	2.069	1.472	0,00
5,810 % fällig am 25.09.2029	13	12	0,00	5,689 % fällig am 25.03.2047	821	731	0,00	5,450 % fällig am 25.08.2035	145	110	0,00
5,975 % fällig am 25.11.2029	2.952	2.732	0,01	5,670 % fällig am 25.12.2035	775	217	0,00	5,450 % fällig am 25.12.2036	3.574	2.360	0,00
5,975 % fällig am 25.11.2029	666	580	0,00	5,688 % fällig am 25.07.2035	461	441	0,00	5,450 % fällig am 25.06.2037 ^	1.020	907	0,00
5,997 % fällig am 25.09.2029	105	97	0,00	5,995 % fällig am 25.03.2047	1.510	1.344	0,00	5,450 % fällig am 25.02.2047	1.474	1.296	0,00
6,095 % fällig am 25.08.2036	1.810	1.611	0,00	6,150 % fällig am 25.05.2035	1.292	1.044	0,00	5,470 % fällig am 25.01.2037	4.671	4.045	0,01
Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust				6,170 % fällig am 25.08.2034	349	324	0,00	5,476 % fällig am 25.08.2035	1.594	1.316	0,00
7,620 % fällig am 25.08.2036 ^	1.605	1.422	0,00	6,408 % fällig am 25.05.2036 ^	732	165	0,00	5,490 % fällig am 25.12.2036	2.347	2.242	0,00
Melife Securitization Trust				6,772 % fällig am 25.02.2036 ^	35	30	0,00	5,490 % fällig am 25.01.2037	1.946	1.604	0,00
3,750 % fällig am 25.03.2057	5.018	4.702	0,01	Nomura Resecuritization Trust				5,500 % fällig am 25.06.2035 ^	911	750	0,00
Miravet SARL				1,893 % fällig am 26.03.2037	2.382	1.946	0,00	5,500 % fällig am 25.07.2035 ^	1.395	1.135	0,00
4,265 % fällig am 26.05.2065	€ 34.623	37.192	0,06	6,050 % fällig am 25.07.2036	21.897	20.752	0,03	5,500 % fällig am 25.02.2036	571	453	0,00
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust				NovoStar Mortgage Funding Trust				5,500 % fällig am 25.12.2036	2.059	1.432	0,00
1,063 % fällig am 15.02.2047				0,440 % fällig am 25.09.2046	11.514	4.030	0,01	5,510 % fällig am 25.07.2036	985	853	0,00
(a)				OBX Trust				5,510 % fällig am 25.05.2047	5.771	2.418	0,00
3,046 % fällig am 15.04.2048	\$ 3.767	5	0,00	5,800 % fällig am 25.06.2057	1.853	1.758	0,00	5,510 % fällig am 25.01.2037 ^	1.909	1.271	0,00
3,750 % fällig am 15.07.2035	40.000	38.013	0,06	6,000 % fällig am 25.04.2048	482	478	0,00	5,530 % fällig am 25.07.2036	1.282	1.112	0,00
Morgan Stanley Capital Trust				Paragon Mortgages PLC				5,530 % fällig am 25.09.2036 ^	1.765	1.631	0,00
7,143 % fällig am 25.10.2035	34.709	33.910	0,05	5,752 % fällig am 15.05.2045	5.383	6.848	0,01	5,530 % fällig am 25.12.2036	1.423	1.245	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				Pepper Residential Securities Trust				5,530 % fällig am 25.07.2037	4.123	3.788	0,01
2,120 % fällig am 25.06.2037	3.848	2.022	0,00	6,057 % fällig am 18.11.2060	\$ 1.886	1.885	0,00	5,530 % fällig am 25.08.2036 ^	923	821	0,00
3,103 % fällig am 25.11.2037	6.533	4.327	0,01	PHH Alternative Mortgage Trust				5,550 % fällig am 25.05.2037 ^	146	108	0,00
3,108 % fällig am 25.11.2037 ^	91	59	0,00	5,470 % fällig am 25.02.2037	4.170	3.137	0,01	5,550 % fällig am 25.06.2037 ^	3.019	2.132	0,00
4,148 % fällig am 25.03.2036 ^	39	25	0,00	5,630 % fällig am 25.05.2037	2.025	1.859	0,00	5,580 % fällig am 25.05.2046	2.997	2.602	0,01
4,183 % fällig am 25.10.2037	661	451	0,00	5,850 % fällig am 25.07.2037	902	864	0,00	5,690 % fällig am 25.02.2046 ^	72	46	0,00
4,271 % fällig am 25.05.2036 ^	1.728	1.015	0,00	Pierpont BTL PLC				5,690 % fällig am 25.05.2046 ^	2.701	2.156	0,00
4,614 % fällig am 25.08.2034	25	23	0,00	0,000 % fällig am 21.09.2054	£ 9.850	12.493	0,02	5,750 % fällig am 25.04.2036	2.013	1.709	0,00
5,470 % fällig am 25.06.2036	3.592	757	0,00	Polaris PLC				5,750 % fällig am 25.01.2037	1.531	1.154	0,00
5,490 % fällig am 25.08.2036	5.913	1.732	0,00	5,631 % fällig am 23.12.2058	3.631	4.595	0,01	5,750 % fällig am 25.03.2037 ^	4.563	3.401	0,01
5,600 % fällig am 25.10.2037 ^	312	268	0,00	6,154 % fällig am 27.05.2057	13.782	17.537	0,03	6,000 % fällig am 25.01.2037	2.092	1.824	0,00
5,680 % fällig am 25.02.2047	7.306	3.065	0,01	7,490 % fällig am 23.05.2059	2.768	3.544	0,01	6,000 % fällig am 25.12.2035	966	869	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036 ^	468	410	0,00	Precise Mortgage Funding PLC				6,000 % fällig am 25.04.2036	1.013	816	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2035	2.598	1.081	0,00	0,000 % fällig am 12.12.2055				6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	464	362	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^	2.305	1.585	0,00	(f)				6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	2.423	1.933	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036	1.211	567	0,00	5,657 % fällig am 16.10.2056	10.057	12.769	0,02	6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	214	166	0,00
6,000 % fällig am 25.10.2037 ^	2.943	1.774	0,00	6,004 % fällig am 12.03.2055	3.983	5.069	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2036 ^	278	213	0,00
6,000 % fällig am 25.10.2037	7.806	4.235	0,01	6,177 % fällig am 16.10.2056	1.200	1.517	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2036 ^	125	100	0,00
6,115 % fällig am 25.06.2036	1.086	1.068	0,00	6,427 % fällig am 16.10.2056	1.000	1.261	0,00	6,000 % fällig am 25.09.2036 ^	4.948	4.039	0,01
6,275 % fällig am 25.09.2035	1.224	2.045	0,00	6,677 % fällig am 16.10.2056	1.000	1.246	0,00	6,000 % fällig am 25.09.2036 ^	882	666	0,00
6,354 % fällig am 25.08.2036 ^	1.277	255	0,00	7,827 % fällig am 16.10.2056	1.000	1.234	0,00	6,000 % fällig am 25.11.2036 ^	183	143	0,00
6,500 % fällig am 25.02.2036 ^	100	46	0,00	Prime Mortgage Trust				6,000 % fällig am 25.01.2037	435	333	0,00
6,875 % fällig am 25.11.2035	1.855	1.765	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	\$ 9	9	0,00	6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	3.422	2.649	0,01
7,130 % fällig am 25.09.2035	1.029	990	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2036 ^				6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	415	342	0,00
Morgan Stanley Re-REMIC Trust				6,000 % fällig am 25.04.2037 ^				6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	352	274	0,00
3,768 % fällig am 26.12.2036	2.461	2.120	0,00	Primrose Residential DAC				6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	309	250	0,00
Morgan Stanley Resecuritization Trust				4,189 % fällig am 24.03.2061	€ 3.845	4.167	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	443	345	0,00
3,644 % fällig am 26.06.2047	5.669	4.484	0,01	4,439 % fällig am 24.10.2061	30.249	32.690	0,05	6,108 % fällig am 25.02.2036 ^	1.906	1.540	0,00
3,693 % fällig am 26.11.2046	3.074	2.628	0,01	Proteus RMBS DAC				6,250 % fällig am 25.01.2037 ^	113	92	0,00
Mortgage Equity Conversion Asset Trust				0,000 % fällig am 29.10.2054	13.990	12.417	0,02	6,250 % fällig am 25.02.2037 ^	2.769	2.264	0,00
5,720 % fällig am 25.02.2042	5.896	5.694	0,01	(b)(f)				6,500 % fällig am 25.09.2036 ^	480	242	0,00
Mortgage Funding PLC				0,000 % fällig am 29.10.2054	200	0	0,00	6,500 % fällig am 25.11.2036 ^	424	186	0,00
6,090 % fällig am 13.03.2046	£ 7.619	9.619	0,02	4,150 % fällig am 29.10.2054	47.658	52.344	0,08	6,500 % fällig am 25.02.2037	4.729	3.928	0,01
MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust				4,600 % fällig am 29.10.2054	6.681	9.443	0,02	6,750 % fällig am 25.06.2037	896	374	0,00
5,610 % fällig am 25.06.2047	\$ 8.151	6.629	0,01	4,900 % fällig am 29.10.2054	6.313	6.867	0,01	Residential Asset Securitization Trust			
5,650 % fällig am 25.09.2037	3.379	2.932	0,01	5,880 % fällig am 29.10.2054	4.735	5.181	0,01	5,500 % fällig am 25.08.2034	820	788	0,00
MortgageIT Trust				7,750 % fällig am 29.10.2054	3.946	4.335	0,01	5,500 % fällig am 25.09.2035	2.630	1.355	0,00
5,710 % fällig am 25.10.2035	138	135	0,00	RBSCG Mortgage Loan Trust				5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	117	57	0,00
5,750 % fällig am 25.08.2035	1.653	1.573	0,00	5,600 % fällig am 25.01.2037 ^	\$ 530	175	0,00	5,750 % fällig am 25.02.2036	1.314	1.213	0,00
5,770 % fällig am 25.12.2035	1.614	1.536	0,00	RBSCG Structured Trust				6,000 % fällig am 25.07.2035 ^	1.356	928	0,00
6,005 % fällig am 25.02.2035	350	328	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	65	54	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2036	17.182	7.777	0,01
6,420 % fällig am 25.02.2035	2	2	0,00	RBSP Resecuritization Trust				6,000 % fällig am 25.04.2036 ^	430	190	0,00
MSDB Trust				3,514 % fällig am 26.01.2036	5.097	4.550	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2036	2.456	1.203	0,00
3,427 % fällig am 11.07.2039	1.600	1.364	0,00	3,768 % fällig am 26.12.2036	3.143	2.966	0,01	6,000 % fällig am 25.09.2036 ^	3.965	1.733	0,00
MSSG Trust				5,378 % fällig am 27.06.2036	2.100	1.662	0,00	6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	7.160	2.373	0,00
3,397 % fällig am 13.09.2039	9.550	8.071	0,01	6,000 % fällig am 26.05.2036	1.499	666	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	9.900	3.146	0,01
New Century Alternative Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 26.08.2037	567	472	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	587	342	0,00
4,654 % fällig am 25.10.2036 ^	6.280	1.292	0,00	12,418 % fällig am 26.10.2037	2.098	1.816	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	500	284	0,00
6,810 % fällig am 25.07.2036	3.271	783	0,00	Residential Accredit Loans, Inc. Trust				6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	1.077	467	0,00
1,400 % fällig am 25.12.2036				(a)				6,000 % fällig am 25.08.2037	2.324	1.328	0,00
New Century Home Equity Loan Trust				1,490 % fällig am 25.01.2037	1.930	206	0,00	6,000 % fällig am 25.01.2046	1.504	650	0,00
3,750 % fällig am 25.08.2055	4.779	4.425	0,01	(a)				6,000 % fällig am 25.01.2046 ^	870	378	0,00
New Residential Mortgage Loan Trust				1,500 % fällig am 25.12.2036	1.919	185	0,00	6,250 % fällig am 25.08.2036	1.234	856	0,00
4,500 % fällig am 25.05.2058	16.288	15.555	0,03	(a)							



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
3,860 % fällig am 25.06.2035	\$ 251	\$ 143	0,00	4,348 % fällig am 25.11.2035	\$ 48	\$ 35	0,00	5,891 % fällig am 20.10.2051	£ 4.000	\$ 5.019	0,01
4,112 % fällig am 25.04.2037	145	84	0,00	4,472 % fällig am 25.05.2036	855	636	0,00	6,097 % fällig am 20.05.2045	51.349	65.094	0,10
4,115 % fällig am 25.09.2036 ^	89	46	0,00	4,508 % fällig am 25.11.2037 ^	324	271	0,00	6,216 % fällig am 20.02.2045	15.162	19.242	0,03
4,149 % fällig am 25.09.2035 ^	2.159	1.397	0,00	4,556 % fällig am 25.11.2037 ^	200	141	0,00	6,541 % fällig am 20.10.2051	13.500	16.776	0,03
4,500 % fällig am 25.10.2018	13	5	0,00	4,892 % fällig am 25.01.2035	204	189	0,00	6,546 % fällig am 20.02.2054	34.671	44.091	0,07
4,573 % fällig am 25.04.2037	87	69	0,00	5,227 % fällig am 25.09.2034	2	2	0,00	6,991 % fällig am 20.10.2051	4.500	5.567	0,01
4,573 % fällig am 25.04.2037 ^	340	263	0,00	5,348 % fällig am 25.04.2036	322	269	0,00	<b>Towd Point Mortgage Trust</b>			
4,978 % fällig am 27.07.2037 ^	399	329	0,00	5,375 % fällig am 25.02.2035	2.648	2.528	0,01	2,750 % fällig am 25.06.2057	\$ 6.150	5.802	0,01
5,224 % fällig am 25.09.2036 ^	1.150	807	0,00	5,450 % fällig am 25.09.2034	311	279	0,00	2,750 % fällig am 25.10.2057	10.062	9.555	0,02
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	263	219	0,00	5,462 % fällig am 25.01.2035	49	45	0,00	3,750 % fällig am 25.04.2055	6.605	6.236	0,01
6,000 % fällig am 25.07.2036 ^	190	158	0,00	5,470 % fällig am 25.01.2037	2.009	1.725	0,00	<b>Tower Bridge Funding PLC</b>			
6,000 % fällig am 25.09.2036	758	569	0,00	5,570 % fällig am 25.10.2035	1.999	1.831	0,00	5,629 % fällig am 20.12.2063	£ 3.906	4.944	0,01
6,250 % fällig am 25.08.2036	1.269	1.056	0,00	5,590 % fällig am 25.05.2037	781	688	0,00	5,847 % fällig am 20.11.2063	1.500	1.879	0,00
<b>Residential Mortgage Securities PLC</b>				5,630 % fällig am 25.05.2037 ^	1.423	1.244	0,00	<b>Trinidad Mortgage Securities PLC</b>			
6,159 % fällig am 20.06.2070	£ 10.820	13.799	0,02	5,700 % fällig am 25.09.2034	4.336	3.747	0,01	5,443 % fällig am 24.01.2059	1.930	2.453	0,00
6,809 % fällig am 20.06.2070	1.355	1.723	0,00	5,773 % fällig am 25.10.2035 ^	88	78	0,00	<b>Trinity Square PLC</b>			
<b>RESIMAC Bastille Trust</b>				6,063 % fällig am 25.12.2034	17	17	0,00	5,866 % fällig am 15.07.2059	34.300	43.367	0,07
5,190 % fällig am 05.09.2057	AUD 11.771	7.835	0,01	6,125 % fällig am 25.08.2035	1.736	1.538	0,00	6,166 % fällig am 15.07.2059	12.400	15.629	0,03
<b>RESIMAC Premier</b>				<b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>				6,466 % fällig am 15.07.2059	9.600	11.986	0,02
5,350 % fällig am 07.02.2052	5.758	3.836	0,01	3,363 % fällig am 19.10.2034	295	247	0,00	7,216 % fällig am 15.07.2059	5.700	7.110	0,01
6,241 % fällig am 07.02.2052	\$ 1.675	1.674	0,00	3,547 % fällig am 25.05.2047 ^	3.128	2.574	0,01	<b>Tudor Rose Mortgages</b>			
<b>Resloc UK PLC</b>				3,992 % fällig am 27.12.2035 ^	43	42	0,00	5,509 % fällig am 20.06.2048	6.744	8.527	0,01
5,221 % fällig am 15.12.2043	£ 2.380	2.851	0,01	5,270 % fällig am 25.08.2036	9.279	8.057	0,01	<b>Twin Bridges PLC</b>			
5,250 % fällig am 15.12.2043	\$ 11.861	11.209	0,02	5,270 % fällig am 25.10.2036	4.015	3.529	0,01	0,000 % fällig am 14.06.2055	38.700	49.050	0,08
<b>Ripon Mortgages PLC</b>				5,320 % fällig am 25.02.2036	2.057	1.713	0,00	6,115 % fällig am 12.12.2054	23.543	29.994	0,05
5,491 % fällig am 28.08.2056	£ 466.608	591.116	0,92	5,330 % fällig am 25.01.2037	2.095	1.861	0,00	6,865 % fällig am 12.06.2055	5.819	7.401	0,01
<b>River Green Finance DAC</b>				5,330 % fällig am 25.09.2047	194	176	0,00	<b>Uropa Securities PLC</b>			
3,911 % fällig am 22.01.2032	€ 13.255	13.926	0,02	5,370 % fällig am 25.09.2047	9.558	7.974	0,01	3,255 % fällig am 10.10.2040	€ 6.136	6.433	0,01
<b>RiverView HECM Trust</b>				5,376 % fällig am 25.12.2035 ^	1.285	1.044	0,00	4,879 % fällig am 10.10.2040	£ 6.899	8.287	0,01
5,420 % fällig am 25.05.2047	\$ 4.329	4.116	0,01	5,470 % fällig am 25.01.2037	3.222	2.845	0,01	<b>Verus Securitization Trust</b>			
<b>RMAC Securities PLC</b>				5,510 % fällig am 25.07.2046	4.040	3.363	0,01	1,977 % fällig am 25.03.2060	\$ 439	428	0,00
3,636 % fällig am 12.06.2044	€ 1.850	1.938	0,00	5,550 % fällig am 25.02.2036	312	246	0,00	3,035 % fällig am 25.03.2060	700	666	0,00
3,726 % fällig am 12.06.2044	5.884	6.021	0,01	5,570 % fällig am 25.09.2036	2.498	1.684	0,00	3,889 % fällig am 25.03.2060	1.000	942	0,00
3,756 % fällig am 12.06.2044	1.736	1.770	0,00	5,570 % fällig am 25.09.2047 ^	13.432	11.125	0,02	<b>Wachovia Mortgage Loan Trust</b>			
3,956 % fällig am 12.06.2044	5.852	5.945	0,01	5,590 % fällig am 25.05.2036	10.208	8.186	0,01	1,560 % fällig am 25.01.2037	2.082	800	0,00
5,134 % fällig am 12.06.2044	£ 1.652	2.015	0,00	5,610 % fällig am 25.02.2036 ^	1.221	1.066	0,00	1,679 % fällig am 25.08.2036	1.309	468	0,00
5,154 % fällig am 12.06.2044	21.728	26.432	0,04	5,610 % fällig am 25.05.2045	54	49	0,00	<b>Wachovia Mortgage Loan Trust LLC</b>			
5,414 % fällig am 12.06.2044	753	901	0,00	5,626 % fällig am 19.04.2035	3	3	0,00	4,291 % fällig am 20.10.2035 ^	218	205	0,00
5,502 % fällig am 12.06.2044	\$ 292	280	0,00	5,646 % fällig am 19.07.2035	36	33	0,00	4,654 % fällig am 20.08.2035 ^	138	132	0,00
5,814 % fällig am 12.06.2044	£ 1.426	1.630	0,00	5,700 % fällig am 25.09.2047 ^	5.275	4.332	0,01	<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>			
<b>Rochester Financing PLC</b>				5,710 % fällig am 25.02.2036 ^	79	67	0,00	3,053 % fällig am 25.01.2037 ^	797	667	0,00
5,602 % fällig am 18.12.2044	2.308	2.900	0,01	5,746 % fällig am 19.07.2034	508	455	0,00	3,307 % fällig am 25.01.2037 ^	2.688	2.363	0,00
<b>Roundstone Securities DAC</b>				5,750 % fällig am 25.08.2036 ^	6.458	4.585	0,01	3,342 % fällig am 25.11.2036 ^	3.085	2.655	0,01
0,000 % fällig am 28.09.2055	€ 19.776	17.901	0,03	5,846 % fällig am 19.12.2034	129	115	0,00	3,435 % fällig am 25.12.2036 ^	665	581	0,00
1,000 % fällig am 28.09.2055	3.941	3.995	0,01	6,271 % fällig am 19.12.2033	352	331	0,00	3,472 % fällig am 25.03.2037 ^	985	784	0,00
4,177 % fällig am 28.09.2055	114.649	124.810	0,19	<b>Structured Asset Securities Corp.</b>				3,528 % fällig am 25.12.2036 ^	6.304	5.546	0,01
4,327 % fällig am 28.09.2055	15.538	16.864	0,03	5,400 % fällig am 25.07.2035	1.791	1.626	0,00	3,626 % fällig am 25.09.2036	4.019	3.490	0,01
4,577 % fällig am 28.09.2055	10.594	11.481	0,02	<b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>				3,630 % fällig am 25.09.2036 ^	114	93	0,00
5,077 % fällig am 28.09.2055	6.356	6.876	0,01	5,400 % fällig am 25.05.2036	1.986	1.601	0,00	3,633 % fällig am 25.12.2036	506	438	0,00
5,827 % fällig am 28.09.2055	10.594	11.408	0,02	<b>SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>				3,633 % fällig am 25.12.2036 ^	208	180	0,00
<b>Sequoia Mortgage Trust</b>				3,732 % fällig am 25.10.2037 ^	626	552	0,00	3,651 % fällig am 25.02.2037 ^	1.466	1.273	0,00
3,723 % fällig am 20.07.2037	\$ 1.460	1.180	0,00	4,167 % fällig am 25.06.2037	1.023	939	0,00	3,669 % fällig am 25.02.2037 ^	3.835	3.469	0,01
4,015 % fällig am 20.06.2037 ^	3.345	2.735	0,01	<b>TBW Mortgage-Backed Trust</b>				3,693 % fällig am 25.08.2046 ^	912	819	0,00
5,477 % fällig am 20.11.2034	656	604	0,00	5,500 % fällig am 25.07.2036 ^	10	1	0,00	3,753 % fällig am 25.02.2037 ^	8.415	7.699	0,01
5,708 % fällig am 20.02.2034	240	214	0,00	5,965 % fällig am 25.07.2037	3.683	1.177	0,00	3,772 % fällig am 25.02.2037 ^	1.716	1.540	0,00
<b>Sestante Finance SRL</b>				6,450 % fällig am 25.03.2037	13.360	3.242	0,01	3,781 % fällig am 25.08.2046 ^	186	162	0,00
3,431 % fällig am 23.07.2046	€ 15.709	16.223	0,03	<b>TDA Mixto Fondo de Titulizacion de Activos</b>				3,781 % fällig am 25.08.2046 ^	285	254	0,00
<b>Shamrock Residential DAC</b>				3,767 % fällig am 22.06.2040	€ 6.051	6.083	0,01	3,784 % fällig am 25.06.2037 ^	1.515	1.331	0,00
4,289 % fällig am 24.12.2059	25.205	27.231	0,04	<b>Temple Quay PLC</b>				3,809 % fällig am 25.07.2037 ^	4.569	4.219	0,01
4,289 % fällig am 24.01.2061	43.992	47.491	0,07	6,524 % fällig am 24.07.2085	£ 15.905	19.977	0,03	3,816 % fällig am 25.10.2036 ^	2.700	2.448	0,00
4,439 % fällig am 24.06.2071	30.157	32.573	0,05	7,524 % fällig am 24.07.2085	14.681	18.443	0,03	3,816 % fällig am 25.10.2036	1.437	1.303	0,00
4,689 % fällig am 24.02.2071	43.377	47.055	0,07	<b>Terwin Mortgage Trust</b>				3,823 % fällig am 27.02.2034	8	7	0,00
<b>Stratton BTL Mortgage Funding PLC</b>				4,124 % fällig am 25.10.2037	\$ 5.309	1.971	0,00	3,824 % fällig am 25.06.2037 ^	1.305	1.157	0,00
5,221 % fällig am 20.01.2054	£ 23.789	30.088	0,05	<b>Tharaldson Hotel Portfolio Trust</b>				3,894 % fällig am 25.05.2037 ^	1.139	949	0,00
<b>Stratton Hawkmoor PLC</b>				6,591 % fällig am 11.11.2034	27.138	26.715	0,04	3,900 % fällig am 25.12.2035	5.435	5.144	0,01
6,266 % fällig am 25.02.2053	63.113	79.524	0,12	6,841 % fällig am 11.11.2034	13.609	13.296	0,02	3,913 % fällig am 25.04.2035	1.426	1.352	0,00
6,516 % fällig am 25.02.2053	37.882	47.096	0,07	7,491 % fällig am 11.11.2034	25.064	24.306	0,04	3,923 % fällig am 25.05.2037	1.403	1.189	0,00
6,766 % fällig am 25.02.2053	29.847	36.476	0,06	<b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>				4,003 % fällig am 25.06.2037 ^	941	856	0,00
<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>				2,553 % fällig am 25.03.2044	686	668	0,00	4,008 % fällig am 25.12.2046 ^	5.187	4.443	0,01
5,391 % fällig am 20.07.2060	96.944	123.261	0,19	3,002 % fällig am 25.04.2036	927	841	0,00	4,008 % fällig am 25.12.2046	1.877	1.667	0,00
5,765 % fällig am 12.03.2052	12.568	15.923	0,03	3,018 % fällig am 25.09.2037	464	452	0,00	4,029 % fällig am 25.08.2036 ^	172	144	0,00
5,792 % fällig am 25.09.2051	28.847	36.590	0,06	3,114 % fällig am 25.09.2037	1.167	1.134	0,00	4,029 % fällig am 25.08.2036 ^	642	550	0,00
5,991 % fällig am 20.07.2060	9.236	11.692	0,02	3,442 % fällig am 25.10.2046	47	44	0,00	4,079 % fällig am 25.03.2035	2.002	1.940	0,00
<b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>				3,889 % fällig am 25.07.2036	1.375	1.139	0,00	4,081 % fällig am 25.07.2037 ^	3.734	3.489	0,01
3,663 % fällig am 25.10.2036	\$ 2.095	1.881	0,00	7,151 % fällig am 25.06.2037	105	90	0,00	4,156 % fällig am 25.03.2037	115	105	0,00
4,045 % fällig am 25.07.2035 ^	663	569	0,00	<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>				4,198 % fällig am 25.01.2035	1.774	1.626	0,00
4,200 % fällig am 25.02.2036 ^	2.975	2.407	0,00	5,161 % fällig am 20.10.2051	£ 16.600	20.891	0,03	4,404 % fällig am 25.05.2046	42	36	0,00
4,237 % fällig am 25.07.2035 ^	172	1									

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS
4,746 % fällig am 25.04.2047 ^	\$ 1.748	\$ 1.485	0,00	4,716 % fällig am 25.09.2036 ^	\$ 1.112	\$ 1.070	0,00	4,261 % fällig am 25.07.2034	\$ 318	\$ 316	0,00
4,746 % fällig am 25.05.2047	4.493	3.640	0,01	4,890 % fällig am 25.08.2036 ^	1.036	970	0,00	4,684 % fällig am 25.12.2033	285	267	0,00
4,756 % fällig am 25.07.2034	187	114	0,00	5,500 % fällig am 25.12.2021	1	1	0,00	5,825 % fällig am 25.01.2036	9.847	9.647	0,02
4,774 % fällig am 25.07.2047 ^	1.535	1.332	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	796	698	0,00	5,855 % fällig am 25.01.2036	1.026	1.020	0,00
4,786 % fällig am 25.07.2047	12.338	10.065	0,02	Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust				5,900 % fällig am 25.01.2036	5.050	4.855	0,01
4,856 % fällig am 25.10.2046 ^	6.169	5.299	0,01	0,628 % fällig am 15.03.2047 (a)	83.200	280	0,00	5,915 % fällig am 25.10.2035	330	328	0,00
4,896 % fällig am 25.09.2046 ^	3.108	2.761	0,01	0,772 % fällig am 15.03.2047 (a)	65.193	157	0,00	5,945 % fällig am 25.03.2035	58	57	0,00
4,966 % fällig am 25.06.2046	1.651	1.461	0,00	Worldwide Plaza Trust				6,020 % fällig am 25.11.2035	6.710	6.222	0,01
4,976 % fällig am 25.02.2046	2.461	2.197	0,00	3,715 % fällig am 10.11.2036	62.600	40.697	0,06	6,080 % fällig am 25.05.2035	1.966	1.929	0,00
5,024 % fällig am 25.08.2046	2.201	1.814	0,00					6,110 % fällig am 25.10.2035	6.196	5.550	0,01
5,226 % fällig am 25.01.2047	4.863	4.382	0,01					6,125 % fällig am 25.05.2035	2.000	1.895	0,00
5,476 % fällig am 25.09.2046	2.281	2.140	0,00					6,125 % fällig am 25.07.2035	11.155	10.325	0,02
5,476 % fällig am 25.10.2046	1.967	1.779	0,00					6,125 % fällig am 25.09.2035	5.750	4.612	0,01
5,476 % fällig am 25.11.2046	1.779	1.569	0,00	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				6,170 % fällig am 25.09.2034	258	251	0,00
5,690 % fällig am 25.07.2045	533	506	0,00	Aaees Mortgage Investment Trust				6,170 % fällig am 25.01.2035 ^	2.011	1.797	0,00
5,770 % fällig am 25.01.2045	827	812	0,00	5,930 % fällig am 25.10.2035	9.464	9.283	0,02	6,200 % fällig am 25.05.2035	1.961	1.765	0,00
5,850 % fällig am 25.12.2045	1.531	1.389	0,00	AccessLex Institute				6,245 % fällig am 25.09.2034	3.520	3.142	0,01
5,870 % fällig am 25.10.2045	114	107	0,00	5,344 % fällig am 26.09.2033	4.695	4.524	0,01	6,710 % fällig am 25.01.2035	1.591	1.314	0,00
5,890 % fällig am 25.01.2045	2.012	1.983	0,00	Accredited Mortgage Loan Trust				6,800 % fällig am 25.11.2034	2.642	2.367	0,00
5,950 % fällig am 25.06.2044	116	107	0,00	5,370 % fällig am 25.02.2037	1.000	944	0,00	6,875 % fällig am 25.08.2035	2.000	1.705	0,00
6,050 % fällig am 25.10.2045	7.311	6.085	0,01	5,410 % fällig am 25.09.2036	4.948	4.868	0,01	7,025 % fällig am 25.07.2034	1.546	1.476	0,00
6,130 % fällig am 25.10.2045	354	333	0,00	5,420 % fällig am 25.09.2036	12.235	11.240	0,02	7,910 % fällig am 25.05.2034	1.323	1.140	0,00
6,150 % fällig am 25.12.2045	5.907	5.754	0,01	5,420 % fällig am 25.02.2037	9.754	8.183	0,01	Ares European CLO DAC			
6,170 % fällig am 25.08.2045	4.180	3.972	0,01	5,610 % fällig am 25.12.2035 ^	13.735	9.716	0,02	3,787 % fällig am 15.04.2030	€ 1.967	2.105	0,00
Warwick Finance Residential Mortgages PLC				6,020 % fällig am 25.09.2035	5.921	5.415	0,01	4,127 % fällig am 25.10.2036	4.200	4.443	0,01
0,000 % fällig am 21.12.2049 (f)	£ 2	10.406	0,02	6,170 % fällig am 25.07.2035	2.496	2.311	0,00	4,325 % fällig am 21.10.2033	28.450	30.526	0,05
5,865 % fällig am 21.12.2049	59.121	74.806	0,12	6,230 % fällig am 25.10.2034	1.640	1.534	0,00	Argent Securities Trust			
5,933 % fällig am 21.03.2042	2.586	3.708	0,01	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				5,260 % fällig am 25.09.2036	\$ 13.789	4.544	0,01
5,964 % fällig am 21.12.2049	12.810	16.132	0,03	5,270 % fällig am 25.12.2036	10.754	5.736	0,01	5,370 % fällig am 25.05.2036	4.017	996	0,00
7,064 % fällig am 21.12.2049	6.405	8.023	0,01	5,320 % fällig am 25.11.2036	18.715	7.907	0,01	5,390 % fällig am 25.09.2036	10.806	3.561	0,01
7,564 % fällig am 21.12.2049	3.660	4.569	0,01	5,390 % fällig am 25.08.2036 ^	8.609	2.185	0,00	5,450 % fällig am 25.06.2036	15.555	10.180	0,02
8,064 % fällig am 21.12.2049	3.660	4.493	0,01	5,390 % fällig am 25.01.2037	1.171	690	0,00	5,450 % fällig am 25.07.2036	33.857	28.871	0,05
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				5,410 % fällig am 25.12.2036	25.726	14.122	0,02	5,470 % fällig am 25.05.2036	11.515	2.856	0,01
4,022 % fällig am 25.09.2036 ^	\$ 605	191	0,00	5,430 % fällig am 25.07.2036	5.237	4.736	0,01	5,500 % fällig am 25.04.2036	1.577	919	0,00
4,163 % fällig am 25.10.2036 ^	9.635	3.653	0,01	5,450 % fällig am 25.07.2036	32.762	12.178	0,02	5,530 % fällig am 25.03.2036	14.028	10.582	0,02
4,300 % fällig am 25.10.2036 ^	3.945	1.140	0,00	5,460 % fällig am 25.08.2036	5.166	4.897	0,01	5,690 % fällig am 25.05.2036	681	169	0,00
4,736 % fällig am 25.04.2047 ^	4.313	3.590	0,01	5,490 % fällig am 25.01.2037	3.838	2.261	0,00	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
4,806 % fällig am 25.11.2046	101	86	0,00	5,590 % fällig am 25.12.2036	197	69	0,00	5,620 % fällig am 25.01.2036	7.523	7.275	0,01
4,896 % fällig am 25.09.2046 ^	3.789	3.035	0,01	5,590 % fällig am 25.01.2037	10.616	2.706	0,00	5,630 % fällig am 25.05.2035	8.290	7.474	0,01
4,916 % fällig am 25.04.2046	3.989	3.361	0,01	5,630 % fällig am 25.04.2036	6.285	5.733	0,01	5,810 % fällig am 25.11.2035	9.420	9.055	0,01
4,916 % fällig am 25.07.2046 ^	6.098	3.812	0,01	5,630 % fällig am 25.07.2036	7.178	2.191	0,00	5,910 % fällig am 25.02.2036	12.641	9.661	0,02
4,936 % fällig am 25.08.2046	3.693	2.084	0,00	5,650 % fällig am 25.01.2037	1.171	690	0,00	5,915 % fällig am 25.10.2035	5.750	5.129	0,01
5,226 % fällig am 25.04.2047	17.753	14.995	0,02	5,710 % fällig am 25.06.2037	1.634	1.460	0,00	6,050 % fällig am 25.05.2034	313	257	0,00
5,470 % fällig am 25.02.2037 ^	718	545	0,00	5,750 % fällig am 25.02.2036	627	615	0,00	6,275 % fällig am 25.11.2034	2.801	2.746	0,01
5,500 % fällig am 25.05.2035 ^	3.093	2.438	0,00	5,765 % fällig am 25.12.2035	4.200	3.745	0,01	Asset-Backed Funding Certificates Trust			
5,500 % fällig am 25.07.2035 ^	958	863	0,00	5,810 % fällig am 25.11.2035	1.855	1.864	0,00	5,280 % fällig am 25.01.2037	493	343	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	53	47	0,00	5,840 % fällig am 25.05.2035	148	144	0,00	5,290 % fällig am 25.10.2036	842	769	0,00
5,500 % fällig am 25.02.2036 ^	88	76	0,00	6,050 % fällig am 25.12.2034	3.371	3.022	0,01	5,310 % fällig am 25.01.2037	11.141	6.465	0,01
5,530 % fällig am 25.06.2037	1.289	1.124	0,00	6,050 % fällig am 25.08.2035	3.311	3.182	0,01	5,370 % fällig am 25.10.2036	9.718	8.069	0,01
5,530 % fällig am 25.06.2037	407	372	0,00	6,095 % fällig am 25.05.2035	3.000	2.674	0,00	5,370 % fällig am 25.01.2037	3.672	2.135	0,00
5,670 % fällig am 25.12.2035	2.796	2.455	0,00	6,125 % fällig am 25.11.2033	694	665	0,00	5,430 % fällig am 25.11.2036	9.710	5.745	0,01
5,750 % fällig am 25.01.2036 ^	2.092	1.727	0,00	6,170 % fällig am 25.04.2035	1.215	1.165	0,00	5,450 % fällig am 25.05.2037	2.690	2.486	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036 ^	127	111	0,00	6,950 % fällig am 25.06.2034	4	4	0,00	5,570 % fällig am 25.09.2036 ^	6.390	5.668	0,01
6,000 % fällig am 25.11.2035 ^	2.310	2.198	0,00	Aegis Asset-Backed Securities Trust				5,810 % fällig am 25.03.2035	3.740	3.596	0,01
6,000 % fällig am 25.07.2036	4.432	3.306	0,01	5,320 % fällig am 25.01.2037	1.210	920	0,00	5,850 % fällig am 25.06.2034	2.921	2.839	0,01
6,000 % fällig am 25.04.2037	2.219	1.898	0,00	5,795 % fällig am 25.12.2035	3.690	3.313	0,01	5,930 % fällig am 25.11.2033	954	895	0,00
6,500 % fällig am 25.11.2035 ^	3.387	1.971	0,00	5,870 % fällig am 25.06.2035	2.462	2.290	0,00	6,050 % fällig am 25.02.2034	199	195	0,00
6,500 % fällig am 25.03.2036 ^	3.175	2.253	0,00	5,870 % fällig am 25.08.2035	751	722	0,00	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
6,812 % fällig am 25.07.2036 ^	10.797	2.808	0,01	5,900 % fällig am 25.03.2035	6.447	5.130	0,01	2,977 % fällig am 25.03.2036	2.345	1.888	0,00
6,949 % fällig am 25.07.2036 ^	1.963	510	0,00	Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				2,977 % fällig am 25.03.2036	58	55	0,00
7,000 % fällig am 25.02.2036	2.674	2.051	0,00	6,875 % fällig am 25.10.2034	1.719	1.696	0,00	3,240 % fällig am 25.03.2036	1.062	901	0,00
7,000 % fällig am 25.05.2036 ^	3.021	2.546	0,01	ALESCO Preferred Funding Ltd.				3,500 % fällig am 25.12.2036	2.161	2.059	0,00
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust				5,820 % fällig am 23.12.2037	27.732	25.375	0,04	3,688 % fällig am 25.12.2036	3.771	3.375	0,01
4,192 % fällig am 25.01.2035	182	163	0,00	5,860 % fällig am 23.09.2037	7.010	6.099	0,01	5,495 % fällig am 25.11.2036	5.531	5.112	0,01
Wells Fargo Alternative Loan Trust				5,900 % fällig am 23.06.2036	17.016	15.654	0,03	5,960 % fällig am 25.06.2034	815	773	0,00
0,920 % fällig am 25.06.2037 (a)	798	57	0,00	5,920 % fällig am 23.12.2035	8.102	7.616	0,01	6,050 % fällig am 25.11.2035	3.597	3.323	0,01
5,500 % fällig am 25.06.2037 ^	1.108	781	0,00	5,940 % fällig am 23.09.2037	2.000	1.480	0,00	6,125 % fällig am 25.11.2033	903	894	0,00
5,580 % fällig am 25.06.2037	798	644	0,00	5,990 % fällig am 23.12.2036	5.000	3.850	0,01	6,125 % fällig am 25.05.2035	247	239	0,00
6,250 % fällig am 25.07.2037 ^	2.910	2.466	0,00	6,290 % fällig am 23.09.2038	6.781	6.103	0,01	6,125 % fällig am 25.06.2035 ^	2.510	2.115	0,00
6,250 % fällig am 25.11.2037 ^	1.259	1.076	0,00	Ameriquest Mortgage Securities Trust				6,170 % fällig am 25.07.2035	3.500	3.327	0,01
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				5,250 % fällig am 25.10.2036	21.718	6.583	0,01	6,995 % fällig am 25.05.2035	1.464	1.323	0,00
4,299 % fällig am 25.04.2037	520	447	0,00	5,325 % fällig am 25.10.2036	12.086	6.612	0,01	Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
4,417 % fällig am 25.11.2037 ^	267	231	0,00	5,660 % fällig am 25.04.2036	525	519	0,00	6,120 % fällig am 20.04.2028	1.012	1.013	0,00
4,495 % fällig am 25.10.2036 ^	95	83	0,00	5,705 % fällig am 25.04.2036	6.319	5.914	0,01	Aurium CLO DAC			
4,563 % fällig am 25.12.2036 ^	738	714	0,00	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				3,847 % fällig am 16.04.2030	€ 29.741	31.864	0,05
4,564 % fällig am 25.03.2036	1.171	1.073	0,00	2,817 % fällig am 25.06.2033	477	437	0,00	Auto Abs Spanish Loans			
4,564 % fällig am 25.10.2036	2.417	2.257	0,00								

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Bastille Euro CLO DAC				5,870 % fällig am 25.01.2035	\$ 1.305	\$ 1.292	0,00	3,820 % fällig am 25.12.2034	\$ 929	\$ 913	0,00
4,327 % fällig am 15.01.2034	€ 20.000	\$ 21.258	0,03	5,900 % fällig am 25.01.2035	1.492	1.449	0,00	3,903 % fällig am 25.01.2037	6.842	6.657	0,01
Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust				6,060 % fällig am 25.09.2034	666	638	0,00	4,033 % fällig am 25.01.2037	13.000	11.904	0,02
6,048 % fällig am 28.04.2036	\$ 1.237	1.201	0,00	6,065 % fällig am 25.10.2035	6	6	0,00	4,225 % fällig am 25.05.2036	24.922	24.000	0,04
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				6,080 % fällig am 25.09.2034	203	196	0,00	4,342 % fällig am 25.10.2046 ^	8.315	8.053	0,01
4,037 % fällig am 25.07.2036	57	54	0,00	6,110 % fällig am 25.03.2035	3.157	2.984	0,01	4,350 % fällig am 25.11.2034	8.388	8.025	0,01
4,477 % fällig am 25.11.2035 ^	1.863	1.748	0,00	Chase Funding Trust				4,380 % fällig am 25.01.2035	2.085	1.646	0,00
4,655 % fällig am 25.10.2036	53	52	0,00	5,900 % fällig am 25.09.2033	0	0	0,00	4,473 % fällig am 25.07.2036	4.624	4.133	0,01
4,655 % fällig am 25.10.2036	50	47	0,00	CIT Mortgage Loan Trust				5,115 % fällig am 25.10.2035	1.250	1.072	0,00
4,705 % fällig am 25.12.2035	121	121	0,00	6,500 % fällig am 25.10.2037	2.357	2.353	0,00	5,290 % fällig am 25.06.2035	13.401	11.677	0,02
4,993 % fällig am 25.12.2035	2.334	2.009	0,00	6,650 % fällig am 25.10.2037	71.896	69.992	0,11	5,290 % fällig am 25.05.2037	5.991	5.522	0,01
4,998 % fällig am 25.09.2034	1.407	1.371	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust				5,290 % fällig am 25.06.2037	12.534	11.569	0,02
4,998 % fällig am 25.09.2034	91	82	0,00	4,277 % fällig am 25.10.2037	421	384	0,00	5,290 % fällig am 25.07.2037	627	617	0,00
5,082 % fällig am 25.11.2034	375	370	0,00	5,220 % fällig am 25.05.2037	1.964	1.289	0,00	5,290 % fällig am 25.08.2037	92	91	0,00
5,085 % fällig am 25.04.2036	1.885	1.873	0,00	5,290 % fällig am 25.01.2037	10.152	9.201	0,02	5,290 % fällig am 25.08.2037 ^	1.931	1.699	0,00
5,087 % fällig am 25.08.2034	452	421	0,00	5,325 % fällig am 25.05.2037	347	328	0,00	5,290 % fällig am 25.04.2047	2.180	2.075	0,00
5,161 % fällig am 25.01.2035	2.578	2.503	0,00	5,330 % fällig am 25.01.2037	14.058	10.316	0,02	5,290 % fällig am 25.06.2047 ^	1.370	1.221	0,00
5,290 % fällig am 25.03.2037	2.075	1.860	0,00	5,350 % fällig am 25.05.2037	4.273	2.819	0,01	5,290 % fällig am 25.06.2047	1.153	1.060	0,00
5,310 % fällig am 25.01.2037	7.337	7.274	0,01	5,410 % fällig am 25.07.2045	4.224	2.955	0,01	5,300 % fällig am 25.04.2047 ^	87	85	0,00
5,380 % fällig am 25.02.2037	1.500	1.364	0,00	5,420 % fällig am 25.05.2037	25.116	22.951	0,04	5,320 % fällig am 25.06.2047	16.333	15.549	0,02
5,400 % fällig am 25.04.2037 ^	1.639	2.320	0,00	5,430 % fällig am 25.12.2036	3.545	3.353	0,01	5,330 % fällig am 25.06.2047	470	439	0,00
5,430 % fällig am 25.11.2036	513	497	0,00	5,440 % fällig am 25.09.2036	5.939	5.616	0,01	5,330 % fällig am 25.11.2047 ^	1.816	2.004	0,00
5,450 % fällig am 25.06.2047	161	154	0,00	5,450 % fällig am 25.12.2036	944	381	0,00	5,340 % fällig am 25.11.2037	8.528	7.839	0,01
5,490 % fällig am 25.05.2035	11	11	0,00	5,470 % fällig am 25.09.2036	1.422	1.039	0,00	5,348 % fällig am 25.02.2036	7.000	5.925	0,01
5,490 % fällig am 25.12.2036	9.843	9.354	0,02	5,470 % fällig am 25.12.2036	17.972	10.103	0,02	5,350 % fällig am 25.02.2047 ^	9.966	8.625	0,01
5,500 % fällig am 25.06.2047	7.641	6.414	0,01	5,550 % fällig am 25.11.2046	4.689	4.496	0,01	5,360 % fällig am 25.05.2047 ^	6.632	5.769	0,01
5,510 % fällig am 25.10.2036	925	914	0,00	5,570 % fällig am 25.12.2036	3.787	3.698	0,01	5,370 % fällig am 25.03.2037	6.436	6.114	0,01
5,527 % fällig am 25.02.2034	249	245	0,00	5,570 % fällig am 25.01.2037	2.382	2.326	0,00	5,370 % fällig am 25.08.2037	15.067	13.091	0,02
5,600 % fällig am 25.01.2047	2.137	2.041	0,00	5,600 % fällig am 25.01.2037	404	399	0,00	5,370 % fällig am 25.09.2037 ^	9.518	9.547	0,02
5,659 % fällig am 25.08.2036	5.489	4.949	0,01	5,630 % fällig am 25.08.2036	3.318	2.654	0,00	5,370 % fällig am 25.06.2047	11.617	11.038	0,02
5,650 % fällig am 25.05.2037	2.241	2.105	0,00	5,650 % fällig am 25.08.2036	494	479	0,00	5,370 % fällig am 25.06.2047 ^	10.690	9.661	0,02
5,670 % fällig am 25.09.2036 ^	2.206	1.900	0,00	5,670 % fällig am 25.10.2036	3.876	3.462	0,01	5,380 % fällig am 25.05.2037	9.305	8.694	0,01
5,885 % fällig am 25.09.2035	155	154	0,00	5,750 % fällig am 25.12.2035 ^	1.747	1.653	0,00	5,380 % fällig am 25.07.2037 ^	18.023	15.027	0,02
6,155 % fällig am 25.06.2035	3.578	3.426	0,01	5,775 % fällig am 25.10.2036	995	654	0,00	5,380 % fällig am 25.10.2047 ^	5.296	5.195	0,01
6,170 % fällig am 25.10.2035	1.813	1.767	0,00	6,352 % fällig am 25.05.2036 ^	1.028	412	0,00	5,400 % fällig am 25.06.2047	11.973	11.506	0,02
6,200 % fällig am 25.08.2037	10.565	8.867	0,01	6,851 % fällig am 25.06.2036 ^	518	207	0,00	5,410 % fällig am 25.12.2036 ^	7.794	6.982	0,01
6,275 % fällig am 25.02.2035	745	741	0,00	7,250 % fällig am 25.05.2036	11.910	6.345	0,01	5,410 % fällig am 25.04.2046	843	776	0,00
6,350 % fällig am 25.06.2036	616	596	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				5,410 % fällig am 25.06.2047	6.724	5.256	0,01
6,500 % fällig am 25.10.2036 ^	2.297	1.035	0,00	6,155 % fällig am 25.10.2034	3.643	3.169	0,01	5,410 % fällig am 25.06.2047 ^	5.544	4.366	0,01
7,100 % fällig am 25.11.2039	944	949	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				5,430 % fällig am 25.02.2037	518	489	0,00
8,300 % fällig am 25.12.2042	1.522	1.620	0,00	5,410 % fällig am 25.03.2037	5.597	4.739	0,01	5,505 % fällig am 25.07.2035	442	399	0,00
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				5,500 % fällig am 25.03.2037	1.933	1.636	0,00	5,555 % fällig am 25.03.2037	3.335	3.119	0,01
7,150 % fällig am 25.03.2037	2.151	1.980	0,00	5,585 % fällig am 25.11.2036	4.469	4.354	0,01	5,585 % fällig am 25.01.2045 ^	2.700	2.402	0,00
Blackrock European CLO DAC				5,600 % fällig am 25.10.2036	3.496	3.464	0,01	5,610 % fällig am 25.05.2037	3.190	3.007	0,00
4,027 % fällig am 15.07.2030	€ 8.978	9.659	0,02	5,615 % fällig am 25.08.2036	2.101	1.884	0,00	5,630 % fällig am 25.02.2037	9.514	9.154	0,01
BNC Mortgage Loan Trust				5,645 % fällig am 25.10.2036	400	383	0,00	5,630 % fällig am 25.03.2037	14.686	13.781	0,02
3,821 % fällig am 25.10.2036	\$ 5.656	4.089	0,01	5,780 % fällig am 25.02.2035	1.955	1.785	0,00	5,630 % fällig am 25.03.2047 ^	6.950	6.062	0,01
5,310 % fällig am 25.03.2037	10.205	9.517	0,02	5,825 % fällig am 25.10.2035 ^	2.193	2.120	0,00	5,633 % fällig am 25.06.2035	5.026	4.278	0,01
5,400 % fällig am 25.07.2037	9.737	8.163	0,01	5,885 % fällig am 25.09.2035 ^	2.375	2.345	0,00	5,650 % fällig am 25.04.2046 ^	5.164	4.942	0,01
5,460 % fällig am 25.05.2037	5.954	5.408	0,01	5,930 % fällig am 25.01.2036	792	785	0,00	5,670 % fällig am 25.09.2046 ^	16.343	15.534	0,02
5,470 % fällig am 25.11.2036	1.184	1.129	0,00	6,830 % fällig am 25.07.2035	3.840	3.026	0,01	5,670 % fällig am 25.09.2046 ^	2.556	2.407	0,00
BNPP AM Euro CLO DAC				Commonbond Student Loan Trust				5,675 % fällig am 25.08.2036	4.064	3.873	0,01
3,827 % fällig am 15.10.2031	€ 11.680	12.452	0,02	2,550 % fällig am 25.05.2041	2.001	1.848	0,00	5,705 % fällig am 25.07.2036	2.908	2.616	0,00
Bombardier Capital Mortgage Securitization Corp. Trust				6,000 % fällig am 25.05.2041	118	116	0,00	5,735 % fällig am 25.04.2036	1.000	899	0,00
7,180 % fällig am 15.12.2029	\$ 980	125	0,00	Conseco Finance Corp.				5,750 % fällig am 25.06.2036	1.229	1.217	0,00
7,440 % fällig am 15.12.2029	10.140	1.337	0,00	6,560 % fällig am 01.11.2028	979	970	0,00	5,805 % fällig am 25.04.2036 ^	450	395	0,00
7,575 % fällig am 15.06.2030	936	120	0,00	6,920 % fällig am 01.12.2030	2.506	2.505	0,00	5,840 % fällig am 25.04.2036	16.089	15.515	0,02
Caim CLO DAC				7,060 % fällig am 01.02.2031	1.430	1.269	0,00	5,850 % fällig am 25.03.2036 ^	5.849	5.048	0,01
3,912 % fällig am 31.01.2030	€ 25.564	27.465	0,04	7,500 % fällig am 01.03.2030	12.877	5.030	0,01	5,855 % fällig am 25.09.2035	1.497	1.408	0,00
Camber PLC				7,850 % fällig am 15.11.2026	21	21	0,00	5,870 % fällig am 25.08.2035	1.794	1.583	0,00
1,571 % fällig am 09.11.2053	\$ 30.714	182	0,00	7,860 % fällig am 01.03.2030	4.756	1.931	0,00	5,971 % fällig am 25.09.2046 ^	682	687	0,00
Capitalsource Real Estate Loan Trust				Conseco Finance Securitizations Corp.				5,989 % fällig am 25.10.2046 ^	55	52	0,00
5,861 % fällig am 20.01.2037	8.401	7.739	0,01	6,977 % fällig am 01.09.2033	1.718	1.688	0,00	5,990 % fällig am 25.10.2047	1.100	1.045	0,00
5,961 % fällig am 20.01.2037	5.400	4.514	0,01	7,100 % fällig am 01.02.2033	68	67	0,00	6,050 % fällig am 25.02.2036 ^	4.162	3.881	0,01
6,061 % fällig am 20.01.2037	3.000	2.453	0,00	7,770 % fällig am 01.09.2031	836	824	0,00	6,050 % fällig am 25.05.2036	218	210	0,00
Carbone CLO Ltd.				7,970 % fällig am 01.05.2032	1.887	370	0,00	6,125 % fällig am 25.12.2035	891	875	0,00
6,390 % fällig am 20.01.2031	4.294	4.264	0,01	8,060 % fällig am 01.09.2029	14.402	3.033	0,01	6,125 % fällig am 25.01.2036	6.110	5.919	0,01
Carrington Mortgage Loan Trust				8,260 % fällig am 01.12.2030	13.372	3.495	0,01	6,140 % fällig am 25.02.2036 ^	4.000	3.482	0,01
5,300 % fällig am 25.04.2036 ^	2.105	2.010	0,00	8,310 % fällig am 01.05.2032	20.172	4.120	0,01	6,155 % fällig am 25.10.2035	4.175	4.102	0,01
5,300 % fällig am 25.08.2036	8.951	8.456	0,01	Countrywide Asset-Backed Certificates				6,215 % fällig am 25.07.2035	2.979	2.942	0,01
5,310 % fällig am 25.10.2036	11.722	11.291	0,02	5,430 % fällig am 25.03.2037	2.180	2.074	0,00	6,215 % fällig am 25.08.2035	1.627	1.621	0,00
5,410 % fällig am 25.02.20											

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
7,100 % fällig am 25.08.2035	\$ 4.950	\$ 4.617	0,01	7,775 % fällig am 25.12.2034	\$ 657	\$ 569	0,00	Galaxy CLO Ltd.			
7,250 % fällig am 25.10.2034	604	452	0,00	8,525 % fällig am 25.10.2034	1.104	1.003	0,00	6,338 % fällig am 16.05.2031	\$ 4.425	\$ 4.372	0,01
7,550 % fällig am 25.10.2034	534	502	0,00	FAB CBO BV				GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				4,192 % fällig am 20.08.2080	€ 321	351	0,00	5,790 % fällig am 25.12.2035	1.322	1.247	0,00
5,650 % fällig am 25.10.2034	3.201	3.052	0,01	FBR Securitization Trust				5,810 % fällig am 25.10.2035	1.334	1.284	0,00
5,690 % fällig am 25.12.2034	5.112	4.941	0,01	5,885 % fällig am 25.11.2035	\$ 11.731	10.625	0,02	5,810 % fällig am 25.12.2035	1.696	1.319	0,00
5,870 % fällig am 25.07.2034	571	563	0,00	Fidelity Grand Harbour CLO DAC				GE-WMC Mortgage Securities Trust			
6,005 % fällig am 25.08.2034	555	552	0,00	4,726 % fällig am 15.03.2032	€ 5.196	5.572	0,01	5,410 % fällig am 25.08.2036	6.664	6.138	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				Fieldstone Mortgage Investment Trust				GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC			
5,171 % fällig am 25.03.2035	5.537	5.356	0,01	5,378 % fällig am 25.11.2036	\$ 3.292	1.916	0,00	3,930 % fällig am 20.10.2030	€ 966	1.036	0,00
5,890 % fällig am 25.08.2047	13.062	12.430	0,02	5,418 % fällig am 25.11.2036	7.752	6.890	0,01	Goodgreen Trust			
5,900 % fällig am 25.03.2034	2.775	2.703	0,00	5,530 % fällig am 25.05.2036	6.983	4.801	0,01	3,930 % fällig am 15.10.2053	\$ 11.219	9.994	0,02
6,650 % fällig am 25.02.2035	5.912	5.780	0,01	5,618 % fällig am 25.11.2036	2.631	1.531	0,00	Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.			
Countrywide Asset-Backed Securities Notes Trust				5,795 % fällig am 25.02.2036	10.407	9.224	0,02	6,373 % fällig am 15.09.2037	22.512	22.211	0,04
7,150 % fällig am 25.08.2047	112	109	0,00	7,175 % fällig am 25.02.2035	1.063	1.008	0,00	GSA Home Equity Trust			
Countrywide Revolving Home Equity Loan Trust				Finance America Mortgage Loan Trust				5,250 % fällig am 25.09.2036	4.071	977	0,00
5,373 % fällig am 15.05.2036	725	710	0,00	6,095 % fällig am 25.11.2034	629	552	0,00	5,250 % fällig am 25.12.2046	2.438	1.225	0,00
5,393 % fällig am 15.05.2036	693	657	0,00	6,170 % fällig am 25.11.2034	459	382	0,00	5,270 % fällig am 25.05.2036	6.561	1.645	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				First Franklin Mortgage Loan Trust				5,270 % fällig am 25.11.2036	5.050	1.276	0,00
6,500 % fällig am 25.05.2044	23	23	0,00	4,234 % fällig am 25.03.2036	1.697	1.682	0,00	5,290 % fällig am 25.12.2046	7.011	2.089	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization CBO Ltd.				5,250 % fällig am 25.03.2037	5.063	2.450	0,00	5,310 % fällig am 25.02.2037	6.044	1.876	0,00
5,588 % fällig am 16.02.2041	54.641	853	0,00	5,260 % fällig am 25.12.2037	557	523	0,00	5,330 % fällig am 25.07.2036	1.323	295	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				5,270 % fällig am 25.11.2036	7.226	6.667	0,01	5,350 % fällig am 25.03.2037	8.029	2.456	0,00
2,817 % fällig am 25.05.2036	3.598	2.366	0,00	5,270 % fällig am 25.12.2036	7.825	7.262	0,01	5,470 % fällig am 25.06.2036	4.375	970	0,00
3,044 % fällig am 25.12.2036 ^	4.239	3.375	0,01	5,300 % fällig am 25.03.2037	638	310	0,00	5,490 % fällig am 25.09.2036	5.540	1.340	0,00
3,208 % fällig am 25.12.2035	365	349	0,00	5,310 % fällig am 25.10.2036	4.759	4.672	0,01	5,490 % fällig am 25.03.2047	19.536	6.041	0,01
3,289 % fällig am 25.03.2034	341	340	0,00	5,310 % fällig am 25.11.2036	8.365	8.224	0,01	5,510 % fällig am 25.03.2036	11.701	4.487	0,01
3,506 % fällig am 25.04.2037	5.575	3.453	0,01	5,310 % fällig am 25.12.2037	8.064	6.949	0,01	5,510 % fällig am 25.12.2036	13.161	3.741	0,01
4,727 % fällig am 25.12.2037	680	729	0,00	5,360 % fällig am 25.12.2037	11.910	10.288	0,02	5,530 % fällig am 25.03.2036	8.320	3.048	0,01
5,450 % fällig am 25.10.2036	2.963	2.453	0,00	5,430 % fällig am 25.12.2036	13.847	5.882	0,01	5,558 % fällig am 25.05.2035	314	289	0,00
8,525 % fällig am 25.01.2033 ^	286	246	0,00	5,450 % fällig am 25.08.2036	1.118	1.018	0,00	5,630 % fällig am 25.11.2036	7.394	2.612	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust				5,460 % fällig am 25.07.2036	3.734	3.528	0,01	5,676 % fällig am 25.09.2035	3.303	2.261	0,00
3,287 % fällig am 25.03.2037 ^	110	42	0,00	5,460 % fällig am 25.09.2036	5.624	5.187	0,01	5,750 % fällig am 25.03.2036	3.340	1.825	0,00
3,535 % fällig am 25.02.2037 ^	699	428	0,00	5,470 % fällig am 25.04.2036	6.254	5.981	0,01	5,750 % fällig am 25.05.2047	112	75	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				5,470 % fällig am 25.06.2036	5.489	5.313	0,01	5,788 % fällig am 25.05.2037 ^	5.899	2.631	0,00
3,075 % fällig am 25.07.2036	2.139	1.993	0,00	5,630 % fällig am 25.08.2036	7.295	6.694	0,01	5,870 % fällig am 25.10.2035	2.104	1.836	0,00
3,156 % fällig am 25.01.2037 ^	4.142	1.296	0,00	5,630 % fällig am 25.10.2036	13.539	9.151	0,01	5,885 % fällig am 25.06.2035	2.200	2.118	0,00
5,370 % fällig am 25.11.2036	10.391	4.885	0,01	5,750 % fällig am 25.02.2036	4.037	3.645	0,01	5,910 % fällig am 25.01.2036	465	40	0,00
5,450 % fällig am 25.11.2036	2.439	1.146	0,00	5,825 % fällig am 25.11.2035	1.347	1.311	0,00	5,917 % fällig am 25.03.2037 ^	2.327	483	0,00
5,610 % fällig am 25.11.2036	846	397	0,00	5,840 % fällig am 25.01.2036	3.122	2.820	0,01	6,000 % fällig am 25.10.2037 ^	111	96	0,00
5,630 % fällig am 25.10.2036	9.908	6.612	0,01	5,855 % fällig am 25.05.2036	176	175	0,00	6,095 % fällig am 25.08.2035	2.004	1.794	0,00
CSAB Mortgage-Backed Trust				5,870 % fällig am 25.08.2034	880	826	0,00	6,300 % fällig am 25.03.2037 ^	5.665	1.413	0,00
5,610 % fällig am 25.11.2036	7.941	1.166	0,00	5,870 % fällig am 25.10.2035	26	26	0,00	6,376 % fällig am 25.09.2036	716	196	0,00
5,858 % fällig am 25.05.2037	5.422	1.387	0,00	5,870 % fällig am 25.11.2035	2.481	2.285	0,00	6,459 % fällig am 25.09.2036 ^	4.796	1.313	0,00
5,898 % fällig am 25.05.2037 ^	815	209	0,00	5,900 % fällig am 25.12.2035	4.060	3.860	0,01	6,483 % fällig am 25.03.2037 ^	5.301	1.610	0,00
6,580 % fällig am 25.09.2036	2.145	724	0,00	5,975 % fällig am 25.06.2034	350	349	0,00	6,500 % fällig am 25.10.2037	1.133	597	0,00
CVC Cordatus Loan Fund DAC				6,050 % fällig am 25.07.2035	1.150	1.125	0,00	6,599 % fällig am 25.03.2037	2.097	521	0,00
3,855 % fällig am 21.07.2030	€ 37.050	39.755	0,06	6,080 % fällig am 25.07.2034	143	142	0,00	GSAMP Trust			
4,411 % fällig am 23.10.2034	10.600	11.418	0,02	6,095 % fällig am 25.03.2035	754	736	0,00	3,332 % fällig am 25.11.2034	1.345	1.268	0,00
4,423 % fällig am 20.08.2034	5.000	5.319	0,01	6,095 % fällig am 25.09.2035	4.706	4.117	0,01	5,200 % fällig am 25.12.2046	305	153	0,00
Dryden CLO Ltd.				6,425 % fällig am 25.07.2034	1.461	1.421	0,00	5,250 % fällig am 25.12.2046	1.369	689	0,00
6,232 % fällig am 18.04.2031	\$ 6.600	6.537	0,01	6,575 % fällig am 25.10.2034	406	404	0,00	5,270 % fällig am 25.12.2036	4.932	2.420	0,00
6,380 % fällig am 15.01.2031	3.731	3.702	0,01	6,950 % fällig am 25.09.2034	1.708	1.716	0,00	5,280 % fällig am 25.12.2046	5.250	2.858	0,01
Dryden Euro CLO BV				First NLC Trust				5,290 % fällig am 25.11.2036	4.861	2.317	0,00
3,927 % fällig am 15.07.2032	€ 935	1.004	0,00	5,220 % fällig am 25.08.2037	6.157	3.156	0,01	5,290 % fällig am 25.03.2047	6.201	5.533	0,01
Dryden Euro CLO DAC				5,290 % fällig am 25.08.2037	185	95	0,00	5,300 % fällig am 25.12.2046	462	233	0,00
3,987 % fällig am 15.01.2032	3.265	3.509	0,01	5,330 % fällig am 25.08.2037	3.340	1.712	0,00	5,310 % fällig am 25.08.2036	2.211	1.752	0,00
4,057 % fällig am 15.04.2034	3.000	3.176	0,01	5,430 % fällig am 25.08.2037	46	24	0,00	5,310 % fällig am 25.01.2037	15.493	9.071	0,01
Dryden Senior Loan Fund				5,885 % fällig am 25.02.2036	4.467	3.669	0,01	5,320 % fällig am 25.12.2036	7.221	3.542	0,01
6,230 % fällig am 15.04.2031	\$ 22.350	22.173	0,04	Fremont Home Loan Trust				5,320 % fällig am 25.01.2037	4.875	4.685	0,01
ECMC Group Student Loan Trust				5,280 % fällig am 25.11.2036	5.288	1.920	0,00	5,350 % fällig am 25.11.2036	1.187	575	0,00
6,200 % fällig am 25.05.2067	15.461	15.020	0,02	5,285 % fällig am 25.10.2036	11.907	10.487	0,02	5,380 % fällig am 25.12.2046	681	343	0,00
EFS Volunteer LLC				5,290 % fällig am 25.01.2037	21.477	10.919	0,02	5,390 % fällig am 25.09.2036	17.913	6.522	0,01
6,105 % fällig am 25.10.2035	629	628	0,00	5,300 % fällig am 25.10.2036	12.540	5.120	0,01	5,420 % fällig am 25.03.2047	5.838	5.391	0,01
Ellington Loan Acquisition Trust				5,350 % fällig am 25.08.2036	6.764	2.269	0,00	5,430 % fällig am 25.06.2036	1.998	1.933	0,00
6,200 % fällig am 25.05.2037	9.878	9.289	0,02	5,370 % fällig am 25.11.2036	6.678	2.424	0,00	5,450 % fällig am 25.06.2036	6.161	3.380	0,01
6,250 % fällig am 25.05.2037	13.011	12.565	0,02	5,430 % fällig am 25.02.2037	13.354	10.290	0,02	5,450 % fällig am 25.08.2036	1.411	1.379	0,00
6,650 % fällig am 25.05.2037	1.529	1.487	0,00	5,470 % fällig am 25.05.2036	8.754	5.176	0,01	5,450 % fällig am 25.12.2036	1.246	1.180	0,00
Encore Credit Receivables Trust				5,490 % fällig am 25.02.2036	4.076	3.857	0,01	5,470 % fällig am 25.04.2036	4.840	3.021	0,01
5,885 % fällig am 25.07.2035	1.899	1.722	0,00	5,690 % fällig am 25.02.2036	300	255	0,00	5,520 % fällig am 25.03.2047	3.302	2.477	0,00
6,050 % fällig am 25.01.2036	828	780	0,00	5,765 % fällig am 25.11.2035	5.829	5.016	0,01	5,525 % fällig am 25.10.2046	6.000	4.898	0,01
6,080 % fällig am 25.11.2035	4.103	3.711	0,01	5,810 % fällig am 25.01.2036	1.390	1.291	0,00	5,630 % fällig am 25.06.2036	2.088	1.113	0,00
6,125 % fällig am 25.01.2036	4.142	3.616	0,01	5,825 % fällig am 25.01.2036	6.546	4.821	0,01	5,630 % fällig am 25.03.2046	235	227	0,00
6,170 % fällig am 25.07.2035	2.138	1.870									



BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
6,125 % fällig am 25.03.2035 ^	\$ 1.053	\$ 938	0,00	3,967 % fällig am 25.11.2036	4.292	3.695	0,01	6,300 % fällig am 25.09.2034	1.384	1.353	0,00
6,125 % fällig am 25.04.2035 ^	2.010	1.832	0,00	4,193 % fällig am 25.11.2036	5.889	5.817	0,01	6,575 % fällig am 25.02.2035	6.916	6.180	0,01
6,200 % fällig am 25.06.2034	455	420	0,00	4,459 % fällig am 25.01.2037 ^	2.578	1.412	0,00	Madison Park Funding Ltd.			
8,525 % fällig am 25.02.2047	1.500	1.415	0,00	5,230 % fällig am 25.12.2036	3.087	1.622	0,00	0,000 % fällig am 29.07.2030	12.337	12.296	0,02
Harvest CLO DAC				5,300 % fällig am 25.12.2036	5.641	2.982	0,01	Man GLG Euro CLO DAC			
4,027 % fällig am 15.01.2032	€ 23.100	24.662	0,04	5,330 % fällig am 25.07.2036	511	228	0,00	3,857 % fällig am 15.10.2030	€ 7.694	8.242	0,01
Hildene TruPS Financials Note Securitization Ltd.				5,340 % fällig am 25.03.2047	1.692	1.673	0,00	3,917 % fällig am 15.10.2030	12.650	13.522	0,02
6,571 % fällig am 10.10.2038	\$ 22.725	20.623	0,03	5,360 % fällig am 25.10.2036	4.004	3.941	0,01	3,987 % fällig am 15.10.2032	7.492	7.962	0,01
Home Equity Asset Trust				5,360 % fällig am 25.12.2036	5.642	2.996	0,01	4,047 % fällig am 15.01.2030	10.991	11.844	0,02
3,883 % fällig am 25.02.2036	3.525	3.388	0,01	5,380 % fällig am 25.05.2037	2.290	2.198	0,00	MAPS Ltd.			
5,450 % fällig am 25.11.2036	1.451	1.404	0,00	5,390 % fällig am 25.05.2037	7.378	7.315	0,01	4,212 % fällig am 15.05.2043	\$ 19.381	17.313	0,03
5,630 % fällig am 25.10.2036	4.431	2.721	0,00	5,410 % fällig am 25.03.2037	2.852	2.769	0,01	Marlay Park CLO DAC			
5,750 % fällig am 25.07.2036	3.250	2.950	0,01	5,410 % fällig am 25.06.2037	2.020	2.010	0,00	3,917 % fällig am 15.10.2030	€ 3.021	3.246	0,01
5,810 % fällig am 25.04.2036	2.529	2.211	0,00	5,420 % fällig am 25.08.2036	6.700	5.965	0,01	MASTR Asset-Backed Securities Trust			
5,855 % fällig am 25.01.2036	2.812	2.658	0,00	5,440 % fällig am 25.07.2036	436	423	0,00	5,200 % fällig am 25.10.2036	\$ 4.037	1.313	0,00
5,945 % fällig am 25.11.2035	622	614	0,00	5,450 % fällig am 25.01.2037	537	512	0,00	5,250 % fällig am 25.11.2036	103	33	0,00
5,990 % fällig am 25.01.2035	782	757	0,00	5,450 % fällig am 25.03.2037	7.847	7.049	0,01	5,295 % fällig am 25.01.2037	22.242	6.401	0,01
6,050 % fällig am 25.12.2034	89	87	0,00	5,530 % fällig am 25.07.2036	1.800	1.721	0,00	5,300 % fällig am 25.10.2036	6.870	2.254	0,00
6,095 % fällig am 25.11.2035	523	491	0,00	5,555 % fällig am 25.05.2036	2.406	2.333	0,00	5,320 % fällig am 25.10.2036	45	44	0,00
6,095 % fällig am 25.12.2035	620	568	0,00	5,555 % fällig am 25.07.2036	3.001	2.908	0,01	5,350 % fällig am 25.08.2036	8.389	3.067	0,01
6,395 % fällig am 25.05.2035	1.048	974	0,00	5,585 % fällig am 25.05.2036	5.026	4.713	0,01	5,350 % fällig am 25.10.2036	5.455	2.758	0,00
6,650 % fällig am 25.03.2035	867	811	0,00	5,590 % fällig am 25.07.2036	1.998	1.788	0,00	5,360 % fällig am 25.05.2037	6.697	6.309	0,01
6,800 % fällig am 25.12.2034	575	555	0,00	5,600 % fällig am 25.07.2036	3.786	3.174	0,01	5,410 % fällig am 25.10.2036	513	238	0,00
6,850 % fällig am 25.11.2034	383	373	0,00	5,660 % fällig am 25.04.2036	5.628	4.381	0,01	5,420 % fällig am 25.08.2036	7.491	3.054	0,01
6,900 % fällig am 25.11.2034	297	287	0,00	5,680 % fällig am 25.01.2037	5.706	4.929	0,01	5,450 % fällig am 25.04.2036	2.139	546	0,00
Home Equity Loan Trust				6,630 % fällig am 25.07.2036 ^	9.952	2.927	0,01	5,450 % fällig am 25.06.2036	3.564	1.350	0,00
5,380 % fällig am 25.04.2037	415	401	0,00	Kodiak CDO Ltd.				5,450 % fällig am 25.08.2036	14.185	5.200	0,01
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				5,324 % fällig am 07.08.2037	3.242	3.088	0,01	5,470 % fällig am 25.10.2036	7.141	3.610	0,01
5,270 % fällig am 25.04.2037	5.756	3.977	0,01	LCM Loan Income Fund Income Note Issuer Ltd.				5,590 % fällig am 25.11.2036	9.446	5.624	0,01
5,290 % fällig am 25.11.2036	5.360	4.817	0,01	6,340 % fällig am 16.07.2031	12.648	12.479	0,02	5,630 % fällig am 25.03.2036	3.052	1.876	0,00
5,310 % fällig am 25.11.2036	3.721	3.168	0,01	LCM LP				5,630 % fällig am 25.08.2036	4.067	1.507	0,00
5,320 % fällig am 25.04.2037	10.193	7.043	0,01	6,270 % fällig am 20.04.2031	50.000	49.467	0,08	5,650 % fällig am 25.10.2036 ^	4.757	4.444	0,01
5,340 % fällig am 25.04.2037	9.601	6.265	0,01	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust				5,650 % fällig am 25.11.2035	2.634	1.524	0,00
5,340 % fällig am 25.07.2037	7.953	3.245	0,01	6,630 % fällig am 15.04.2040	2.811	2.756	0,01	5,720 % fällig am 25.01.2036	2.386	2.327	0,00
5,350 % fällig am 25.07.2037	9.272	4.976	0,01	Lehman XS Trust				5,730 % fällig am 25.01.2036	613	599	0,00
5,360 % fällig am 25.04.2037	1.239	856	0,00	4,106 % fällig am 25.06.2036	6	6	0,00	5,850 % fällig am 25.09.2034	2.100	1.780	0,00
5,390 % fällig am 25.11.2036	602	449	0,00	5,058 % fällig am 25.01.2036 ^	2.078	1.930	0,00	5,975 % fällig am 25.10.2034	100	95	0,00
5,390 % fällig am 25.04.2037	10.445	6.817	0,01	5,350 % fällig am 25.02.2037	10.121	9.004	0,01	6,155 % fällig am 25.03.2035	2.260	2.194	0,00
5,510 % fällig am 25.06.2036	2.909	2.717	0,00	5,460 % fällig am 25.03.2037	2.385	2.096	0,00	6,300 % fällig am 25.08.2037	6.658	5.529	0,01
5,530 % fällig am 25.06.2036	45	45	0,00	5,470 % fällig am 25.05.2036	3.177	2.738	0,00	6,875 % fällig am 25.06.2035	100	99	0,00
5,630 % fällig am 25.08.2036	5.732	5.022	0,01	5,490 % fällig am 25.10.2036	1.710	1.553	0,00	7,685 % fällig am 25.06.2035	1.659	1.639	0,00
5,810 % fällig am 25.03.2036	4.756	4.380	0,01	5,490 % fällig am 25.12.2036	3.959	3.687	0,01	MASTR Specialized Loan Trust			
6,215 % fällig am 25.08.2035	1.800	1.672	0,00	5,570 % fällig am 25.06.2046	4.463	4.083	0,01	5,520 % fällig am 25.01.2037	3.949	1.605	0,00
6,395 % fällig am 25.03.2035	2.936	2.841	0,01	5,610 % fällig am 25.02.2037	5.430	4.072	0,01	5,670 % fällig am 25.06.2046	1.456	1.385	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust				5,670 % fällig am 25.05.2046 ^	1.560	1.393	0,00	6,523 % fällig am 25.07.2035	451	426	0,00
5,300 % fällig am 25.12.2036	2.570	2.270	0,00	5,670 % fällig am 25.02.2047	2.034	1.825	0,00	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust			
5,340 % fällig am 25.01.2037	13.232	9.151	0,01	5,730 % fällig am 25.09.2036	3.532	3.071	0,01	5,430 % fällig am 25.04.2037	658	298	0,00
5,370 % fällig am 25.12.2036	16.449	7.093	0,01	6,260 % fällig am 25.11.2035	2.737	1.270	0,00	5,510 % fällig am 25.06.2037	674	520	0,00
5,410 % fällig am 25.04.2037	11.818	6.056	0,01	6,390 % fällig am 25.04.2036 ^	28	37	0,00	6,150 % fällig am 25.10.2037	7.010	5.800	0,01
5,470 % fällig am 25.10.2036	18.526	7.530	0,01	6,790 % fällig am 24.06.2046	222	279	0,00	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
5,525 % fällig am 25.05.2037	4.026	3.860	0,01	7,450 % fällig am 25.12.2037	982	995	0,00	5,370 % fällig am 25.07.2037	6.166	2.729	0,00
5,590 % fällig am 25.12.2036	17.797	4.806	0,01	Long Beach Mortgage Loan Trust				5,390 % fällig am 25.02.2037	3.990	1.201	0,00
5,675 % fällig am 25.02.2036	3.065	2.614	0,00	5,310 % fällig am 25.12.2036	23.063	15.816	0,03	5,430 % fällig am 25.05.2037	5.219	2.766	0,00
5,690 % fällig am 25.12.2035	490	484	0,00	5,320 % fällig am 25.12.2036	85	31	0,00	5,430 % fällig am 25.11.2037	7.977	4.123	0,01
5,735 % fällig am 25.12.2035	3.500	3.229	0,01	5,330 % fällig am 25.09.2036	13.442	3.774	0,01	5,450 % fällig am 25.06.2037	3.619	932	0,00
5,765 % fällig am 25.01.2036	8.126	7.409	0,01	5,350 % fällig am 25.07.2036	6.297	2.548	0,00	5,450 % fällig am 25.08.2037	14.610	10.082	0,02
Humboldt Americas LLC				5,370 % fällig am 25.11.2036	328	104	0,00	5,450 % fällig am 25.11.2037	3.560	1.251	0,00
0,000 % fällig am 31.07.2022	20.000,00			5,380 % fällig am 25.12.2036	1.412	517	0,00	5,470 % fällig am 25.03.2037	10.778	9.454	0,02
ICG Euro CLO DAC				5,390 % fällig am 25.08.2036	19.494	8.043	0,01	5,470 % fällig am 25.07.2037	3.013	1.741	0,00
2,150 % fällig am 15.10.2034	€ 6.000	5.360	0,01	5,440 % fällig am 25.07.2036	4.984	3.604	0,01	5,530 % fällig am 25.04.2047	6.340	2.642	0,00
IndyMac Manufactured Housing Contract Pass-Through Certificates				5,450 % fällig am 25.05.2036	9.643	5.609	0,01	5,650 % fällig am 25.07.2037	3.456	838	0,00
6,750 % fällig am 25.02.2028	\$ 5	5	0,00	5,450 % fällig am 25.07.2036	2.449	994	0,00	5,670 % fällig am 25.03.2037	2.645	757	0,00
IXIS Real Estate Capital Trust				5,450 % fällig am 25.09.2036	801	510	0,00	5,670 % fällig am 25.07.2037	5.386	2.417	0,00
5,210 % fällig am 25.05.2037	21.378	5.359	0,01	5,450 % fällig am 25.11.2036	15.462	11.143	0,02	5,750 % fällig am 25.12.2036	2.621	2.454	0,00
5,450 % fällig am 25.01.2037	13.909	5.056	0,01	5,470 % fällig am 25.05.2036	11.255	3.605	0,01	5,750 % fällig am 25.01.2037	5.374	4.847	0,01
5,470 % fällig am 25.08.2036	3.218	950	0,00	5,470 % fällig am 25.08.2036	2.476	1.025	0,00	6,050 % fällig am 25.02.2047	210	124	0,00
5,550 % fällig am 25.03.2036 ^	1.409	729	0,00	5,470 % fällig am 25.09.2036	10.454	2.945	0,01	6,080 % fällig am 25.07.2035	1.360	1.315	0,00
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				5,470 % fällig am 25.10.2036	28.699	8.926	0,01	6,230 % fällig am 25.10.2035	146	143	0,00
2,810 % fällig am 25.10.2035 ^	366	356	0,00	5,470 % fällig am 25.05.2046	12.744	11.558	0,02	6,275 % fällig am 25.08.2036	3.078	3.099	0,01
2,810 % fällig am 25.10.2035	3.847	3.304	0,01	5,510 % fällig am 25.03.2046	20.253	16.608	0,03	MESA Trust			
5,660 % fällig am 25.02.2036 ^	2.412	2.339	0,00	5,530 % fällig am 25.03.2046	2.709	985	0,00	5,950 % fällig am 25.12.2031	3	3	0,00
5,690 % fällig am 25.02.2036 ^	2.711	2.343	0,00	5,630 % fällig am 25.08.2036	3.052	1.270	0,00	METAL Cayman Ltd.			
5,690 % fällig am 25.03.2036	6.125	5.683	0,01	5,670 % fällig am 25.08.2045	548	525	0,00	4,581 % fällig am 15.10.2042	26.857	16.357	0,03
5,780 % fällig am 25.05.2035 ^	\$ 5.614	\$ 5.072	0,01	5,710 % fällig am 25.10.2034	4.254	3.955	0,01	MMcapS Funding Ltd.			
5,855 % fällig am 25.09.2035	155	153	0,00	5,750 % fällig am 25.01.2036	12.401	11.247	0,02	5,846 % fällig am 01.12.2035	2.955	2.807	0,01
5,900 % fällig am 25.06.2035	4.606	4.465	0,01	5,750 % fällig am 25.02.2036	11.881	9.772	0,02	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				5,930 % fällig am 25.08.2035	7.590	7.360	0,01	3,580 % fällig am 25.01.2035	1.950		

**Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,240 % fällig am 25.01.2037	\$ 16.118	\$ 7.388	0,01	Mountain View CLO LLC	\$ 33.807	\$ 33.598	0,05	5,690 % fällig am 25.01.2036	\$ 17.298	\$ 15.434	0,02
5,250 % fällig am 25.07.2036	6.504	2.472	0,00	6,350 % fällig am 16.10.2029				5,885 % fällig am 25.05.2035	3.000	2.794	0,00
5,250 % fällig am 25.10.2036	1.365	594	0,00	Nassau Ltd.				5,885 % fällig am 25.08.2035	158	154	0,00
5,260 % fällig am 25.10.2036	5.144	2.713	0,00	6,410 % fällig am 15.10.2029	8.625	8.613	0,01	5,945 % fällig am 25.05.2034	1.941	1.868	0,00
5,260 % fällig am 25.12.2036	3.704	1.842	0,00	National Collegiate Student Loan Trust				6,020 % fällig am 25.05.2035	700	570	0,00
5,260 % fällig am 25.02.2037	3.273	1.045	0,00	5,460 % fällig am 25.05.2032	6.362	6.043	0,01	Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates			
5,260 % fällig am 25.03.2037	426	188	0,00	5,470 % fällig am 27.10.2031	9.809	9.573	0,02	5,840 % fällig am 25.11.2035	2.469	2.317	0,00
5,280 % fällig am 25.02.2037	74	67	0,00	5,500 % fällig am 25.03.2033	8.054	7.548	0,01	Ownit Mortgage Loan Trust			
5,290 % fällig am 25.10.2036	14.055	6.114	0,01	5,520 % fällig am 25.06.2033	2.749	2.584	0,00	3,157 % fällig am 25.12.2035 ^	1.051	612	0,00
5,290 % fällig am 25.05.2037	24.074	19.204	0,03	Nationstar Home Equity Loan Trust				5,370 % fällig am 25.07.2037	1.164	971	0,00
5,300 % fällig am 25.11.2036	7.057	3.887	0,01	5,325 % fällig am 25.06.2037	3.019	2.935	0,01	OZLM Ltd.			
5,300 % fällig am 25.12.2036	10.953	5.448	0,01	5,470 % fällig am 25.04.2037	7.643	7.468	0,01	6,300 % fällig am 20.04.2031	1.000	990	0,00
5,300 % fällig am 25.02.2037	4.883	2.359	0,00	Naviest Private Education Loan Trust				OZLME DAC			
5,300 % fällig am 25.02.2037	632	202	0,00	2,650 % fällig am 15.12.2028	135	135	0,00	4,162 % fällig am 24.08.2030	€ 2.308	2.469	0,00
5,350 % fällig am 25.05.2037	6.949	3.847	0,01	6,643 % fällig am 16.07.2040	12.845	12.826	0,02	Palmer Square CLO Ltd.			
5,360 % fällig am 25.01.2037	5.138	2.359	0,00	7,343 % fällig am 15.12.2045	6.134	6.162	0,01	6,390 % fällig am 17.01.2031	\$ 807	802	0,00
5,400 % fällig am 25.03.2037	8.168	7.041	0,01	New Century Home Equity Loan Trust				Palmer Square European CLO DAC			
5,400 % fällig am 25.07.2036	0	0	0,00	5,310 % fällig am 25.02.2036	6.013	5.750	0,01	1,970 % fällig am 15.04.2035	€ 6.000	5.348	0,01
5,400 % fällig am 25.12.2036	2.196	970	0,00	5,510 % fällig am 25.05.2036	1.162	1.133	0,00	Palmer Square European Loan Funding DAC			
5,410 % fällig am 25.02.2037	844	408	0,00	5,795 % fällig am 25.12.2035	7.106	6.708	0,01	4,727 % fällig am 15.11.2032	35.600	38.436	0,06
5,450 % fällig am 25.06.2036	3.709	1.942	0,00	5,825 % fällig am 25.03.2035	2.153	2.124	0,00	Park Place Securities, Inc.			
5,450 % fällig am 25.07.2036	3.443	1.320	0,00	5,870 % fällig am 25.03.2035	4.567	4.394	0,01	5,885 % fällig am 25.09.2035	\$ 6.045	5.902	0,01
5,470 % fällig am 25.09.2036	3.820	1.709	0,00	5,885 % fällig am 25.10.2035	6.885	5.620	0,01	6,095 % fällig am 25.09.2035	2.506	2.261	0,00
5,480 % fällig am 25.02.2037	12.765	6.169	0,01	5,915 % fällig am 25.02.2035	3.660	3.344	0,01	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,630 % fällig am 25.06.2036	23.262	16.090	0,03	6,080 % fällig am 25.11.2034	2.945	2.817	0,01	5,885 % fällig am 25.08.2035	6.752	6.479	0,01
5,630 % fällig am 25.09.2036	24.633	9.298	0,02	6,095 % fällig am 25.06.2035	479	475	0,00	5,885 % fällig am 25.09.2035	6.612	6.361	0,01
5,645 % fällig am 25.03.2036	6.831	5.759	0,01	6,095 % fällig am 25.09.2035	7.903	7.638	0,01	5,945 % fällig am 25.07.2035	3.191	3.151	0,01
5,650 % fällig am 25.04.2036	8.935	8.253	0,01	6,125 % fällig am 25.11.2034	277	271	0,00	6,095 % fällig am 25.06.2035	624	618	0,00
5,650 % fällig am 25.07.2036	1.634	631	0,00	6,125 % fällig am 25.06.2035	4.903	4.696	0,01	6,125 % fällig am 25.07.2035	5.600	4.575	0,01
5,720 % fällig am 25.12.2035	6.235	5.005	0,01	6,155 % fällig am 25.07.2035	12.000	11.629	0,02	6,155 % fällig am 25.06.2035	2.903	2.748	0,00
5,720 % fällig am 25.12.2035	120	115	0,00	6,215 % fällig am 25.03.2035	342	307	0,00	6,185 % fällig am 25.05.2035	3.000	2.363	0,00
5,750 % fällig am 25.12.2035	3.500	3.222	0,01	Newcastle Mortgage Securities Trust				6,200 % fällig am 25.09.2034	3.506	3.452	0,01
5,810 % fällig am 25.01.2035	2.782	2.698	0,00	5,340 % fällig am 25.04.2037	2.549	2.414	0,00	6,200 % fällig am 25.06.2035	1.992	1.640	0,00
5,810 % fällig am 25.11.2035	6.282	5.993	0,01	5,380 % fällig am 25.04.2037	9.678	9.407	0,02	6,275 % fällig am 25.12.2035	828	799	0,00
5,825 % fällig am 25.12.2034	580	549	0,00	5,825 % fällig am 25.03.2036	6.394	6.259	0,01	6,470 % fällig am 25.01.2036 ^	5.451	4.961	0,01
5,825 % fällig am 25.09.2035	4.865	4.515	0,01	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				6,725 % fällig am 25.02.2035	8.091	7.825	0,01
5,855 % fällig am 25.12.2034	413	372	0,00	5,430 % fällig am 25.07.2036	10.729	8.755	0,01	6,920 % fällig am 25.10.2034	5.729	5.409	0,01
5,890 % fällig am 25.01.2034	1.664	1.617	0,00	5,630 % fällig am 25.03.2036	2.393	2.230	0,00	6,950 % fällig am 25.12.2034	8.743	8.602	0,01
5,975 % fällig am 25.08.2034	548	500	0,00	5,645 % fällig am 25.03.2036	5.146	4.757	0,01	7,025 % fällig am 25.12.2034	6.871	6.140	0,01
6,050 % fällig am 25.08.2034	1.082	1.031	0,00	5,810 % fällig am 25.11.2035	3.981	3.767	0,01	7,250 % fällig am 25.09.2034	107	92	0,00
6,065 % fällig am 25.07.2034	389	388	0,00	5,810 % fällig am 25.10.2036 ^	7.122	1.610	0,00	Penta CLO DAC			
6,065 % fällig am 25.03.2035	326	322	0,00	5,915 % fällig am 25.05.2035	1.664	1.621	0,00	4,211 % fällig am 25.01.2033	€ 10.000	10.679	0,02
6,080 % fällig am 25.11.2034	1.242	1.211	0,00	5,950 % fällig am 25.02.2037 ^	9.883	2.944	0,01	People's Choice Home Loan Securities Trust			
6,080 % fällig am 25.02.2035	2.224	1.980	0,00	6,492 % fällig am 25.02.2037 ^	5.287	1.503	0,00	5,830 % fällig am 25.12.2035 ^	\$ 6.467	6.162	0,01
6,095 % fällig am 25.01.2035	3.746	3.293	0,01	6,532 % fällig am 25.10.2036 ^	2.657	638	0,00	6,005 % fällig am 25.08.2035	5.159	4.843	0,01
6,150 % fällig am 25.07.2037	6.450	6.267	0,01	NevoStar Mortgage Funding Trust				6,095 % fällig am 25.05.2035 ^	678	609	0,00
6,170 % fällig am 25.08.2034	4	4	0,00	5,300 % fällig am 25.03.2037	3.093	1.100	0,00	6,125 % fällig am 25.05.2035	7.624	4.426	0,01
6,200 % fällig am 25.04.2035	2.170	2.019	0,00	5,330 % fällig am 25.03.2037	26.588	9.452	0,02	People's Financial Realty Mortgage Securities Trust			
6,200 % fällig am 25.06.2035 ^	3.175	2.851	0,01	5,330 % fällig am 25.09.2037	3.655	3.338	0,01	5,390 % fällig am 25.09.2036	10.753	2.118	0,00
6,400 % fällig am 25.07.2037	8.600	7.209	0,01	5,350 % fällig am 25.09.2037	9.942	9.634	0,02	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust			
6,950 % fällig am 25.05.2034	433	404	0,00	5,450 % fällig am 25.06.2036	2.845	2.002	0,00	3,467 % fällig am 25.11.2035	314	308	0,00
7,775 % fällig am 25.03.2034	794	764	0,00	5,450 % fällig am 25.09.2036	5.204	2.257	0,00	5,410 % fällig am 25.11.2036	589	583	0,00
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				5,470 % fällig am 25.06.2036	3.056	2.989	0,01	5,460 % fällig am 25.06.2047 ^	888	821	0,00
5,690 % fällig am 25.02.2036	3.568	3.139	0,01	5,490 % fällig am 25.11.2036	1.281	401	0,00	5,645 % fällig am 25.07.2036	2.258	2.115	0,00
5,690 % fällig am 25.03.2036	9.534	7.721	0,01	5,490 % fällig am 25.01.2037	19.066	6.681	0,01	5,735 % fällig am 25.02.2036	1.441	1.415	0,00
5,705 % fällig am 25.01.2036	2.869	2.215	0,00	5,690 % fällig am 25.05.2036	400	374	0,00	5,917 % fällig am 25.04.2035	1.431	1.354	0,00
5,730 % fällig am 25.01.2036	1.498	1.434	0,00	5,840 % fällig am 25.01.2036	5.700	5.241	0,01	Pretium Mortgage Credit Partners LLC			
5,730 % fällig am 25.02.2036	209	205	0,00	5,855 % fällig am 25.01.2036	943	932	0,00	2,240 % fällig am 27.09.2060	10.766	10.177	0,02
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				5,870 % fällig am 25.10.2035	2.653	2.603	0,00	Project Silver			
5,320 % fällig am 25.04.2037	16.626	8.722	0,01	5,885 % fällig am 25.01.2036	5.000	4.661	0,01	3,967 % fällig am 15.07.2044	17.539	15.068	0,02
5,470 % fällig am 25.04.2036	6.732	4.743	0,01	5,975 % fällig am 25.06.2034	1.591	1.534	0,00	RAAC Trust			
5,660 % fällig am 25.02.2036	5.534	4.992	0,01	6,875 % fällig am 25.12.2034	770	674	0,00	5,420 % fällig am 25.05.2036	144	140	0,00
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				7,025 % fällig am 25.03.2035	2.983	2.929	0,01	5,650 % fällig am 25.02.2037	2.492	2.385	0,00
5,200 % fällig am 25.11.2036	1	0	0,00	Oakwood Mortgage Investors, Inc.	133	126	0,00	5,750 % fällig am 25.06.2044	1.232	1.022	0,00
5,220 % fällig am 25.11.2036	6.924	2.445	0,00	Option One Mortgage Loan Trust				5,800 % fällig am 25.06.2047	1.967	1.901	0,00
5,300 % fällig am 25.11.2036	5.693	2.012	0,00	5,250 % fällig am 25.07.2036	2.065	928	0,00	5,840 % fällig am 25.11.2036	300	299	0,00
5,370 % fällig am 25.11.2036	1.558	551	0,00	5,270 % fällig am 25.03.2037	6.015	5.676	0,01	5,910 % fällig am 25.10.2046	2.035	1.928	0,00
5,450 % fällig am 25.07.2036	13.661	5.566	0,01	5,280 % fällig am 25.07.2037	11.283	7.251	0,01	6,005 % fällig am 25.03.2037	886	879	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				5,290 % fällig am 25.01.2037	17.049	11.040	0,02	6,350 % fällig am 25.10.2045	141	137	0,00
5,310 % fällig am 25.11.2036	1.401	438	0,00	5,290 % fällig am 25.02.2037	19.767	12.993	0,02	Raptor Aircraft Finance LLC			
5,390 % fällig am 25.04.2037	14.896	4.383	0,01	5,290 % fällig am 25.03.2037	13.988	8.020	0,01	4,213 % fällig am 23.08.2044	47.428	37.353	0,06
5,490 % fällig am 25.10.2036	8.126	2.502	0,00	5,320 % fällig am 25.05.2037	20.038	10.985	0,02	Renaissance Home Equity Loan Trust			
5,490 % fällig am 25.11.2036	4.559	1.420	0,00	5,330 % fällig am 25.04.2037	669	336	0,00	5,285 % fällig am 25.01.2037	2.814	979	

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,612 % fällig am 25.04.2037	\$ 5.992	\$ 1.706	0,00	Saxon Asset Securities Trust	\$ 2.994	\$ 2.867	0,01	5,600 % fällig am 25.05.2036	\$ 10.343	\$ 8.122	0,01
5,675 % fällig am 25.06.2037 ^	421	122	0,00	1,501 % fällig am 25.11.2035		3.471	0,01	5,615 % fällig am 25.02.2036	3.890	3.536	0,01
5,731 % fällig am 25.11.2036	4.836	1.822	0,00	1,942 % fällig am 25.05.2035		3.960	0,01	5,615 % fällig am 25.06.2036 ^	7.736	6.357	0,01
5,742 % fällig am 25.04.2037	16.856	4.816	0,01	3,831 % fällig am 25.06.2035		3.464	0,01	5,630 % fällig am 25.07.2036	22.931	19.583	0,03
5,744 % fällig am 25.06.2037 ^	5.934	1.740	0,00	5,330 % fällig am 25.05.2037		2.532	0,00	5,650 % fällig am 25.10.2036	12.593	11.759	0,02
5,746 % fällig am 25.05.2036	2.134	1.059	0,00	5,350 % fällig am 25.05.2047		8.831	0,01	5,650 % fällig am 25.11.2036	2.978	2.765	0,00
5,761 % fällig am 25.04.2037	2.781	797	0,00	5,460 % fällig am 25.09.2037		9.438	0,01	5,668 % fällig am 25.03.2036	6.864	5.594	0,01
5,762 % fällig am 25.08.2036	8.258	3.290	0,01	5,550 % fällig am 25.09.2047		3.640	0,01	5,675 % fällig am 25.03.2036	504	499	0,00
5,797 % fällig am 25.08.2036	12.841	5.228	0,01	5,600 % fällig am 25.09.2036 ^		7.983	0,01	5,710 % fällig am 25.10.2036	3.665	3.547	0,01
5,812 % fällig am 25.11.2036	8.748	3.340	0,01	5,630 % fällig am 25.10.2046		1.480	0,00	5,840 % fällig am 25.12.2035	8.776	7.814	0,01
5,857 % fällig am 25.05.2035	2.071	1.729	0,00	5,640 % fällig am 25.09.2047		5.418	0,01	5,900 % fällig am 25.01.2035	480	431	0,00
5,879 % fällig am 25.06.2037 ^	2.974	893	0,00	5,810 % fällig am 25.10.2035		3.657	0,01	5,990 % fällig am 25.06.2035 ^	4.602	4.011	0,01
5,890 % fällig am 25.08.2035	2.790	2.449	0,00	5,870 % fällig am 25.11.2037		2.500	0,02	6,050 % fällig am 25.10.2037	16.813	13.269	0,02
5,893 % fällig am 25.06.2037 ^	28.633	8.624	0,01	6,125 % fällig am 26.12.2034		629	0,00	6,080 % fällig am 25.11.2035	57	57	0,00
5,906 % fällig am 25.06.2037	7.657	2.311	0,00	6,900 % fällig am 25.12.2037		7.596	0,01	6,100 % fällig am 25.09.2037	1.733	1.356	0,00
5,910 % fällig am 25.12.2032	41	37	0,00	SBA Tower Trust	5.000	4.848	0,01	6,125 % fällig am 25.03.2036	3.410	2.974	0,01
6,011 % fällig am 25.05.2036	3.091	1.601	0,00	3,869 % fällig am 15.10.2049				6,150 % fällig am 25.09.2037	4.192	2.849	0,01
6,120 % fällig am 25.11.2036	11.903	4.777	0,01	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust	150	36	0,00	6,185 % fällig am 25.05.2035	652	640	0,00
6,166 % fällig am 25.05.2036	3.374	1.791	0,00	5,270 % fällig am 25.12.2036 ^		8	0,00	6,230 % fällig am 25.07.2035	532	526	0,00
6,511 % fällig am 25.07.2034	1.197	1.029	0,00	5,280 % fällig am 25.05.2037 ^		2.774	0,01	6,250 % fällig am 25.09.2037	1.565	1.225	0,00
6,998 % fällig am 25.09.2037 ^	9.381	4.089	0,01	5,310 % fällig am 25.08.2036		4.892	0,01	Southern Pacific Secured Asset Corp.	64	59	0,00
7,238 % fällig am 25.09.2037 ^	9.551	4.161	0,01	5,350 % fällig am 25.05.2037 ^		3.303	0,01	5,550 % fällig am 25.03.2028			
Residential Asset Mortgage Products Trust				5,410 % fällig am 25.12.2036		7.522	0,01	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
5,500 % fällig am 25.10.2036	4.320	4.043	0,01	5,430 % fällig am 25.05.2036		635	0,00	3,597 % fällig am 25.09.2037	3.242	1.092	0,00
5,610 % fällig am 25.12.2035	540	433	0,00	5,430 % fällig am 25.06.2036		4.112	0,01	3,863 % fällig am 25.09.2037	7.355	6.480	0,01
5,660 % fällig am 25.03.2036	1.155	1.113	0,00	5,430 % fällig am 25.09.2036		6.163	0,01	5,270 % fällig am 25.04.2037	789	540	0,00
5,690 % fällig am 25.02.2036	3.799	3.580	0,01	5,430 % fällig am 25.01.2037		5.236	0,01	5,350 % fällig am 25.04.2037	2.969	2.050	0,00
5,710 % fällig am 25.07.2036	936	928	0,00	5,450 % fällig am 25.03.2036		2.631	0,00	5,450 % fällig am 25.06.2037	1.828	1.056	0,00
5,795 % fällig am 25.02.2036	500	467	0,00	5,450 % fällig am 25.09.2036		5.828	0,01	5,450 % fällig am 25.11.2037	8.930	4.976	0,01
5,830 % fällig am 25.12.2035	5.119	4.440	0,01	5,450 % fällig am 25.12.2036		551	0,00	5,500 % fällig am 25.03.2037	1.563	879	0,00
5,930 % fällig am 25.07.2035	126	125	0,00	5,470 % fällig am 25.09.2036		1.659	0,01	5,500 % fällig am 25.04.2037	424	296	0,00
5,930 % fällig am 25.09.2035	1.533	1.392	0,00	5,470 % fällig am 25.10.2036		12.271	0,01	6,125 % fällig am 25.12.2035	1.351	1.324	0,00
6,095 % fällig am 25.10.2035	2.856	2.327	0,00	5,490 % fällig am 25.08.2036 ^		1.035	0,00	St. Paul's CLO DAC			
6,125 % fällig am 25.07.2035	1.906	1.781	0,00	5,590 % fällig am 25.01.2037		7.523	0,01	4,097 % fällig am 15.04.2033	€ 1.200	1.280	0,00
6,170 % fällig am 25.05.2035	880	867	0,00	5,630 % fällig am 25.07.2036		482	0,00	START Ltd.			
6,200 % fällig am 25.08.2035	2.035	1.984	0,00	5,690 % fällig am 25.03.2036		2.985	0,01	4,089 % fällig am 15.03.2044	\$ 12.408	10.943	0,02
6,215 % fällig am 25.05.2035	2.457	2.300	0,00	5,750 % fällig am 25.11.2035		1.895	0,00	Starwood Commercial Mortgage Trust			
6,275 % fällig am 25.06.2035	2.600	2.465	0,00	5,795 % fällig am 25.10.2035		547	0,00	6,296 % fällig am 15.07.2038	17.408	17.261	0,03
6,350 % fällig am 25.01.2035 ^	2.470	2.257	0,00	5,825 % fällig am 25.01.2035		2.927	0,00	6,616 % fällig am 15.07.2038	14.830	14.089	0,02
Residential Asset Securities Corp. Trust				5,870 % fällig am 25.10.2035		637	0,00	6,816 % fällig am 15.07.2038	5.930	5.650	0,01
4,754 % fällig am 25.04.2034	480	461	0,00	6,035 % fällig am 25.10.2035		4.890	0,01	Structured Asset Investment Loan Trust			
4,906 % fällig am 25.06.2034	1.846	1.787	0,00	6,110 % fällig am 25.01.2036 ^		23.205	0,01	5,280 % fällig am 25.07.2036	718	516	0,00
5,358 % fällig am 25.01.2037	6.581	5.512	0,01	6,110 % fällig am 25.01.2036 ^		3.621	0,00	5,300 % fällig am 25.07.2036	2.557	2.470	0,00
5,370 % fällig am 25.01.2037	3.804	3.510	0,01	Segovia European CLO DAC	€ 4.600	4.988	0,01	5,323 % fällig am 25.07.2036	15.556	9.276	0,02
5,370 % fällig am 25.02.2037	6.826	6.511	0,01	4,080 % fällig am 20.07.2032	€	2.076	0,00	5,470 % fällig am 25.05.2036	221	213	0,00
5,410 % fällig am 25.07.2036	27	27	0,00	SG Mortgage Securities Trust	\$ 23.205	1.905	0,00	5,530 % fällig am 25.03.2036	1.628	1.576	0,00
5,430 % fällig am 25.07.2036	3.837	3.612	0,01	5,470 % fällig am 25.07.2036	\$	921	0,00	5,700 % fällig am 25.09.2034	3.970	3.700	0,01
5,430 % fällig am 25.09.2036	3.589	3.490	0,01	5,510 % fällig am 25.02.2036		842	0,00	5,750 % fällig am 25.04.2036	8.832	4.753	0,01
5,490 % fällig am 25.04.2037	6.836	6.354	0,01	5,690 % fällig am 25.02.2036		1.083	0,00	5,770 % fällig am 25.01.2036	3.791	3.491	0,01
5,570 % fällig am 25.06.2036	40	39	0,00	5,855 % fällig am 25.10.2035		13.999	0,02	5,780 % fällig am 25.11.2035	6.873	6.582	0,01
5,585 % fällig am 25.06.2036	3.422	3.263	0,01	6,035 % fällig am 25.10.2035		2.260	0,00	5,855 % fällig am 25.03.2034	166	160	0,00
5,660 % fällig am 25.04.2036	5.275	4.609	0,01	SLM Private Credit Student Loan Trust	13.999	13.454	0,02	5,870 % fällig am 25.04.2033	566	554	0,00
5,690 % fällig am 25.07.2036	2.403	2.066	0,00	SLM Student Loan Trust	€ 2.260	2.300	0,00	5,870 % fällig am 25.04.2035	2.703	2.639	0,00
5,710 % fällig am 25.04.2036	1.251	1.220	0,00	3,651 % fällig am 25.10.2039	€	13.085	0,02	5,870 % fällig am 25.07.2035	283	265	0,00
5,735 % fällig am 25.03.2036	2.561	2.523	0,00	3,811 % fällig am 25.07.2039		24.561	0,04	5,870 % fällig am 25.09.2035	1.520	1.488	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036	1.410	1.382	0,00	3,811 % fällig am 25.01.2040		9.772	0,02	5,870 % fällig am 25.10.2035	118	114	0,00
5,765 % fällig am 25.11.2035	98	93	0,00	4,076 % fällig am 15.12.2033		7.249	0,01	5,870 % fällig am 25.01.2036	4.125	3.938	0,01
5,780 % fällig am 25.02.2036	2.810	2.625	0,00	6,955 % fällig am 25.07.2023	\$	1.333	0,00	5,900 % fällig am 25.07.2035	1.568	1.504	0,00
5,795 % fällig am 25.03.2035	153	152	0,00	SMB Private Education Loan Trust	1.333	1.320	0,00	5,915 % fällig am 25.08.2035	1.939	1.838	0,00
5,810 % fällig am 25.11.2035	761	756	0,00	5,993 % fällig am 15.02.2036		15.343	0,02	6,050 % fällig am 25.05.2035	4.128	4.016	0,01
5,810 % fällig am 25.12.2035	3.988	3.784	0,01	SoFi Alternative Trust	16.081	16.167	0,03	6,080 % fällig am 25.01.2035	4.584	4.431	0,01
5,830 % fällig am 25.05.2037	1.182	1.153	0,00	3,491 % fällig am 15.06.2050		16.811	0,03	6,080 % fällig am 25.06.2035	5.691	5.354	0,01
5,840 % fällig am 25.11.2035	997	979	0,00	3,688 % fällig am 16.05.2050		3.462	0,01	6,150 % fällig am 25.09.2034	3.363	3.286	0,01
5,855 % fällig am 25.09.2035	895	837	0,00	Solosso CDO Ltd.	3.722	3.462	0,01	6,275 % fällig am 25.07.2033	370	364	0,00
5,855 % fällig am 25.10.2035	2.047	1.687	0,00	5,471 % fällig am 07.10.2037		2.197	0,00	6,350 % fällig am 25.12.2034	388	383	0,00
5,855 % fällig am 25.11.2035	476	455	0,00	Soundview Home Loan Trust	3.262	2.529	0,00	6,378 % fällig am 25.09.2034	354	340	0,00
5,870 % fällig am 25.01.2036	4.882	4.707	0,01	5,230 % fällig am 25.06.2037		4.952	0,01	6,425 % fällig am 25.12.2034	1.302	1.249	0,00
6,020 % fällig am 25.11.2035	3.825	3.091	0,01	5,270 % fällig am 25.11.2036		11.652	0,02	6,530 % fällig am 25.04.2033	13	12	0,00
6,110 % fällig am 25.08.2035	3.088	3.029	0,01	5,300 % fällig am 25.03.2037		6.467	0,01	6,650 % fällig am 25.11.2034	699	697	0,00
6,185 % fällig am 25.10.2035	2.013	1.893	0,00	5,300 % fällig am 25.06.2037		8.033	0,01	Structured Asset Securities Corp.			
6,395 % fällig am 25.03.2035	1.010	956	0,00	5,320 % fällig am 25.07.2037		5.555	0,01	4,273 % fällig am 25.02.2035	1.691	1.660	0,00
6,950 % fällig am 25.04.2035	653	623	0,00	5,320 % fällig am 25.08.2037		6.520	0,01	6,290 % fällig am 25.02.2035	584	560	0,00





BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- NETTO- WERT VERMÖ- (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (e)	26.868.244	\$ 36.809	0,06
iHeartMedia, Inc. 'A' (e)	6.332.872	23.052	0,04
iHeartMedia, Inc. 'B' (e)	4.913.662	16.097	0,02
Intelsat Emergency S.A. (e)(m)	4.649.159	106.931	0,16
		182.889	0,28
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (e)(m)	1.179.713	179.237	0,28
<b>ENERGIE</b>			
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (e)(m)	3.258.324	353	0,00
<b>FINANZWERTE</b>			
Cairo Mezz PLC (e)	3.408.327	446	0,00
Eurobank Ergasias Services and Holdings S.A. 'A' (e)	32.351.328	53.292	0,08
Stearns Holdings LLC 'B' (e)	1.114.539	0	0,00
UBS Group AG	126.509	2.565	0,01
Voyager Aviation Holdings LLC (e)	2.155	0	0,00
		56.303	0,09
<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
Sierra Hamilton Holder LLC (e)(m)	2.210.032	0	0,00
Westmoreland Mining Holdings LLC (e)(m)	82.938	374	0,00
		374	0,00
<b>IMMOBILIEN</b>			
Adler Group S.A. (e)	10.156	5	0,00
Adler Group S.A.	22.487	14	0,00
		19	0,00
		419.175	0,65
<b>RECHTE</b>			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025	1.026.237	6.078	0,01
<b>OPTIONSSCHEINE</b>			
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071 (m)	4	0	0,00
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31.12.2060	5.339	0	0,00
Intelsat Emergency S.A. - Exp. 17.02.2027	160.093	250	0,00
Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21.09.2055	2.022.886	30.970	0,05
		31.220	0,05
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>			
Nationwide Building Society 10,250 %	859.974	125.965	0,20
Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	12.927	3.117	0,00
		129.082	0,20

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- NETTO- WERT VERMÖ- (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>			
CBL & Associates Properties, Inc.	95.496	2.105	0,00
Uniti Group, Inc.	726.414	3.356	0,01
VICI Properties, Inc.	5.793.243	182.081	0,28
		187.542	0,29
<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
American Electric Power Co., Inc. 5,440 % fällig am 07.08.2023	14.200	\$ 14.118	0,02
5,440 % fällig am 08.08.2023	11.900	11.829	0,02
Arrow Electronics, Inc. 5,730 % fällig am 18.07.2023	10.800	10.769	0,02
Bacardi-Martini BV 5,750 % fällig am 12.07.2023	1.100	1.098	0,00
Conagra Foods, Inc. 5,600 % fällig am 20.07.2023	30.000	29.904	0,05
Constellation Brands, Inc. 5,580 % fällig am 21.07.2023	1.500	1.495	0,00
5,580 % fällig am 25.07.2023	4.800	4.781	0,01
Constellation Energy Corp. 5,300 % fällig am 13.07.2023	11.700	11.675	0,02
CVS Health Corp. 5,280 % fällig am 06.07.2023	18.400	18.384	0,03
Dominion Resources, Inc. 5,430 % fällig am 31.07.2023	27.600	27.472	0,04
5,500 % fällig am 15.08.2023	1.950	1.936	0,00
5,520 % fällig am 18.08.2023	21.950	21.786	0,03
Duke Energy Corp. 5,400 % fällig am 08.08.2023	22.600	22.466	0,04
Enbridge, Inc. 5,450 % fällig am 25.07.2023	13.300	13.249	0,02
5,500 % fällig am 26.07.2023	15.500	15.438	0,02
Enel Finance America LLC 5,450 % fällig am 26.07.2023	11.500	11.456	0,02
Global Payments, Inc. 5,930 % fällig am 26.07.2023	22.100	22.006	0,03
5,930 % fällig am 28.07.2023	65.800	65.500	0,10
Humana, Inc. 5,430 % fällig am 20.07.2023	4.500	4.486	0,01
5,500 % fällig am 01.08.2023	9.800	9.751	0,02
5,510 % fällig am 02.08.2023	11.800	11.740	0,02
5,510 % fällig am 03.08.2023	8.200	8.157	0,01
Internal FLV+FGR, Inc. 6,000 % fällig am 28.07.2023	12.600	12.547	0,02
Keurig Dr Pepper, Inc. 5,250 % fällig am 05.07.2023	47.800	47.766	0,07
5,350 % fällig am 20.07.2023	26.400	26.322	0,04
McCormick & Co., Inc. 5,350 % fällig am 25.07.2023	9.800	9.763	0,02
Mondelēz International, Inc. 5,370 % fällig am 24.07.2023	22.300	22.221	0,03
5,370 % fällig am 25.07.2023	22.300	22.218	0,03
Penske Truck Leasing Co. LP 5,350 % fällig am 14.07.2023	3.900	3.892	0,01
Quanta Services, Inc. 5,900 % fällig am 17.07.2023	9.150	9.126	0,01
5,900 % fällig am 18.07.2023	20.850	20.791	0,03
Targa Resources Corp. 5,950 % fällig am 26.07.2023	13.800	13.749	0,02
VW Credit, Inc. 5,400 % fällig am 26.07.2023	25.200	25.102	0,04
5,430 % fällig am 27.07.2023	55.900	55.673	0,09
5,440 % fällig am 02.08.2023	3.000	2.985	0,00
Walgreens Boots Alliance 5,850 % fällig am 10.07.2023 (c)	35.800	35.743	0,06
Waste Management, Inc. 5,400 % fällig am 09.08.2023	10.600	10.536	0,02
		657.930	1,02

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- NETTO- WERT VERMÖ- (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
Corestate Capital Holding S.A. 15,000 % fällig am 31.07.2023 (m)	€ 1.000	1.102	0,00
<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
(54,756) % fällig am 18.09.2023 (f)(g)	ARS 11.858.799	23.564	0,03
(28,578) % fällig am 18.10.2023 (f)(g)	15.279.143	30.196	0,05
(12,549) % fällig am 23.11.2023 (f)(g)	6.230.659	12.569	0,02
2,749 % fällig am 18.09.2023 (f)(g)	6.904.764	13.720	0,02
		80.049	0,12
<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
(0,211) % fällig am 24.07.2023 (f)(g)	¥ 11.876.000	\$ 82.173	0,13
(0,206) % fällig am 18.07.2023 (f)(g)	10.461.000	72.381	0,11
(0,202) % fällig am 28.08.2023 (f)(g)	50.000.000	346.005	0,54
(0,200) % fällig am 28.08.2023 (f)(g)	2.655.000	18.373	0,03
(0,199) % fällig am 11.09.2023 (f)(g)	48.697.000	337.004	0,52
(0,197) % fällig am 31.07.2023 (f)(g)	4.484.000	31.027	0,05
(0,190) % fällig am 04.09.2023 (f)(g)	15.632.000	108.177	0,17
(0,189) % fällig am 23.08.2023 (f)(g)	19.398.000	134.236	0,21
(0,188) % fällig am 13.07.2023 (f)(g)	4.926.000	34.083	0,05
(0,188) % fällig am 28.08.2023 (f)(g)	74.527.000	515.734	0,80
(0,182) % fällig am 24.07.2023 (f)(g)	6.304.000	43.619	0,07
(0,179) % fällig am 11.09.2023 (f)(g)	28.020.000	193.910	0,30
(0,178) % fällig am 31.07.2023 (f)(g)	2.421.000	16.752	0,03
(0,173) % fällig am 19.09.2023 (f)(g)	12.646.000	87.518	0,13
(0,172) % fällig am 19.09.2023 (f)(g)	10.232.000	70.812	0,11
(0,170) % fällig am 04.09.2023 (f)(g)	12.340.000	85.396	0,13
(0,169) % fällig am 19.09.2023 (f)(g)	268.000	1.855	0,00
(0,153) % fällig am 19.09.2023 (f)(g)	16.506.000	114.232	0,18
(0,152) % fällig am 25.09.2023 (f)(g)	15.798.000	109.334	0,17
(0,132) % fällig am 25.09.2023 (f)(g)	21.579.000	149.344	0,23
		2.551.965	3,96
Summe kurzfristige Instrumente		3.291.046	5,10
<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>			
		\$ 79.018.485	122,45
<b>AKTIEN</b>			
<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (j)	220.495.538	2.195.687	3,40
<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (j)	2.903.000	288.355	0,45
Summe Investmentfonds		\$ 2.484.042	3,85

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	4,660 %	30.06.2023	05.07.2023	CAD 500.000	Canada Government International Bond 2,500 % fällig am 01.12.2032 Province of Quebec 1,900 % - 2,750 % fällig am 01.09.2027 - 01.09.2030	\$ (225.563)	\$ 377.858	\$ 378.177	0,59
	5,080	30.06.2023	07.07.2023	\$ 500.000	U.S. Treasury Notes 0,250 % - 1,875 % fällig am 31.07.2025 - 31.07.2026	(161.448)			
BRC	5,120	30.06.2023	03.07.2023	417.900	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.04.2025	(426.648)	417.900	500.494	0,78
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	122.098	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(124.540)	122.098	122.122	0,19
MBC	5,130	28.06.2023	05.07.2023	200.000	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 01.08.2023	(144.409)	200.000	200.200	0,31
	5,150	30.06.2023	07.07.2023	150.000	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042 U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.12.2023	(10.645)			
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	208.100	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 - 15.07.2030 U.S. Treasury Notes 0,250 % - 2,250 % fällig am 15.11.2024 - 30.09.2025	(60.417)	150.000	150.150	0,23
	5,140	30.06.2023	03.07.2023	105.100	U.S. Treasury Notes 3,875 % - 4,125 % fällig am 30.11.2027 - 15.11.2032	(214.861)	208.100	208.189	0,32
NXN	5,140	30.06.2023	03.07.2023	105.100	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2049	(108.590)	105.100	105.145	0,16
SOG	5,130	31.05.2023	TBD <sup>(2)</sup>	9.545	American International Group, Inc. 4,800 % fällig am 10.07.2045 Amgen, Inc. 3,625 % fällig am 22.05.2024 Barclays PLC 4,337 % fällig am 10.01.2028 Morgan Stanley 1,593 % fällig am 04.05.2027	(3.115)	9.545	9.545	0,01
						(1.966)			
						(3.300)			
						(1.791)			
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (2.141.823)	\$ 2.090.601	\$ 2.092.100	3,24

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

<sup>(2)</sup> Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	2.299	\$ 15.355	0,02
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	1.188	5.242	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	1.289	4.198	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	1.498	8.763	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	1.206	4.402	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	1.990	12.742	0,02
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	1.087	4.306	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	1.206	3.704	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	1.390	7.087	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	986	3.368	0,01
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	230	89	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	3.629	4.846	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	793	(2.238)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	3.439	(7.380)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	17.853	(15.340)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	881	(1.080)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	6.124	(589)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	6.106	(11.324)	(0,02)
				\$ 36.151	0,06

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	1.147	\$ (500)	\$ (431)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	1.147	(402)	(57)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	335	(129)	(51)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	335	(172)	(66)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	1.518	(2.502)	(110)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	1.602	(3.282)	(336)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	1.518	(2.806)	(309)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	2.276	(4.434)	(134)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	2.276	(4.742)	(374)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	1.218	(359)	(63)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	1.518	(2.882)	(5.356)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	1.602	(3.122)	(5.896)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	1.518	(2.920)	(5.815)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	2.276	(4.499)	(9.053)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	2.276	(4.833)	(10.038)	(0,02)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	1.218	(479)	(5.737)	(0,01)
				\$ (38.063)	\$ (43.826)	(0,07)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (7.675)	(0,01)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(4)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(5)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.06.2028	€ 13.400	\$ (94)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	\$ 11.100	(109)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	69.900	313	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	9.500	(58)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	9.400	(84)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	4.300	31	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2023	€ 25.600	(1)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	\$ 20.400	95	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2024	5.570	174	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2025	11.800	263	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	11.700	292	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	12.100	(496)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2026	3.300	(78)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2026	4.400	(148)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2027	3.300	(14)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2024	18.900	(8)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2024	44.900	(258)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	24.800	(225)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2025	25.300	953	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	8.200	(159)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2026	6.600	(123)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	11.500	(102)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	109.900	6.087	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	7.600	198	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	53.500	148	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	6.700	(7)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 10.000	641	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	25.100	2.210	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2026	41.400	2.428	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2026	114.700	2.386	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2027	18.100	923	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 6.700	(102)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	32.300	(539)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	34.900	122	0,00
				\$ 14.659	0,03

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2025	\$ 107.200	\$ 1.063	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-30 5-Year Index	1,000 %	20.12.2023	\$ 378.250	\$ 6.617	0,01
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000	20.06.2024	99.588	4.024	0,01
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	71.910	3.328	0,01
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	218.224	4.447	0,01
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	1.380	20	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	705.640	37.066	0,05
CDX.EM-37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	6.958	322	0,00
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	98.900	4.258	0,01
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	194.100	5.117	0,01
CDX.HY-34 5-Year Index	5,000	20.06.2025	5.040	(255)	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000	20.12.2025	8.330	(350)	0,00
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	417.578	6.815	0,01
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	149.646	(651)	0,00
CDX.HY-38 5-Year Index	5,000	20.06.2027	27.146	1.263	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	675.675	12.116	0,01
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	4.399.800	122.269	0,19
CDX.IG-37 5-Year Index	1,000	20.12.2026	1.400	(10)	0,00
CDX.IG-38 5-Year Index	1,000	20.06.2027	400	3	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	12.700	37	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	99.700	719	0,00
				\$ 207.155	0,32

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.09.2030	£ 254.700	\$ 23.157	0,04
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,060	21.02.2052	14.400	(8.598)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,096	14.02.2052	31.300	(18.473)	(0,03)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,101	21.02.2052	14.400	(8.469)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175	28.02.2052	28.800	(16.436)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	903.200	65.793	0,10
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	20.09.2026	¥ 48.830.000	(4.125)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	344.670.000	(6.871)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,020	20.09.2028	395.820.000	32.006	0,05
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	22.270.000	146	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	52.440.000	(349)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	27.980.000	(393)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	5.840.000	43	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.07.2023	\$ 212.800	2.894	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	18.07.2023	157.300	2.127	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	26.07.2023	154.700	2.098	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	7.957.500	109.789	0,17
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	09.08.2023	22.000	(304)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	06.09.2023	344.400	4.796	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.09.2023	324.000	(4.522)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	1.456.600	(20.781)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	33.800	482	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	30.09.2023	1.155.100	(16.017)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	1.090.500	(79.704)	(0,12)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	2.503.737	(241.629)	(0,37)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,550	15.01.2031	4.567.800	982.369	1,52
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,674	05.08.2030	62.900	12.876	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,678	29.07.2030	65.200	13.342	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,711	28.07.2030	69.000	14.019	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,715	27.07.2030	200.000	40.617	0,06
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	30.03.2031	963.600	196.348	0,30
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	3.358.883	(367.694)	(0,57)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,800	15.01.2051	1.479.300	713.175	1,10
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,928	06.05.2026	150.100	14.456	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,975	17.06.2052	52.200	17.761	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,990	24.06.2052	75.000	25.185	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	26.01.2024	154.700	(4.747)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	386.590	30.986	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	495.770	49.020	0,08
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	120.615	21.044	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,035	28.06.2052	25.900	8.466	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,144	04.11.2050	49.600	(19.562)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,150	30.03.2051	191.500	2.818	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,215	13.10.2050	83.500	(32.963)	(0,05)



Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,235 %	12.05.2028	\$ 75.400	\$ 9.529	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	1.654.500	(176.098)	(0,27)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	15.560	2.146	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	635.270	(58.442)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	1.456.600	314.245	0,49
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	7.957.500	(130.424)	(0,20)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,280	24.03.2028	423.400	(48.033)	(0,07)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,306	02.11.2051	48.000	15.261	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,317	16.12.2050	33.800	(12.597)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,350	20.01.2027	109.100	10.887	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	15.02.2027	387.430	37.853	0,06
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	20.07.2031	91.400	15.994	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,370	19.07.2031	61.300	10.688	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	212.800	(22.159)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,405	07.09.2031	154.300	26.370	0,04
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,418	20.01.2027	71.900	(6.903)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,420	24.02.2027	269.100	25.624	0,04
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	146.000	(13.861)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,443	18.01.2027	157.300	(15.843)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	361.600	34.255	0,05
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	137.000	23.438	0,04
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,485	13.01.2051	78.100	(27.380)	(0,04)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	473.684	(65.682)	(0,10)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	12.01.2029	85.443	10.864	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	05.10.2031	89.100	(14.695)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	43.100	(5.328)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	88.600	(14.370)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	22.10.2031	59.100	(9.528)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,545	26.10.2031	58.900	(9.457)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,550	20.01.2027	485.100	(43.633)	(0,07)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,570	11.01.2027	121.400	(11.060)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,570	12.01.2027	76.200	(6.944)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,573	28.02.2027	96.300	(9.321)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	150.400	(13.220)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,595	13.01.2051	82.600	(27.264)	(0,04)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	943.900	34.589	0,05
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	15.02.2027	1.549.700	(134.234)	(0,21)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,618	09.02.2029	27.100	(3.271)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,620	18.04.2027	153.700	(14.029)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	60.000	(7.090)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	72.000	(8.448)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	24.02.2027	897.000	(75.618)	(0,12)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	08.02.2032	91.900	(13.952)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,655	24.01.2032	72.000	(11.214)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	06.03.2024	344.400	(8.167)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	1.446.200	(120.063)	(0,19)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	12.01.2029	310.700	(35.290)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	86.300	(12.502)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,735	12.01.2032	57.800	(8.723)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	190.144	9.856	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	209.290	10.754	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	96.400	(7.381)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	30.400	(4.262)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,770	14.02.2032	81.500	(11.616)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	114.300	(9.672)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	76.100	24.140	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	114.800	(9.643)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,815	24.01.2052	14.400	(4.220)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	318.600	(42.961)	(0,07)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,867	26.01.2052	14.400	(4.071)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,872	06.04.2032	160.000	(20.862)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	159.500	(13.114)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,945	23.06.2051	127.800	35.483	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,988	09.02.2032	22.000	2.908	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	193.480	4.494	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	910.590	20.739	0,03
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	18.02.2032	133.700	(16.784)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	1.477.810	34.423	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	324.000	7.909	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,008	09.02.2032	36.700	4.703	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,185	21.04.2029	96.000	(8.304)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	678.900	24.629	0,04
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	1.204.900	28.135	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,370	21.06.2027	159.400	(9.426)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	26.800	2.201	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,430	30.09.2027	230.020	17.758	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	2.408.100	57.132	0,09
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	221.690	16.907	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,451	08.06.2032	90.600	7.087	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,605	28.06.2027	158.600	(7.813)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,680	11.07.2032	27.300	(1.847)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,690	11.07.2032	27.300	(1.818)	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,850 %	30.08.2027	\$ 137.400	\$ (7.192)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,880	30.09.2027	657.200	(32.153)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	633.400	(30.567)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,955	04.10.2027	141.800	(6.523)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	2.179.420	63.299	0,10
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	710.885	22.496	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	69.900	(3.016)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	69.900	(3.016)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	104.600	(4.504)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	29.400	(538)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	70.000	(2.804)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	2.045.860	60.887	0,09
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	54.100	(1.279)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	86.000	(2.133)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	28.200	847	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	52.300	(886)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	49.800	(735)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	53.700	(758)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,420	24.05.2033	88.200	(824)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	53.900	(695)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	53.600	(664)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	109.100	(1.184)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	102.500	(1.720)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2026	195.110	4.168	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	175.800	(1.569)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.05.2033	5.163.180	(14.692)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	117.200	(81)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	37.900	(523)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	56.700	478	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	3.050.720	(7.502)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	13.12.2027	141.600	2.564	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	104.800	(867)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,040	20.06.2024	364.200	(2.763)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,060	20.06.2024	1.457.000	(10.772)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,140	22.06.2024	607.100	(4.008)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	11.396.340	(48.351)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	6.663.690	(3.156)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,100	22.05.2024	22.102.670	(24.246)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,400	06.06.2024	12.921.420	11.269	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	02.01.2025	BRL 26.500	(93)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,160	02.01.2025	BRL 17.600	(60)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,220	04.01.2027	BRL 32.000	66	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,245	04.01.2027	BRL 16.100	36	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,260	04.01.2027	BRL 16.200	37	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,350	02.01.2025	BRL 21.800	(56)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,700	04.01.2027	BRL 8.300	42	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,715	04.01.2027	BRL 35.900	187	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	04.01.2027	BRL 85.800	529	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,000	02.01.2025	BRL 59.500	21	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,080	02.01.2025	BRL 98.900	71	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,140	02.01.2025	BRL 49.800	49	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,145	02.01.2025	BRL 48.800	49	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,160	02.01.2025	BRL 99.600	107	0,00
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2047	CAD 2.600	693	0,00
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,300	16.06.2047	CAD 2.500	638	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	3,400	20.06.2029	CAD 6.300	(712)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.07.2023	\$ 212.800	(2.853)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	18.07.2023	\$ 157.300	(2.110)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	26.07.2023	\$ 154.700	(2.075)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	\$ 7.957.500	(109.160)	(0,17)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	09.08.2023	\$ 22.000	301	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	06.09.2023	\$ 344.400	(4.843)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.09.2023	\$ 324.000	4.596	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	\$ 1.456.600	20.933	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	\$ 33.800	(486)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	30.09.2023	\$ 1.155.100	16.136	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023	\$ 3.594.237	(46.794)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,550	15.07.2023	\$ 4.567.800	48.659	0,08
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,674	05.08.2023	\$ 62.900	666	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,678	29.07.2023	\$ 65.200	681	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,711	28.07.2023	\$ 69.000	683	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,715	27.07.2023	\$ 200.000	1.978	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.09.2023	\$ 3.358.883	(41.837)	(0,06)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,800	15.07.2023	\$ 1.479.300	13.903	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,928	06.08.2023	\$ 150.100	1.667	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,975	17.09.2023	\$ 52.200	594	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,990	24.09.2023	\$ 75.000	866	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.09.2023	\$ 120.615	1.425	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,035	28.09.2023	\$ 25.900	298	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,144	04.08.2023	\$ 49.600	(538)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,215	13.07.2023	\$ 83.500	(861)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,235	12.08.2023	\$ 75.400	817	0,00



Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250 %	15.09.2023	\$ 1.654.500	\$ (18.300)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,280	24.09.2023	423.400	(3.210)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,306	02.08.2023	48.000	496	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,350	20.07.2023	109.100	721	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	20.07.2023	91.400	600	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	15.08.2023	387.430	2.659	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,370	19.07.2023	61.300	401	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,405	07.09.2023	154.300	1.095	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,418	20.07.2023	71.900	(451)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,420	24.08.2023	269.100	1.801	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,425	18.07.2023	146.000	(915)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	16.07.2023	137.000	841	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	17.08.2023	361.600	2.327	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,485	13.07.2023	78.100	(462)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	05.07.2023	89.100	(851)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	12.07.2023	85.443	490	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023	473.684	(4.943)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023	43.100	(249)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	15.07.2023	88.600	(845)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	22.07.2023	59.100	(565)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	26.07.2023	58.900	(561)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,550	20.07.2023	485.100	(2.721)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	11.07.2023	121.400	(657)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	12.07.2023	76.200	(410)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	16.08.2023	150.400	(866)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,595	13.07.2023	82.600	(443)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,600	15.08.2023	1.549.700	(8.778)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.07.2023	60.000	(313)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.07.2023	72.000	(378)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,650	24.08.2023	897.000	(4.975)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,655	24.07.2023	72.000	(370)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	12.07.2023	310.700	(1.469)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	17.08.2023	1.446.200	(7.503)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,735	12.07.2023	57.800	(263)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2023	76.100	384	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,815	24.07.2023	14.400	(62)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,867	26.07.2023	14.400	(58)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,945	23.09.2023	127.800	1.211	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	18.08.2023	133.700	(521)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,008	09.08.2023	36.700	134	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD 72.880	(2.076)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	1.179.040	(54.438)	(0,08)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024	197.200	(8.816)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025	361.600	(21.281)	(0,03)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024	97.200	(8.686)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	18.06.2024	124.400	(13.332)	(0,02)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	18.03.2030	€ 907.700	18.200	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	17.06.2030	244.000	2.942	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,294	30.06.2026	6.200	743	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	13.200	1.407	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	20.500	1.805	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	10.800	771	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024	24.600	1.171	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,453	29.12.2023	25.200	662	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050	126.900	59.328	0,09
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	331.900	(35.249)	(0,05)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	113.000	(11.846)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	1.064.900	51.697	0,08
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	243.100	(22.803)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	116.300	(10.904)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	21.09.2027	355.500	(21.251)	(0,03)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	17.09.2024	149.000	20.973	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	21.09.2032	170.580	(18.124)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	197.900	(3.100)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	407.800	(6.402)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	183.200	(3.101)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	200.100	(2.777)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	184.600	(2.748)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	184.500	(2.757)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	300	7	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	127.800	(2.839)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,165	06.09.2032	MXN 266.600	(917)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,360	21.08.2037	285.500	(639)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,380	14.08.2037	111.200	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,480	18.06.2037	337.300	(1.175)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,495	14.01.2032	2.373.500	(5.253)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,498	15.01.2032	5.192.600	(11.416)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,498	19.06.2037	810.000	(2.774)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,103	04.01.2038	3.750.800	(1.347)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,280	28.11.2036	690.000	(3.180)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,310	28.11.2036	1.066.400	(5.047)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,410	31.03.2027	1.182.800	514	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,660 %	04.04.2024	MXN 2.723.700	\$ 3.031	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,675	03.04.2024	9.876.200	10.940	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,701	31.03.2032	905.900	(1.914)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,730	06.04.2027	787.600	(55)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,732	30.03.2032	394.000	(875)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,750	05.04.2024	1.956.500	2.097	0,00
Zahlung	UKRPI	4,000	15.09.2031	£ 53.800	(10.126)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,020	15.10.2031	69.900	(12.663)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,055	15.09.2031	49.800	(9.273)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031	96.800	(16.301)	(0,03)
Zahlung	UKRPI	4,140	15.10.2031	135.400	(22.552)	(0,04)
Zahlung	UKRPI	4,250	15.11.2031	135.600	(19.058)	(0,03)
Zahlung	UKRPI	4,400	15.10.2031	60.700	(8.777)	(0,01)
					<b>\$ 639.520</b>	<b>0,99</b>
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 862.397</b>	<b>1,34</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermö- gens
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,243 %	05.08.2024	291.100	\$ 3.930	\$ 818	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,243	05.08.2024	291.100	3.930	8.769	0,02
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110	26.07.2032	59.200	9.590	6.963	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	85.900	13.916	17.142	0,03
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,053	20.07.2023	869.400	5.216	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,053	20.07.2023	869.400	5.216	19.130	0,03
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	869.400	6.520	1.478	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	869.400	6.521	13.486	0,02
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,590	19.07.2024	616.200	8.473	2.299	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,590	19.07.2024	616.200	8.473	15.638	0,03
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	68.100	8.986	5.676	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	76.800	10.134	12.620	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,170	19.07.2032	68.100	10.801	8.179	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,170	19.07.2032	76.800	12.180	14.861	0,02
							<b>\$ 113.886</b>	<b>\$ 127.059</b>	<b>0,20</b>

#### VERKAUFSoPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermö- gens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	158.300	\$ (491)	\$ (17)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	158.300	(491)	(2.141)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2023	61.300	(236)	(292)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	61.300	(236)	(180)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	40.100	(263)	(100)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	40.100	(263)	(31)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	22.800	(166)	(102)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	22.800	(166)	(54)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	30.200	(97)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	30.200	(97)	(32)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	37.100	(253)	(3)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	37.100	(253)	(1)	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	25.600	(83)	(52)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	25.600	(83)	(124)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	30.700	(71)	(59)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	30.700	(71)	(108)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermö- gens
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690 %	02.04.2024	41.500	\$ (326)	\$ (49)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	41.500	(326)	(764)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,765	25.07.2023	377.400	(2.359)	(10)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,765	25.07.2023	377.400	(2.359)	(9.382)	(0,02)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,468	25.07.2023	79.800	(1.907)	(8)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,468	25.07.2023	79.800	(1.907)	(5.016)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	96.700	(595)	(8)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	96.700	(595)	(2.075)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	77.900	(504)	(10)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	77.900	(504)	(1.586)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	77.500	(544)	(12)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	77.500	(544)	(1.487)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	77.500	(539)	(13)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	77.500	(539)	(1.451)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	77.500	(538)	(13)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	77.500	(538)	(1.426)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	77.700	(534)	(10)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	77.700	(534)	(1.611)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	77.400	(530)	(9)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	77.400	(530)	(1.688)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	77.800	(564)	(15)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	77.800	(564)	(1.503)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	78.600	(522)	(14)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	78.600	(522)	(1.632)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	155.600	(564)	(14)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	155.600	(564)	(2.024)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	155.600	(543)	(13)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	155.600	(543)	(2.156)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	159.200	(497)	(21)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	159.200	(497)	(1.993)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	249.100	(1.954)	(294)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	249.100	(1.954)	(4.569)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	80.600	(608)	(100)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	80.600	(608)	(1.446)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	51.300	(167)	(103)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	51.300	(167)	(248)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	30.700	(73)	(59)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	30.700	(73)	(108)	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	28.600	(101)	(11)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	28.600	(101)	(18)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	64.100	(219)	(81)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	64.100	(219)	(266)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,050	19.07.2023	377.000	(2.262)	(7)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,050	19.07.2023	377.000	(2.262)	(8.346)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,052	20.07.2023	376.700	(2.317)	(9)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,052	20.07.2023	376.700	(2.317)	(8.299)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,700	19.07.2023	79.700	(1.857)	(6)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,700	19.07.2023	79.700	(1.857)	(4.210)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,675	20.07.2023	81.100	(1.885)	(8)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,675	20.07.2023	81.100	(1.886)	(4.362)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	82.900	(560)	(16)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	82.900	(560)	(1.746)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	30.200	(97)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	30.200	(97)	(32)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	28.600	(99)	(11)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	28.600	(99)	(18)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	58.300	(193)	(104)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	58.300	(193)	(240)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,550	19.07.2023	20.300	(1.464)	(6)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,550	19.07.2023	20.300	(1.464)	(2.397)	(0,01)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,537	20.07.2023	20.300	(1.478)	(7)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,537	20.07.2023	20.300	(1.478)	(2.443)	(0,01)
							\$ (56.121)	\$ (78.879)	(0,12)

## ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermö- gens	
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,022 %	08.08.2026	291.100	\$ (5.021)	\$ (9.419)	(0,02)	
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,022	08.08.2026	291.100	(5.021)	(1.529)	0,00	
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	869.400	(6.506)	(19.151)	(0,03)	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	869.400	(6.506)	(231)	0,00	
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	869.400	(7.615)	(13.872)	(0,02)	
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	869.400	(7.615)	(1.972)	0,00	
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	616.200	(10.898)	(17.481)	(0,03)	
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	616.200	(10.897)	(4.082)	(0,01)	
							\$ (60.079)	\$ (67.737)	(0,11)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
MSC	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	\$ 93,281	06.07.2023	18.600	\$ (74)	\$ (18)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	95,875	07.08.2023	59.000	(350)	(344)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	97,875	07.08.2023	59.000	(323)	(83)	0,00
					\$ (747)	\$ (445)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

<sup>(2)</sup> Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	HSBC Holdings PLC	(1,000) %	20.06.2024	€ 1.300	\$ 22	\$ (29)	\$ (7)	0,00
	UBS AG	(1,000)	20.06.2024	\$ 19.300	1.254	(1.288)	(34)	0,00
BPS	UBS AG	(1,000)	20.06.2024	7.000	458	(471)	(13)	0,00
					\$ 1.734	\$ (1.788)	\$ (54)	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 5.500	(241)	\$ 47	\$ (194)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	60.500	(4.393)	4.124	(269)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.800	(998)	786	(212)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	23.000	(2.501)	1.605	(896)	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	14.700	(705)	258	(447)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.900	(259)	131	(128)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	17.900	(1.564)	1.484	(80)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.000	(287)	131	(156)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.300	(223)	149	(74)	0,00
BRC	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	7.070	(658)	519	(139)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	84.600	(11.485)	8.189	(3.296)	(0,01)
BYL	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	22.450	(1.502)	1.402	(100)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.260	(1.322)	728	(594)	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	168.400	(2.908)	4.399	1.491	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.000	(102)	148	46	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	29.600	116	(31)	85	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	42.900	(1.989)	1.098	(891)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.600	(381)	58	(323)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	52.400	(847)	1.269	422	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	31.000	(203)	627	424	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	12.600	(1.154)	906	(248)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.700	(490)	307	(183)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	176.800	(2.751)	4.316	1.565	0,01
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	32.600	(488)	591	103	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	17.600	(687)	151	(536)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	8.200	(731)	369	(362)	0,00
	Equinix, Inc.	5,000	20.06.2027	9.000	1.258	(103)	1.155	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2028	22.200	82	63	145	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	60.300	(502)	1.141	639	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.400	(101)	110	9	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	10.500	(179)	169	(10)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	8.700	(449)	461	12	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	10.200	(565)	392	(173)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.800	(215)	45	(170)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	37.500	(3.786)	3.049	(737)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	58.600	(6.583)	4.300	(2.283)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	30.100	(953)	1.082	129	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	187.100	(5.474)	6.873	1.399	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	32.400	(94)	245	151	0,00
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.200	(101)	55	(46)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.500	(135)	28	(107)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	33.200	(259)	713	454	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	37.600	(2.111)	2.163	52	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.200	(151)	141	(10)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	6.200	(676)	434	(242)	0,00
MBC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	21.700	(781)	121	(660)	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	24.900	(2.220)	1.120	(1.100)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	47.400	(418)	920	502	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	5.300	(73)	144	71	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	56.100	(326)	1.092	766	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	44.400	68	426	494	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	40.600	(137)	490	353	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	97.700	(2.227)	2.132	(95)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	124.200	(5.441)	1.051	(4.390)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	12.500	(1.123)	1.067	(56)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	17.500	(1.945)	1.601	(344)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.600	(518)	339	(179)	0,00
					\$ (74.888)	\$ 65.625	\$ (9.263)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	ABX.HE.AA.6-1 Index	0,320 %	25.07.2045	\$ 704	\$ (243)	\$ 194	\$ (49)	0,00
	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	31.672	(8.014)	6.751	(1.263)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	199	0	0	0	0,00
BRC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	2.491	(628)	529	(99)	0,00
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	100.000	(1.840)	340	(1.500)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	1.371	(47)	46	(1)	0,00
CBK	PRIMEX.ARM.2-AAA Index	4,580	25.12.2037	204	9	(7)	2	0,00
	CDX.HY-33 5-Year Index 35-100 %	5,000	20.12.2024	57.942	9.646	(5.556)	4.090	0,01
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	233.645	(4.705)	3.756	(949)	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	512.161	(3.542)	(30)	(3.572)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	162.200	(1.133)	(661)	(1.794)	0,00
GST	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	817	(195)	162	(33)	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.176.350	(15.149)	10.370	(4.779)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	912.039	2.357	(8.718)	(6.361)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	86.300	(1.494)	199	(1.295)	0,00
JPS	CMBX.NA.AAA.15 Index	0,500	18.11.2064	473.700	(13.687)	1.126	(12.561)	(0,02)
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	171.400	(2.957)	2.261	(696)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	171.700	(1.351)	153	(1.198)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	45.500	(336)	(167)	(503)	0,00
MEI	CDX.HY-33 5-Year Index 35-100 %	5,000	20.12.2024	117.250	19.538	(11.260)	8.278	0,01
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	66.700	(1.419)	1.148	(271)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	364.800	(3.092)	547	(2.545)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	923.900	(14.119)	3.901	(10.218)	(0,02)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	379.100	507	(6.194)	(5.687)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.14 Index	0,500	16.12.2072	171.300	(4.147)	610	(3.537)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.15 Index	0,500	18.11.2064	74.400	(631)	(1.342)	(1.973)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	119	(4)	4	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	810.495	(7.907)	4.615	(3.292)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	152.400	(785)	(278)	(1.063)	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.386.500	(13.793)	(1.541)	(15.334)	(0,02)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	88.800	0	(1.332)	(1.332)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	15.500	(445)	382	(63)	0,00
					\$ (69.606)	\$ 8	\$ (69.598)	(0,11)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	07.2023	AUD	\$ 213.693	\$ 141.807	\$ 0	\$ (438)	0,00	
	07.2023	\$	25.308	AUD 38.671	433	433	0,00	
	08.2023		141.919	213.693	439	439	0,00	
BOA	07.2023	BRL	1.092.872	\$ 227.682	1.133	0	1.133	0,00
	07.2023	CAD	50.220	36.908	0	(1.044)	(1.044)	0,00
	07.2023	DKK	47.744	7.022	26	0	26	0,00
	07.2023	€	2.892.903	3.109.146	13	(47.026)	(47.013)	(0,07)
	07.2023	£	1.889	2.402	1	0	1	0,00
	07.2023	KRW	21.404.093	16.374	109	0	109	0,00
	07.2023	\$	239.615	AUD 367.256	4.849	0	4.849	0,01
	07.2023		649	CLP 518.135	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023		426	CNH 3.027	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023		3.802	DKK 26.327	56	0	56	0,00
	07.2023		15.458	€ 14.291	134	0	134	0,00
	07.2023		51.760	£ 40.973	331	0	331	0,00
	07.2023		253.509	MXN 4.667.108	17.934	0	17.934	0,03
	07.2023		83.019	NZD 136.836	813	0	813	0,00
	08.2023	¥	30.501.508	\$ 221.212	8.429	0	8.429	0,01
	08.2023	\$	226.521	BRL 1.092.872	0	(1.073)	(1.073)	0,00
	08.2023		7.022	DKK 47.665	0	(26)	(26)	0,00
	08.2023		390	MXN 7.203	27	0	27	0,00
	08.2023		12.844	ZAR 234.981	0	(459)	(459)	0,00
	09.2023	¥	39.652.000	\$ 285.475	7.888	0	7.888	0,01
09.2023	TWD	863.392	28.441	662	0	662	0,00	
09.2023	\$	931	HKD 7.275	0	(1)	(1)	0,00	
09.2023		105.297	IDR 1.576.294.578	0	(600)	(600)	0,00	
09.2023		132.840	KRW 168.303.768	0	(4.569)	(4.569)	(0,01)	



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BPS	07.2023	AUD	153.451	\$ 101.641	\$ 0	\$ (503)	0,00	
	07.2023	BRL	168.074	35.015	174	0	174	0,00
	07.2023	CAD	499.877	376.836	0	(929)	(929)	0,00
	07.2023	CHF	246	272	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	€	3.722	4.057	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	£	398	493	0	(14)	(14)	0,00
	07.2023	¥	7.371.900	52.044	1.039	0	1.039	0,00
	07.2023	KRW	3.203.677	2.451	17	0	17	0,00
	07.2023	PEN	82.193	22.546	0	(117)	(117)	0,00
	07.2023	SGD	187	140	2	0	2	0,00
	07.2023	\$	4.060	AUD 6.168	45	0	45	0,00
	07.2023		4.216	CHF 3.771	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		20.507	CLP 16.201.315	0	(332)	(332)	0,00
	07.2023		26.343	€ 24.142	25	(29)	(4)	0,00
	07.2023		38.885	£ 30.363	1	(284)	(283)	0,00
	07.2023		278	HKD 2.178	0	0	0	0,00
	07.2023		1.151.501	¥ 159.985.622	0	(44.604)	(44.604)	(0,07)
	08.2023	CHF	3.760	\$ 4.216	1	0	1	0,00
	08.2023	CNH	8.475	1.227	58	0	58	0,00
	08.2023	COP	20.000.000	4.360	0	(354)	(354)	0,00
	08.2023	KRW	213.185.465	162.578	579	(19)	560	0,00
	08.2023	TWD	432.158	14.155	276	0	276	0,00
	08.2023	\$	101.721	AUD 153.451	505	0	505	0,00
	08.2023		34.837	BRL 168.074	0	(165)	(165)	0,00
	08.2023		135.610	INR 11.141.683	48	(8)	40	0,00
	08.2023		22.511	PEN 82.193	107	0	107	0,00
	08.2023	ZAR	229.830	\$ 12.435	318	0	318	0,00
	09.2023	\$	118.895	IDR 1.786.694.261	0	(217)	(217)	0,00
	09.2023		528	ZAR 9.322	0	(38)	(38)	0,00
	10.2023	ZAR	522.082	\$ 28.114	770	0	770	0,00
BRC	07.2023	£	6.757	8.512	0	(79)	(79)	0,00
	07.2023	¥	15.387.000	118.964	12.298	0	12.298	0,02
	07.2023	KRW	21.587.029	16.519	115	0	115	0,00
	07.2023	NZD	78.426	47.799	0	(249)	(249)	0,00
	07.2023	SGD	15	11	0	0	0	0,00
	07.2023	\$	38.034	£ 30.440	701	(35)	666	0,00
	07.2023		1.937	NZD 3.227	40	0	40	0,00
	08.2023	CNH	131	\$ 18	0	0	0	0,00
	08.2023	\$	1.646	MXN 28.479	1	0	1	0,00
	08.2023	ZAR	894.917	\$ 46.825	193	(535)	(342)	0,00
	09.2023	IDR	3.139.928	210	1	0	1	0,00
	09.2023	ILS	64	18	1	0	1	0,00
	09.2023	¥	27.972.000	204.352	8.969	0	8.969	0,01
CBK	07.2023	AUD	10.499	7.024	35	0	35	0,00
	07.2023	BRL	394.739	82.540	712	0	712	0,00
	07.2023	£	13.976	17.721	0	(47)	(47)	0,00
	07.2023	IDR	417.441	28	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN	49.303	2.733	0	(135)	(135)	0,00
	07.2023	PEN	127.411	35.084	0	(66)	(66)	0,00
	07.2023	\$	89.474	AUD 137.137	1.811	0	1.811	0,00
	07.2023		400.000	BRL 2.135.280	42.638	0	42.638	0,07
	07.2023		100.194	CLP 80.278.146	251	(477)	(226)	0,00
	07.2023		3.115.519	€ 2.865.917	11.223	(26)	11.197	0,02
	07.2023		50.484	£ 39.884	280	(58)	222	0,00
	07.2023		28	IDR 417.441	0	0	0	0,00
	07.2023		320	MXN 5.671	10	0	10	0,00
	07.2023		34.291	PEN 127.411	859	0	859	0,00
	08.2023	€	2.817.994	\$ 3.068.045	0	(10.597)	(10.597)	(0,02)
	08.2023	¥	71.217.564	516.797	19.973	0	19.973	0,03
	08.2023	SEK	15.788	1.557	92	0	92	0,00
	08.2023	TWD	449.925	14.739	290	0	290	0,00
	08.2023	\$	437.502	BRL 2.199.716	16.948	(673)	16.275	0,03
	08.2023		63.477	CLP 51.055.978	1	(108)	(107)	0,00
	08.2023		466	CNH 3.248	0	(18)	(18)	0,00
	08.2023		534	MXN 9.251	1	0	1	0,00
	08.2023		114.988	NOK 1.199.469	0	(2.860)	(2.860)	0,00
	09.2023	IDR	417.955	\$ 28	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	21.517.513	16.645	246	0	246	0,00
	09.2023	\$	1.902	BRL 9.226	0	(10)	(10)	0,00
	10.2023		14.756	CLP 11.980.971	1	0	1	0,00
	10.2023		200.000	MXN 3.916.040	23.930	0	23.930	0,04
DUB	07.2023	PEN	158.620	\$ 43.368	0	(391)	(391)	0,00
	07.2023	\$	1.833	MXN 31.671	11	(1)	10	0,00
	07.2023		87.024	PEN 317.240	473	0	473	0,00
	09.2023	IDR	1.238.338	\$ 83	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
FAR	10.2023	ZAR	2.514.760	\$	138.092	\$	6.359	0,01
	07.2023	SGD	188		139		0	0,00
GLM	07.2023	BRL	1.354.467		281.902		1.125	0,00
	07.2023	KRW	8.481.662		6.489		44	0,00
	07.2023	PEN	31.209		8.594		0	0,00
	07.2023	SGD	202		150		0	0,00
	07.2023	\$	400.000	BRL	2.015.920		17.895	0,03
	07.2023		44.567	MXN	781.574		926	0,00
	07.2023		8.419	PEN	31.209		191	0,00
	08.2023	KRW	101.892.293	\$	77.472		40	0,00
	08.2023	\$	481.902	BRL	2.420.037		18.083	0,03
	08.2023		209.090	INR	17.176.866		48	0,00
	08.2023		50.557	NOK	536.418		0	0,00
	09.2023		193.351	BRL	985.646		8.700	0,01
	10.2023		200.000		978.170		0	0,00
	10.2023	ZAR	1.302.045	\$	69.404		1.210	0,00
	12.2023	\$	100.000	MXN	1.976.800		11.841	0,02
IND	07.2023		106	CHF	95		0	0,00
	07.2023		11.168	DKK	77.371		169	0,00
	08.2023	CHF	95	\$	106		0	0,00
	08.2023	CNH	3.096		437		10	0,00
	08.2023	\$	129.819	NOK	1.360.581		0	0,00
	09.2023	SGD	160	\$	120		1	0,00
	10.2023	\$	50.000	CLP	40.510.000		0	0,00
JPM	07.2023	BRL	159.689	\$	33.352		249	0,00
	07.2023	€	9.700		10.371		0	0,00
	07.2023	¥	52.876.771		369.735		3.895	0,01
	07.2023	SGD	21		16		0	0,00
	07.2023	\$	199.512	AUD	305.169		3.624	0,01
	07.2023		2.887.881	£	2.283.993		15.875	0,02
	07.2023		47.793	NZD	78.426		254	0,00
	07.2023		3.095	SGD	4.089		0	0,00
	08.2023	CNH	6.803	\$	984		46	0,00
	08.2023	£	2.283.993		2.888.493		0	0,00
	08.2023	¥	44.860.928		325.232		12.275	0,02
	08.2023	KRW	17.967.504		13.620		0	0,00
	08.2023	NZD	78.426		47.789		0	0,00
	08.2023	\$	33.178	BRL	159.689		0	0,00
	08.2023		369.735	¥	52.652.083		0	0,00
	08.2023		4.258	MXN	73.786		9	0,00
	08.2023		18.647	NOK	197.799		0	0,00
	08.2023		6.321	ZAR	115.680		0	0,00
	08.2023	ZAR	1.103	\$	60		2	0,00
	09.2023	ILS	61		17		1	0,00
	09.2023	INR	48.517		589		0	0,00
	09.2023	KRW	59.788.491		45.977		410	0,00
	09.2023	\$	43.890	IDR	660.353.220		0	0,00
	09.2023		155.203	PEN	571.459		1.504	0,00
	09.2023		7.527	SGD	10.067		0	0,00
	10.2023	MXN	25.116	\$	1.430		0	0,00
MBC	12.2023	\$	142.392	INR	11.750.563		0	0,00
	07.2023	CAD	588	\$	446		1	0,00
	07.2023	€	49.858		53.381		0	0,00
	07.2023	£	5.419		6.753		0	0,00
	07.2023	HKD	210		27		0	0,00
	07.2023	¥	18.330.650		140.245		13.061	0,02
	07.2023	\$	1.219	CAD	1.624		9	0,00
	07.2023		57.554	€	53.577		898	0,00
	07.2023		3.220	£	2.518		0	0,00
	07.2023		16.598	¥	2.307.528		0	0,00
	08.2023	CNH	18	\$	3		0	0,00
	08.2023	\$	1.042	¥	150.015		0	0,00
	09.2023	¥	76.717.000	\$	558.840		22.465	0,04
	09.2023	SGD	250		185		0	0,00
	09.2023	\$	244.638	KRW	311.986.429		0	0,00
	09.2023		1.492	ZAR	26.404		0	0,00
MYI	09.2023	ZAR	2.863.258	\$	158.281		7.762	0,01
	07.2023	AUD	1.999		1.320		0	0,00
	07.2023	CHF	8		9		0	0,00
	07.2023	DKK	42.580		6.242		3	0,00
	07.2023	€	4.088		4.443		0	0,00
	07.2023	£	2.441.459		3.034.406		0	0,00
	07.2023	HKD	3.038		388		0	0,00
	07.2023	IDR	415.530.265		27.785		69	0,00
	07.2023	¥	208.879		1.450		4	0,00
	07.2023	SGD	106		78		0	0,00
	07.2023	\$	6	CHF	6		0	0,00
	07.2023		13.002	€	11.973		61	0,00
	07.2023		21.457	£	17.100		295	0,00
	07.2023		27.654	IDR	415.530.265		62	0,00
	07.2023		1.442	MXN	24.667		0	0,00
	07.2023		5.499	NZD	9.086		67	0,00
	08.2023	CNH	54	\$	8		0	0,00
	08.2023	TWD	2.979.497		97.795		2.111	0,00
	08.2023	\$	6.242	DKK	42.509		0	0,00
	08.2023		13.995	ZAR	256.162		0	0,00
	09.2023	INR	10.479	\$	127		0	0,00
	09.2023	KRW	115.786.160		89.152		907	0,00
	09.2023	\$	92.368	IDR	1.380.399.373		0	0,00
	09.2023		273.981	KRW	350.622.323		0	0,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens		
RBC	07.2023	AUD	8.679	\$	5.907	\$	130	0,00	
	07.2023	\$	23.907	£	18.701		0	0,00	
	07.2023		98.948	MXN	1.903.869		11.869	0,02	
	08.2023	CNH	17	\$	2		0	0,00	
	08.2023	MXN	1.127.071		65.036		0	0,00	
RYL	07.2023	€	1.678		1.808		(23)	0,00	
	07.2023	\$	1.337	€	1.244		21	0,00	
	08.2023	CNH	228	\$	32		1	0,00	
SCX	07.2023	AUD	313.874		208.362		0	0,00	
	07.2023	CHF	4.869		5.419		(23)	0,00	
	07.2023	£	182		229		(2)	0,00	
	07.2023	\$	281.491	AUD	430.779		5.257	0,01	
	07.2023		1.631	CHF	1.472		15	0,00	
	07.2023		2.025	£	1.611		23	0,00	
	07.2023		216.376	NZD	356.375		1.958	0,00	
	08.2023	CNH	9.131	\$	1.329		70	0,00	
	08.2023	TWD	2.858.469		93.610		1.812	0,00	
	08.2023	\$	208.527	AUD	313.874		570	0,00	
	09.2023	INR	30.343	\$	368		0	0,00	
	09.2023	KRW	21.299.463		16.478		245	0,00	
	09.2023	TWD	1.829.480		60.356		1.492	0,00	
	09.2023	\$	266.068	IDR	3.979.243.703		0	0,00	
	09.2023	ZAR	2.911.476	\$	165.943		(1.753)	0,00	
SOG	07.2023	SGD	1.011		757		9	0,00	
	07.2023	\$	167.144	AUD	255.470		2.910	0,00	
	07.2023		610	MXN	10.505		1	0,00	
SSB	07.2023	BRL	981.358	\$	205.305		1.873	0,00	
	07.2023	¥	6.905.000		52.360		4.398	0,01	
	07.2023	KRW	15.865.393		12.136		80	0,00	
	07.2023	PEN	40.902		11.214		(64)	0,00	
	08.2023	\$	58.419	CLP	47.366.236		420	0,00	
	08.2023		11.198	PEN	40.902		58	0,00	
	09.2023		205.305	BRL	992.239		(1.902)	0,00	
	12.2023		14.516	INR	1.198.078		(3)	0,00	
TOR	07.2023	AUD	386.268	\$	255.130		0	0,00	
	07.2023	NZD	919.425		559.622		(3.664)	0,01	
	07.2023	\$	88.423	AUD	135.193		1.568	0,00	
	07.2023		28.649	CAD	37.874		(27)	0,00	
	07.2023		13.271	CLP	10.677.797		26	0,00	
	08.2023	CAD	37.859	\$	28.649		27	0,00	
	08.2023	\$	255.338	AUD	386.268		1.987	0,00	
	08.2023		307.832	NZD	505.524		1.840	0,00	
	09.2023	¥	37.377.000	\$	265.270		3.359	0,01	
UAG	07.2023	AUD	615.721		411.139		2.143	0,00	
	07.2023	CHF	317		353		(2)	0,00	
	07.2023	¥	21.417.510		148.480		298	0,00	
	07.2023	\$	20.259	AUD	30.946		340	0,00	
	07.2023		104	CHF	93		0	0,00	
	07.2023		1.756	MXN	31.255		64	0,00	
	08.2023	CHF	93	\$	104		0	0,00	
	08.2023	TWD	5.284		172		3	0,00	
	08.2023	\$	411.463	AUD	615.721		858	0,00	
	08.2023		1.021	CNH	7.080		(45)	0,00	
	08.2023		148.480	¥	21.327.249		(299)	0,00	
	08.2023	ZAR	528.356	\$	27.528		(321)	0,00	
	09.2023	SGD	10.128		7.579		73	0,00	
	10.2023	ZAR	810.416		43.773		1.320	0,00	
							\$	402.033	
							\$	(244.950)	
							\$	157.083	
								0,24	

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) thesaurierend, Investor AUD (Hedged) ausschüttend, Administrative AUD (Hedged) ausschüttend, Class E AUD (Hedged) ausschüttend und Class Z AUD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
AZD	07.2023	AUD	142.486	\$	94.554	\$	(292)	0,00
	07.2023	\$	181.023	AUD	276.642		3.123	0,00
	08.2023		94.628		142.486		293	0,00
BOA	07.2023	AUD	5.090	\$	3.429		45	0,00
	07.2023	\$	548.809	AUD	844.643		13.428	0,02
BPS	07.2023	AUD	791.945	\$	524.092		6	0,00
	07.2023	\$	27.205	AUD	41.197		(76)	0,00
	08.2023		490.001		739.189		2.433	0,00
CBK	07.2023	AUD	6.862	\$	4.659		91	0,00
	07.2023	\$	114.677	AUD	175.699		(25)	0,00
JPM	07.2023		173.071		264.725		3.143	0,01
MBC	07.2023	AUD	1.034	\$	682		(6)	0,00
	07.2023	\$	676	AUD	1.012		(2)	0,00
MYI	07.2023	AUD	239	\$	160		1	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
RBC	07.2023	\$ 2.744	AUD 4.091	\$ 22	\$ (43)	\$ (21)	0,00
SCX	07.2023	AUD 251.342	\$ 166.851	0	(455)	(455)	0,00
	07.2023	\$ 140.802	AUD 215.394	2.585	(10)	2.575	0,00
	08.2023	166.983	251.342	456	0	456	0,00
TOR	07.2023	AUD 438.850	\$ 289.861	0	(2.260)	(2.260)	0,00
	07.2023	\$ 291.092	AUD 445.062	5.163	0	5.163	0,01
	08.2023	290.097	438.850	2.257	0	2.257	0,00
UAG	07.2023	AUD 851.261	\$ 565.239	1.092	(2.494)	(1.402)	0,00
	07.2023	\$ 212.567	AUD 324.703	3.572	0	3.572	0,01
	08.2023	564.773	849.912	2.497	(1.075)	1.422	0,00
				\$ 42.803	\$ (9.814)	\$ 32.989	0,05

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 109.069	BRL 544.314	\$ 3.766	\$ 0	\$ 3.766	0,01
BPS	07.2023	BRL 275.714	\$ 57.657	546	(43)	503	0,00
	07.2023	\$ 52.327	BRL 261.027	1.783	0	1.783	0,00
	08.2023	56.683	272.175	0	(536)	(536)	0,00
CBK	07.2023	BRL 510.099	\$ 106.469	903	(176)	727	0,00
	07.2023	\$ 47.727	BRL 238.973	1.811	0	1.811	0,00
	08.2023	103.227	496.204	0	(866)	(866)	0,00
GLM	07.2023	45.344	227.206	1.755	0	1.755	0,00
JPM	07.2023	BRL 239.272	\$ 49.886	343	(57)	286	0,00
	07.2023	\$ 49.272	BRL 246.620	1.852	0	1.852	0,01
	08.2023	BRL 604	\$ 124	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 45.382	BRL 218.435	0	(322)	(322)	0,00
MBC	08.2023	4.472	21.488	0	(39)	(39)	0,00
TOR	07.2023	BRL 493.055	\$ 102.773	565	0	565	0,00
	08.2023	\$ 102.237	BRL 493.055	0	(525)	(525)	0,00
				\$ 13.324	\$ (2.565)	\$ 10.759	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CAD (Hedged) thesaurierend und Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CAD 1.701	\$ 1.287	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2023	\$ 49.183	CAD 66.923	1.391	0	1.391	0,01
CBK	07.2023	2.425	3.305	72	0	72	0,00
JPM	07.2023	49.354	66.956	1.246	0	1.246	0,00
MBC	07.2023	CAD 2.100	\$ 1.549	0	(37)	(37)	0,00
	07.2023	\$ 1.098	CAD 1.446	2	(7)	(5)	0,00
MYI	07.2023	CAD 643	\$ 485	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2023	\$ 49.515	CAD 67.248	1.305	0	1.305	0,00
TOR	07.2023	CAD 120.226	\$ 90.741	38	(153)	(115)	0,00
	08.2023	\$ 90.741	CAD 120.178	153	(37)	116	0,00
				\$ 4.208	\$ (235)	\$ 3.973	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF 9	\$ 10	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 166	CHF 149	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	CHF 199.684	\$ 223.269	74	(4)	70	0,00
	07.2023	\$ 296.735	CHF 268.459	3.336	0	3.336	0,01
	08.2023	222.609	198.524	0	(75)	(75)	0,00
IND	07.2023	CHF 105.227	\$ 117.145	0	(472)	(472)	0,00
	08.2023	\$ 117.145	CHF 104.928	472	0	472	0,00
JPM	07.2023	CHF 195	\$ 215	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023	1.827	2.033	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	\$ 2.210	CHF 1.985	9	0	9	0,00
MYI	07.2023	CHF 7.783	\$ 8.598	0	(102)	(102)	0,00
	07.2023	\$ 110	CHF 98	0	0	0	0,00
RBC	07.2023	CHF 101	\$ 113	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	481	535	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2023	511	566	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	\$ 211.312	CHF 189.869	916	0	916	0,00
UAG	07.2023	CHF 205.721	\$ 229.492	0	(454)	(454)	0,00
	07.2023	\$ 191.473	CHF 172.045	831	0	831	0,00
	08.2023	229.299	204.962	451	0	451	0,00
				\$ 6.089	\$ (1.125)	\$ 4.964	0,01

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend A, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) ausschüttend, E Class EUR (Hedged) ausschüttend II, E Class EUR (Hedged) ausschüttend II Q, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, R Class EUR (Hedged) ausschüttend, T Class EUR (Hedged) thesaurierend und T Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 5.539.572	€ 5.154.449	\$ 83.940	\$ (6)	\$ 83.934	0,14
BPS	07.2023	€ 5.241.939	\$ 5.743.533	24.584	(8)	24.576	0,04
	07.2023	\$ 5.555.993	€ 5.167.844	82.265	(139)	82.126	0,13
	08.2023	5.739.183	5.230.568	0	(24.818)	(24.818)	(0,04)
CBK	07.2023	€ 5.314.554	\$ 5.774.992	0	(23.188)	(23.188)	(0,04)
	07.2023	\$ 11.003	€ 10.073	14	(27)	(13)	0,00
	08.2023	5.548.601	5.096.379	19.164	0	19.164	0,03
JPM	07.2023	€ 5.241.978	\$ 5.723.716	4.716	0	4.716	0,01
	07.2023	\$ 320.901	€ 300.141	6.553	0	6.553	0,01
	08.2023	5.731.721	5.241.978	0	(4.889)	(4.889)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 46.018	\$ 49.593	27	(640)	(613)	0,00
	07.2023	\$ 63.244	€ 58.317	462	(82)	380	0,00
MYI	07.2023	9.346	8.614	51	0	51	0,00
SOG	07.2023	5.532.365	5.142.849	78.484	0	78.484	0,12
				\$ 300.260	\$ (53.797)	\$ 246.463	0,39

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 9.474	£ 7.464	\$ 18	\$ (3)	\$ 15	0,00
BPS	07.2023	£ 974	\$ 1.248	10	0	10	0,00
	07.2023	\$ 434.812	£ 351.538	12.115	0	12.115	0,02
BRC	07.2023	£ 7.159	\$ 8.959	0	(143)	(143)	0,00
	07.2023	\$ 1.265	£ 1.000	8	(1)	7	0,00
CBK	07.2023	£ 2.601	\$ 3.286	0	(21)	(21)	0,00
	07.2023	\$ 40.201	£ 31.592	22	(58)	(36)	0,00
JPM	07.2023	£ 364.569	\$ 460.961	0	(2.534)	(2.534)	0,00
	08.2023	\$ 461.059	£ 364.569	2.529	0	2.529	0,00
MBC	07.2023	439.868	355.209	11.750	(23)	11.727	0,02
MYI	07.2023	431.151	346.901	9.883	0	9.883	0,01
TOR	07.2023	£ 364.830	\$ 463.590	0	(237)	(237)	0,00
	08.2023	\$ 463.691	£ 364.830	229	0	229	0,00
				\$ 36.564	\$ (3.020)	\$ 33.544	0,05

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional JPY (Hedged) thesaurierend, Investor JPY (Hedged) thesaurierend, E Class JPY (Hedged) thesaurierend und E Class JPY (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	\$ 141	¥ 19.630	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
BOA	07.2023	24.410	3.393.259	0	(933)	(933)	0,00
BRC	07.2023	1.055	151.776	0	(4)	(4)	0,00
CBK	07.2023	11.669	1.638.095	0	(336)	(336)	0,00
DUB	07.2023	2.748	383.597	0	(94)	(94)	0,00
MBC	07.2023	¥ 3.575.966	\$ 24.767	26	0	26	0,00
	07.2023	\$ 10.427	¥ 1.456.723	0	(348)	(348)	0,00
	08.2023	24.767	3.560.848	0	(27)	(27)	0,00
MYI	07.2023	6.459	902.963	0	(212)	(212)	0,00
RYL	07.2023	¥ 284.515	\$ 2.045	77	0	77	0,00
	07.2023	\$ 173	¥ 24.165	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07.2023	24.902	3.464.161	0	(935)	(935)	0,00
				\$ 103	\$ (2.900)	\$ (2.797)	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	NOK 4.462	\$ 411	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	07.2023	\$ 140.743	NOK 1.564.935	5.328	0	5.328	0,01
CBK	07.2023	NOK 31.270	\$ 2.815	0	(104)	(104)	0,00
	07.2023	\$ 68.872	NOK 774.477	3.417	0	3.417	0,01
GLM	07.2023	NOK 636.799	\$ 59.081	0	(358)	(358)	(0,01)
	08.2023	\$ 59.062	NOK 635.974	360	0	360	0,00
MBC	07.2023	NOK 242	\$ 23	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	2.931	270	0	(3)	(3)	0,00
RYL	07.2023	4.976	462	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2023	104	10	0	0	0	0,00
				\$ 9.105	\$ (473)	\$ 8.632	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Investor RMB (Hedged) thesaurierend und Class E RMB (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 33.616	CNH 238.750	\$ 0	\$ (797)	\$ (797)	0,00
BPS	07.2023	33.699	238.605	0	(900)	(900)	0,00
BRC	07.2023	142	999	0	(4)	(4)	0,00
GLM	07.2023	CNH 260.830	\$ 35.958	104	0	104	0,00
	07.2023	\$ 33.897	CNH 239.120	0	(1.028)	(1.028)	(0,01)
	08.2023	35.958	260.233	0	(109)	(109)	0,00
IND	07.2023	3.444	24.689	0	(51)	(51)	0,00
MBC	07.2023	CNH 1.391	\$ 195	4	0	4	0,00
	07.2023	\$ 3.174	CNH 22.602	0	(67)	(67)	0,00
SOG	07.2023	42	302	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	1.383	9.878	0	(25)	(25)	0,00
				\$ 108	\$ (2.981)	\$ (2.873)	(0,01)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) thesaurierend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$ 1.203.525	SGD 1.628.515	\$ 0	\$ (203)	\$ (203)	0,00
GLM	07.2023	SGD 29.937	\$ 22.295	174	0	174	0,00
	07.2023	\$ 94.561	SGD 127.132	0	(623)	(623)	0,00
JPM	07.2023	SGD 1.796.588	\$ 1.327.659	147	0	147	0,00
	07.2023	\$ 240.098	SGD 324.957	15	0	15	0,00
	08.2023	1.327.659	1.794.862	0	(104)	(104)	0,00
MBC	07.2023	1.169.359	1.579.966	2	(1.913)	(1.911)	(0,01)
	08.2023	13.614	18.390	0	(12)	(12)	0,00
MYI	07.2023	SGD 1.747.700	\$ 1.293.388	2.024	(24)	2.000	0,00
	07.2023	\$ 237	SGD 321	0	0	0	0,00
	08.2023	1.274.199	1.720.131	0	(1.918)	(1.918)	0,00
UAG	07.2023	1.286.081	1.739.540	0	(722)	(722)	0,00
				\$ 2.362	\$ (5.519)	\$ (3.157)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 390.663 0,61

#### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Ginnie Mae, TBA			
2,500 % fällig am 01.07.2053 (I)	\$ 33.900	\$ (29.360)	(0,04)
2,500 % fällig am 01.08.2053	33.900	(29.382)	(0,05)
3,500 % fällig am 01.07.2053 (I)	12.900	(11.908)	(0,02)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (70.650)	(0,11)
Summe Anlagen		\$ 84.767.863	131,37
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (20.240.296)	(31,37)
Nettovermögen		\$ 64.527.567	100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- μ Der gesamte Betrag oder ein Teil davon stellt ungedeckte Kreditengagements dar. Der Zinssatz für den ungedeckten Anteil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Reines Kapitalwertpapier.
- (c) Wertpapier per Emissionstermin.
- (d) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (e) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (f) Nullkuponwertpapier.
- (g) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (h) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (i) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (j) Mit dem Fonds verbunden.
- (k) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (l) Zum 30. Juni 2023 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund (Forts.)

(m) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,97 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Chester A PLC 0,000 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	\$ 12.844	\$ 15.221	0,02
Chester A PLC 0,000 % fällig am 20.05.2046	18.04.2019	17.298	5.711	0,01
Chester A PLC 5,702 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	67.109	65.956	0,10
Chester A PLC 6,152 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	19.159	18.645	0,03
Chester A PLC 6,652 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	17.790	17.191	0,03
Chester A PLC 7,152 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	10.947	10.491	0,02
Chester A PLC 7,902 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	5.473	5.163	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	353	353	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071	10.06.2022	0	0	0,00
Corestate Capital Holding S.A., 15,000 % fällig am 31.07.2023	06.12.2022	1.050	1.102	0,00
Deutsche Bank AG 2,129 % fällig am 24.11.2026	11.01.2023	21.934	21.631	0,03
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	25.05.2021 - 29.09.2021	46.076	36.192	0,06
Intelsat Emergence S.A.	19.06.2017 - 23.02.2022	440.150	106.931	0,16
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	11.02.2020	59.946	42.809	0,07
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	37.976	179.237	0,28
Oracle Corp. 3,950 % fällig am 25.03.2051	22.03.2021	16.942	12.841	0,02
Oracle Corp. 4,100 % fällig am 25.03.2061	22.03.2021 - 05.10.2021	26.506	18.545	0,03
Sierra Hamilton Holder LLC	31.07.2017	560	0	0,00
Westmoreland Mining Holdings LLC	08.12.2014 - 19.12.2019	1.691	374	0,00
		<b>\$ 786.506</b>	<b>\$ 552.682</b>	<b>0,86</b>

(n) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 16.137 USD (31. Dezember 2022: 19.079 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 1 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 273 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 1.729.845 USD (31. Dezember 2022: 1.599.431 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 147.325 USD (31. Dezember 2022: 188.008 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 247.863	\$ 78.047.527	\$ 723.095	\$ 79.018.485
Investmentfonds	2.484.042	0	0	2.484.042
Pensionsgeschäfte	0	2.090.601	0	2.090.601
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	4.935	1.241.892	(1.442)	1.245.385
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(70.650)	0	(70.650)
<b>Summen</b>	<b>\$ 2.736.840</b>	<b>\$ 81.309.370</b>	<b>\$ 721.653</b>	<b>\$ 84.767.863</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 330.063	\$ 65.894.167	\$ 1.022.241	\$ 67.246.471
Investmentfonds	1.793.842	287.586	0	2.081.428
Pensionsgeschäfte	0	3.421.698	0	3.421.698
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	35.705	1.477.546	3	1.513.254
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(734.103)	0	(734.103)
<b>Summen</b>	<b>\$ 2.159.610</b>	<b>\$ 70.346.894</b>	<b>\$ 1.022.244</b>	<b>\$ 73.528.748</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BRC	2,000 %	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (4.716)	\$ (5.159)	(0,01)
MBC	4,650	30.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (3.161)	(3.161)	0,00
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (8.320)</b>	<b>(0,01)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Derivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 3.553	\$ (2.760)	\$ 793	\$ 2.601	\$ (920)	\$ 1.681
BOA	87.921	(72.150)	15.771	(36.145)	30.410	(5.735)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	(1.847)	2.130	283
BPS	53.184	(37.570)	15.614	37.581	(31.520)	6.061
BRC	15.698	(13.344)	2.354	(19.965)	16.765	(3.200)
BSH	k. A.	k. A.	k. A.	(15)	0	(15)
BYL	(694)	0	(694)	(1.443)	0	(1.443)
CBK	111.321	(102.271)	9.050	63.317	(64.234)	(917)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	29	0	29
DUB	5.408	(4.210)	1.198	(21.446)	18.530	(2.916)
FAR	(1.361)	1.570	209	(2.129)	2.290	161
FBF	(5.366)	6.053	687	(4.557)	4.715	158
GLM	40.729	(21.620)	19.109	(618)	(8.230)	(8.848)
GST	(25.672)	28.106	2.434	(18.731)	8.496	(10.235)
HUS	1.679	(1.680)	(1)	1.179	(520)	659
IND	(2.605)	3.310	705	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	29.658	(25.510)	4.148	9.738	(8.970)	768
JPS	(1.894)	2.090	196	(1.195)	1.120	(75)
MBC	44.257	(38.610)	5.647	112.677	(90.850)	21.827
MEI	(503)	576	73	(363)	294	(69)
MSC	(18)	0	(18)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(16.280)	36.980	20.700	(9.537)	(29.220)	(38.757)
MYI	(64.245)	45.110	(19.135)	44.132	(35.730)	8.402
RBC	11.696	(11.670)	26	(1.592)	2.500	908
RYL	65	0	65	(10.431)	8.200	(2.231)
SAL	(21.448)	23.530	2.082	(15.988)	16.088	100
SCX	25.953	(20.680)	5.273	122.133	(112.350)	9.783
SOG	81.404	(59.920)	21.484	10	0	10
SSB	4.860	(5.020)	(160)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	8.320	(8.420)	(100)	1.135	(920)	215
UAG	5.043	0	5.043	(36.981)	30.720	(6.261)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	59,20	68,71
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	63,14	45,07
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,11	2,21
Investmentfonds	3,85	3,59
Pensionsgeschäfte	3,24	5,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	0,15
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,34	2,09
Freiverkehrsfinanzderivate	0,61	0,37
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,11)	(1,27)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,01)	(0,03)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	2,54	3,66
Unternehmensanleihen und Wechsel	18,55	22,63
Wandelanleihen & Wechsel	0,03	0,03
Kommunalanleihen und Wechsel	0,13	0,15
US-Regierungsbehörden	51,65	35,26
US-Schatzobligationen	20,40	17,94
Non-Agency-MBS	11,83	12,73
Forderungsbisicherte Wertpapiere	7,67	8,72
Staatsemissionen	3,35	5,29
Stammaktien	0,65	0,93
Bezugsrechte	0,01	0,01
Optionsscheine	0,05	0,07
Vorzugswertpapiere	0,20	0,23
Real Estate Investment Trusts	0,29	0,34
Kurzfristige Instrumente	5,10	8,00
Investmentfonds	3,85	3,59
Pensionsgeschäfte	3,24	5,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,06	0,16
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,07)	(0,01)

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,32	0,41
Zinsswaps	0,99	1,68
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,20	0,21
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,12)	(0,17)
Zinsscaps	(0,11)	(0,10)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,06)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,11)	(0,06)
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,24	(0,26)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,52	0,82
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,11)	(1,27)
Sonstige Aktiva und Passiva	(31,37)	(26,82)
Nettovermögen	100,00	100,00





## Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund II (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust 5,705 % fällig am 25.01.2036	\$ 900	\$ 695	0,71	Bonos de la Tesoreria de la Republica en 4,500 % fällig am 01.03.2026 CLP	50.000	\$ 61	0,06	Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025	194	1	0,00
New Century Home Equity Loan Trust 5,885 % fällig am 25.10.2035	700	571	0,58	Mexico Government International Bond 5,750 % fällig am 12.10.2110	\$ 100	89	0,09	Summe Übertragbare Wertpapiere		94.891	97,12
Structured Asset Investment Loan Trust 6,125 % fällig am 25.05.2035	711	610	0,62	6,350 % fällig am 09.02.2035	200	211	0,22	INVESTMENTFONDS			
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,440 % fällig am 25.07.2036 ^	667	634	0,65	10,000 % fällig am 05.12.2024 MXN	10.000	579	0,59	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
		5.394	5,52	Romania Government International Bond 3,750 % fällig am 07.02.2034	€ 220	195	0,20	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	763.914	7.607	7,78
STAAITSEMISSIONEN				Russia Government International Bond 5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	\$ 200	12	0,01	Summe Investmentfonds		\$ 7.607	7,78
Argentina Government International Bond 0,500 % fällig am 09.07.2030	160	53	0,06	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026 ZAR	5.560	306	0,31				
1,500 % fällig am 09.07.2035	179	54	0,06	Turkey Government International Bond 5,250 % fällig am 13.03.2030	\$ 1.000	823	0,84				
3,500 % fällig am 09.07.2041	272	88	0,09	5,750 % fällig am 11.05.2047	250	171	0,18				
3,875 % fällig am 09.01.2038	63	22	0,02			2.664	2,73				

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1	\$ (1)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	24	(22)	(0,02)
				\$ (23)	(0,02)

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	1	\$ (1)	\$ 0	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	1	(1)	(5)	(0,01)
				\$ (2)	\$ (5)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (28)	(0,03)	

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000 %	20.12.2026	\$ 644	\$ 20	0,02
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	1.500	23	0,02
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	700	14	0,01
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	6.400	153	0,16
				\$ 210	0,21

#### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000 %	16.06.2028	¥ 130.000	\$ 8	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	490.000	(63)	(0,06)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	15.12.2041	30.000	(1)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	40.000	3	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	\$ 450	117	0,12
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	800	(23)	(0,03)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	900	21	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	3.800	62	0,06
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	1.750	(13)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	9.850	336	0,34
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	24.900	(729)	(0,75)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	100	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023	450	5	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	€ 100	(2)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100 %	13.04.2024	€ 200	\$ (3)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	100	(2)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	100	(2)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	100	(2)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	100	(2)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	400	(1)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	1.100	(8)	(0,01)
					<b>\$ (298)</b>	<b>(0,30)</b>
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					<b>\$ (88)</b>	<b>(0,09)</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	100	\$ 1	\$ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	100	1	(2)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	100	0	0	0,00
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	100	(1)	(2)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	100	(1)	(2)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	100	(1)	(2)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	100	(1)	(2)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	100	0	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	100	1	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	100	1	(1)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	100	(1)	(2)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	100	0	0	0,00
							<b>\$ (20)</b>	<b>\$ (30)</b>	<b>(0,03)</b>

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
MYC	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 200	\$ (9)	\$ 2	\$ (7)	(0,01)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund II (Fort.)

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	\$	136	89	\$ 0	0,00
BOA	07.2023	MXN	\$	19.278	1.100	\$ (22)	(0,02)
	08.2023	\$	AUD	1.997	2.958	(26)	(0,03)
	08.2023		CNY	38	264	(2)	0,00
	08.2023		NZD	315	497	(11)	(0,01)
	09.2023	TWD	\$	2.442	80	0	0,00
	09.2023	\$	HKD	126	988	0	0,00
	09.2023		KRW	161	204.490	(6)	(0,01)
BPS	07.2023	HKD	\$	107	14	0	0,00
	07.2023	\$	AUD	140	212	1	0,00
	08.2023	AUD	\$	212	141	(1)	0,00
	08.2023	CNH		274	40	2	0,00
	08.2023	TWD		1.222	40	1	0,00
	08.2023	\$	CNY	20	139	(1)	0,00
	08.2023		MXN	352	6.135	2	0,00
	09.2023		IDR	16	246.803	0	0,00
	10.2023	ZAR	\$	5.836	314	8	0,01
	12.2023	MXN		1.256	70	(1)	0,00
BRC	08.2023	€		4.259	4.652	(4)	0,00
	08.2023	£		8.440	10.561	(171)	(0,17)
	09.2023	HKD		1.110	142	0	0,00
	09.2023	IDR		1.279	0	0	0,00
CBK	07.2023	BRL		964	195	(5)	0,00
	07.2023	\$	BRL	75	365	0	0,00
	07.2023		CLP	328	265.479	2	0,00
	07.2023		MXN	1.016	19.561	122	0,13
	08.2023	£	\$	196	244	(6)	(0,01)
	08.2023	TWD		1.176	39	0	0,00
	08.2023	\$	BRL	51	265	3	0,00
	08.2023		¥	573	76.124	(43)	(0,04)
	09.2023	KRW	\$	2.005	2	0	0,00
	09.2023	\$	IDR	1	9.188	0	0,00
DUB	07.2023		BRL	1.192	6.457	147	0,15
GLM	07.2023	BRL	\$	6.398	1.315	(11)	(0,01)
	07.2023	\$	BRL	97	521	11	0,01
	09.2023	TWD	\$	4.269	140	3	0,00
	09.2023	\$	BRL	1.226	5.984	1	0,00
	10.2023		MXN	135	2.363	1	0,00
MBC	08.2023	CNH	\$	188	27	1	0,00
	09.2023	\$	KRW	297	379.065	(8)	(0,01)
MYI	07.2023	AUD	\$	197	131	0	0,00
	07.2023	€		480	523	0	0,00
	07.2023	£		33	42	0	0,00
	07.2023	IDR		82.509	5	0	0,00
	07.2023	\$	IDR	6	82.509	0	0,00
	08.2023	€	\$	63	68	(1)	0,00
	08.2023	TWD		1.326	44	1	0,00
	08.2023	\$	¥	1.058	140.541	(79)	(0,08)
	09.2023	IDR	\$	82.581	6	0	0,00
	09.2023	KRW	1.000.285		766	4	0,00
	09.2023	\$	IDR	26	393.464	0	0,00
SCX	09.2023		KRW	333	426.008	(8)	(0,01)
	08.2023	AUD	\$	386	256	(2)	(0,01)
	08.2023	CNH		322	47	2	0,00
	08.2023	¥		22.300	162	7	0,01
	08.2023	NZD		687	418	(3)	0,00
	08.2023	\$	CNY	57	389	(3)	0,00
	08.2023		NZD	110	176	(2)	0,00
	09.2023	TWD	\$	2.040	67	1	0,00
	09.2023	\$	IDR	661	9.830.878	(8)	(0,01)
SSB	07.2023	CLP	\$	265.860	331	0	0,00
	08.2023	\$	CLP	331	266.628	0	0,00
	09.2023		BRL	753	3.820	30	0,03
UAG	07.2023	AUD	\$	109	71	(1)	0,00
	07.2023	\$	AUD	22	34	0	0,00
	08.2023	AUD	\$	34	22	0	0,00
	08.2023	ZAR		512	27	0	0,00
						\$ 355	(0,07)
						\$ (427)	
						\$ (72)	

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE**

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
AZD	07.2023	AUD	\$	538	357	\$ 0	(1)	0,00	
	07.2023	\$	AUD	668	1.021	11	0	0,01	
	08.2023			357	538	1	0	0,00	
BOA	07.2023			2.217	3.402	51	(3)	0,05	
BPS	07.2023	AUD	\$	3.019	1.999	0	(12)	(0,01)	
	07.2023	\$	AUD	1.781	2.745	46	0	0,05	
CBK	08.2023			1.855	2.798	9	0	0,01	
	07.2023			426	653	9	0	0,01	
SCX	07.2023	AUD	\$	949	630	0	(2)	0,00	
	07.2023	\$	AUD	515	788	10	0	0,01	
UAG	08.2023			631	949	2	0	0,00	
	07.2023	AUD	\$	3.222	2.139	4	(9)	(0,01)	
	07.2023	\$	AUD	795	1.214	13	0	0,01	
	08.2023			2.141	3.222	9	(4)	0,01	
						\$ 165	\$ (31)	\$ 134	0,14

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
AZD	07.2023	\$	€	520	476	\$ 0	0	0,00	
BOA	07.2023	€	\$	5	5	0	0	0,00	
	07.2023	\$	€	1.389	1.292	21	0	0,02	
BPS	07.2023	€	\$	1.502	1.646	7	0	0,01	
	07.2023	\$	€	1.387	1.290	21	0	0,02	
BRC	08.2023			1.615	1.472	0	(7)	(0,01)	
	07.2023			323	300	4	0	0,00	
CBK	07.2023	€	\$	1.695	1.842	0	(7)	(0,01)	
	07.2023	\$	€	217	200	1	0	0,00	
MBC	08.2023			1.781	1.636	6	0	0,01	
	07.2023			100	93	2	0	0,00	
SCX	07.2023			1.408	1.316	27	0	0,03	
						\$ 89	\$ (14)	\$ 75	0,07

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2023	£	\$	354	445	\$ 0	(5)	(0,01)	
	07.2023	\$	£	3.039	2.400	12	0	0,01	
BPS	07.2023			3.352	2.710	94	0	0,10	
BRC	07.2023			197	158	4	0	0,01	
CBK	07.2023	£	\$	62	79	0	0	0,00	
	07.2023	\$	£	242	192	2	0	0,00	
MBC	07.2023			3.338	2.697	90	0	0,09	
MYI	07.2023			3.360	2.703	77	0	0,08	
						\$ 279	\$ (5)	\$ 274	0,28

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 374 0,38

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA	\$ 200	\$ (182)	(0,19)
3,500 % fällig am 01.08.2053			
5,000 % fällig am 01.08.2053	200	(196)	(0,20)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (378)	(0,39)
Summe Anlagen		\$ 102.378	104,77
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (4.661)	(4,77)
Nettovermögen		\$ 97.717	100,00

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Income Fund II (Fort.)

- (b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
(c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
(d) Mit dem Fonds verbunden.  
(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,04 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2021	\$ 77	\$ 21	0,02

Barmittel in Höhe von 1.541 USD (31. Dezember 2022: 961 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 141 USD (31. Dezember 2022: 61 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 94.643	\$ 248	\$ 94.891
Investmentfonds	7.607	0	0	7.607
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1)	259	0	258
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(378)	0	(378)
<b>Summen</b>	<b>\$ 7.606</b>	<b>\$ 94.524</b>	<b>\$ 248</b>	<b>\$ 102.378</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 56.688	\$ 282	\$ 56.970
Investmentfonds	1.740	0	0	1.740
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(4)	316	0	312
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.736</b>	<b>\$ 57.004</b>	<b>\$ 282</b>	<b>\$ 59.022</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 9	\$ 0	\$ 9	\$ 3	\$ 0	\$ 3
BOA	9	0	9	(65)	0	(65)
BPS	169	(260)	(91)	(73)	0	(73)
BRC	(167)	90	(77)	(5)	0	(5)
CBK	86	0	86	24	0	24
DUB	143	0	143	(2)	0	(2)
GLM	(19)	20	1	(36)	30	(6)
MBC	85	0	85	22	0	22
MYC	(7)	31	24	(8)	31	23
MYI	(6)	0	(6)	(10)	0	(10)
SCX	30	0	30	27	0	27
SSB	30	0	30	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	12	0	12	3	0	3

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	49,90	55,36
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,21	45,23
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	0,03
Investmentfonds	7,78	3,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	0,00

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,09)	0,76
Freiverkehrsfinanzderivate	0,38	(0,21)
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,39)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,95	1,71
Unternehmensanleihen und Wechsel	12,35	12,97
US-Regierungsbehörden	36,16	19,84
US-Schatzobligationen	22,45	35,05
Non-Agency-MBS	16,94	17,43
Forderungsbesicherte Wertpapiere	5,52	10,35
Staatsemissionen	2,73	3,23
Stammaktien	0,02	0,04
Bezugsrechte	0,00	0,00
Investmentfonds	7,78	3,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,02)	0,01
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,21	0,28
Zinsswaps	(0,30)	0,48
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,03)	(0,08)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,07)	(0,27)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,49	0,15
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,39)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,77)	(4,24)
Nettovermögen	100,00	100,00







## Aufstellung des Wertpapierbestands des Inflation Multi-Asset Fund (Fort.)

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	8	\$ 3	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1	0	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	51	71	0,02
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	2	(2)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	49	49	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	119	(134)	(0,04)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	53	(108)	(0,03)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	7	5	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	693	652	0,20
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	26	(96)	(0,03)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	11	26	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	120	241	0,07
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	196	(227)	(0,07)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	147	163	0,05
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	85	5	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	71	(117)	(0,04)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2023	60	(80)	(0,02)
				<b>\$ 451</b>	<b>0,14</b>

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 113,000	21.07.2023	102	\$ (72)	\$ (114)	(0,04)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					<b>\$ 337</b>	<b>0,10</b>

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variablem Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.03.2042	£ 2.200	\$ 179	0,05
Zahlung		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,500	15.06.2052	12.100	(4.116)	(1,27)
Erhalt <sup>(1)</sup>		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053	7.400	670	0,21
Erhalt		1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2031	¥ 50.000	10	0,00
Erhalt		1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	20.03.2029	154.390	36	0,01
Erhalt		1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.12.2031	1.507.000	(64)	(0,02)
Erhalt <sup>(1)</sup>		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,840	21.11.2028	\$ 3.100	296	0,09
Zahlung <sup>(1)</sup>		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	21.11.2053	600	(170)	(0,05)
Erhalt <sup>(1)</sup>		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	10.900	241	0,07
Zahlung <sup>(1)</sup>		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	24.600	(442)	(0,14)
Erhalt <sup>(1)</sup>		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	35.500	213	0,07
Zahlung		3-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 1.500	(36)	(0,01)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,190	04.11.2052	200	92	0,03
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	200	104	0,03
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	400	183	0,06
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	600	(64)	(0,02)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	300	(31)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	300	(31)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	600	(56)	(0,02)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	200	(19)	(0,01)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,879	15.08.2032	8.400	(104)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	19.500	139	0,04
Erhalt <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	39.400	(14)	0,00
Erhalt		CPTFEMU	2,359	15.08.2030	1.400	63	0,02
Erhalt		CPTFEMU	2,470	15.07.2032	1.100	53	0,02
Zahlung		CPTFEMU	2,590	15.12.2052	500	(28)	(0,01)
Erhalt		CPTFEMU	2,600	15.05.2032	2.400	112	0,03
Zahlung		CPTFEMU	2,680	15.04.2053	2.100	(31)	(0,01)
Zahlung		CPTFEMU	2,700	15.04.2053	600	(8)	0,00
Erhalt		CPTFEMU	2,720	15.06.2032	4.200	104	0,03
Erhalt		CPTFEMU	2,965	15.05.2027	10.700	407	0,12
Erhalt		CPTFEMU	2,980	15.06.2027	9.900	208	0,06
Erhalt		CPTFEMU	3,000	15.05.2027	1.900	68	0,02
Erhalt		CPTFEMU	3,130	15.05.2027	2.100	61	0,02
Zahlung		CPURNSA	1,280	19.05.2030	\$ 600	(39)	(0,01)
Erhalt		CPURNSA	1,794	24.08.2027	850	59	0,02
Erhalt		CPURNSA	1,798	25.08.2027	300	21	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	CPURNSA	1,890 %	27.08.2027	\$ 500	\$ 35	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	750	(56)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,165	16.04.2029	500	(39)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,314	26.02.2026	400	30	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	300	(24)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,360	09.05.2028	450	(36)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	460	(37)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	300	(24)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,419	05.03.2026	700	52	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	300	23	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	500	38	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	300	23	0,01
Zahlung	FRCPXT0B	1,280	15.11.2034	€ 200	(45)	(0,01)
Zahlung	FRCPXT0B	1,590	15.02.2028	180	(30)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	£ 800	(201)	(0,06)
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	500	(111)	(0,03)
Zahlung	UKRPI	3,850	15.09.2024	400	(94)	(0,03)
Erhalt	UKRPI	4,143	15.10.2032	400	19	0,01
Erhalt	UKRPI	4,288	15.02.2032	2.500	280	0,09
Erhalt	UKRPI	4,595	15.08.2032	4.600	15	0,00
Erhalt	UKRPI	4,615	15.02.2027	4.900	350	0,11
Erhalt	UKRPI	4,735	15.12.2026	400	54	0,02
Erhalt	UKRPI	5,200	15.06.2024	1.300	85	0,03
Erhalt	UKRPI	5,330	15.06.2024	1.800	111	0,03
Erhalt	UKRPI	6,600	15.05.2024	800	49	0,01
						\$ (1.467) (0,45)
						\$ (1.467) (0,45)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## OPTIONSKAUF

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,237 %	17.11.2023	2.300	\$ 143	\$ 505	0,16

## VERKAUFSoPTIONEN

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	300	\$ (14)	\$ (17)	(0,01)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	16.200	\$ (46)	\$ (19)	(0,01)
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,340	17.11.2023	11.200	(141)	(826)	(0,26)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420	21.09.2023	38.400	(218)	(164)	(0,04)
JPM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	12.09.2023	22.700	(64)	(26)	(0,01)
							\$ (469)	\$ (1.035)	(0,32)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens	
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 200	\$ (6)	\$ 5	\$ (1)	0,00	
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	800	(26)	23	(3)	0,00	
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	200	0	(2)	(2)	0,00	
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(12)	10	(2)	0,00	
						\$ (44)	\$ 36	\$ (8)	0,00

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Inflation Multi-Asset Fund (Fort.)

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
MYC	Erhalt	CPURNSA	1,800 %	20.07.2026	\$ 600	\$ 0	\$ (88)	\$ (88)	(0,03)
	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	50	0	(7)	(7)	0,00
	Erhalt	CPURNSA	1,810	19.07.2026	500	0	(72)	(72)	(0,02)
						\$ 0	\$ (167)	\$ (167)	(0,05)

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	TRNGLU Index	2.052	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 9.053	12.07.2023	\$ 0	\$ 243	\$ 243	0,07
	Erhalt	TRNGLU Index	1.133	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	4.962	29.11.2023	0	166	166	0,05
	Erhalt	BCOMTR Index	35.886	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	8.282	15.02.2024	0	(163)	(163)	(0,05)
JPM	Erhalt	JMABDEWU Index	16.708	0,053 %	2.676	15.02.2024	0	18	18	0,01
	Erhalt	JMABNIU5 Index	95.050	0,000	16.992	15.02.2024	0	(96)	(96)	(0,03)
MAC	Erhalt	PIMCODBU Index	265.147	0,160	41.379	15.09.2023	0	(421)	(421)	(0,13)
SOG	Erhalt	TRNGLU Index	656	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.899	07.02.2024	0	73	73	0,02
							\$ 0	\$ (180)	\$ (180)	(0,06)

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	\$ 403	AUD 608	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	08.2023	AUD 608	\$ 404	0	(1)	(1)	0,00
BOA	07.2023	¥ 2.493.300	17.926	676	0	676	0,21
	07.2023	PLN 711	167	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	SEK 4.917	455	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 6.866	MXN 126.399	486	0	486	0,15
	08.2023	CNY 1.684	\$ 238	5	0	5	0,00
	08.2023	\$ 1.545	CNY 10.601	0	(78)	(78)	(0,02)
	08.2023	290	SEK 3.128	0	0	0	0,00
	09.2023	IDR 160.823	\$ 11	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 1.038	KRW 1.315.383	0	(36)	(36)	(0,01)
	07.2023	AUD 3.186	\$ 2.080	0	(41)	(41)	(0,01)
BPS	07.2023	BRL 942	189	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	CHF 216	242	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK 67.210	9.683	0	(165)	(165)	(0,05)
	07.2023	€ 998	1.088	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	TRY 5.005	193	2	0	2	0,00
	07.2023	\$ 288	AUD 435	1	0	1	0,00
	07.2023	19	CHF 17	0	0	0	0,00
	07.2023	1.220	CZK 26.248	0	(16)	(16)	(0,01)
	07.2023	363	€ 333	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD 435	\$ 288	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 242	CHF 216	0	0	0	0,00
	08.2023	1.823	CNY 12.467	0	(99)	(99)	(0,03)
	08.2023	64	ZAR 1.170	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	THB 6	\$ 0	0	0	0	0,00
	10.2023	\$ 457	ZAR 8.507	0	(12)	(12)	0,00
	BRC	07.2023	MYR 1.065	\$ 227	0	(2)	(2)
07.2023		PHP 10.498	186	0	(4)	(4)	0,00
07.2023		\$ 1.926	MYR 8.837	0	(29)	(29)	(0,01)
08.2023		HUF 63.157	\$ 184	1	0	1	0,00
08.2023		\$ 365	COP 1.554.877	3	0	3	0,00
08.2023		16	ZAR 298	0	0	0	0,00
CBK	09.2023	MXN 9.026	\$ 517	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	\$ 730	HKD 5.700	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	€ 37.165	\$ 39.883	0	(664)	(664)	(0,20)
	07.2023	£ 133	169	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 450	CLP 363.973	4	0	4	0,00
	07.2023	1.075	CZK 23.164	0	(12)	(12)	0,00
	07.2023	316	€ 291	2	0	2	0,00
	07.2023	1.080	PHP 58.897	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	1.025	RON 4.632	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	CLP 864.597	\$ 1.044	0	(30)	(30)	(0,01)
CLY	08.2023	\$ 1.465	CLP 1.199.044	19	0	19	0,01
	09.2023	KRW 12.894	\$ 10	0	0	0	0,00
	07.2023	SGD 43	32	0	0	0	0,00
DUB	07.2023	\$ 2.556	BRL 13.847	315	0	315	0,10

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
FAR	07.2023	\$ 1	CLP 558	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	07.2023	BRL 12.946	\$ 2.681	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 364	DKK 2.525	6	0	6	0,00
	09.2023	2.681	BRL 13.089	2	0	2	0,00
	10.2023	272	ZAR 5.096	0	(5)	(5)	0,00
JPM	07.2023	MXN 3.951	\$ 224	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	\$ 477	DKK 3.260	2	(1)	1	0,00
	07.2023	20.927	£ 16.551	115	0	115	0,04
	07.2023	6.073	¥ 868.528	0	(64)	(64)	(0,02)
	07.2023	71	PHP 3.854	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	£ 16.551	\$ 20.932	0	(115)	(115)	(0,04)
	08.2023	¥ 864.838	6.073	64	0	64	0,02
	08.2023	TWD 7.088	232	4	0	4	0,00
	08.2023	\$ 1.923	CNY 13.152	0	(103)	(103)	(0,03)
	08.2023	1.573	HUF 541.881	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023	IDR 67.271	\$ 4	0	0	0	0,00
	09.2023	SGD 383	284	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 2.024	IDR 30.134.290	0	(22)	(22)	(0,01)
	09.2023	2.301	INR 189.607	4	0	4	0,00
	09.2023	446	PEN 1.641	4	0	4	0,00
	09.2023	1.001	THB 34.330	0	(26)	(26)	(0,01)
	10.2023	MXN 4.387	\$ 250	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	AUD 447	295	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	CAD 1.717	1.269	0	(29)	(29)	(0,01)
	07.2023	\$ 166	€ 151	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	4.214	TWD 128.404	0	(90)	(90)	(0,03)
	09.2023	1.912	KRW 2.438.339	0	(54)	(54)	(0,02)
MYI	07.2023	£ 285	\$ 353	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	IDR 42.403	3	0	0	0	0,00
	07.2023	TRY 4.785	194	11	0	11	0,00
	07.2023	\$ 861	€ 790	1	0	1	0,00
	07.2023	3	IDR 42.403	0	0	0	0,00
	07.2023	609	MYR 2.803	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	458	SEK 4.913	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	207	ZAR 4.017	5	0	5	0,00
	09.2023	IDR 42.440	\$ 3	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 857	ILS 3.076	0	(26)	(26)	(0,01)
	09.2023	497	INR 40.954	1	0	1	0,00
	09.2023	2.141	KRW 2.740.298	0	(53)	(53)	(0,02)
	09.2023	457	THB 15.648	0	(12)	(12)	0,00
RBC	07.2023	MXN 10.194	\$ 530	0	(64)	(64)	(0,02)
	08.2023	11.249	649	0	(1)	(1)	0,00
RYL	07.2023	\$ 3.372	PLN 14.293	143	0	143	0,04
SCX	07.2023	CZK 3.823	\$ 173	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 593	AUD 893	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD 893	\$ 593	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	TWD 6.481	212	4	0	4	0,00
	09.2023	8.164	270	8	0	8	0,00
	09.2023	\$ 1.440	INR 118.584	2	0	2	0,00
	09.2023	1.029	THB 35.526	0	(19)	(19)	(0,01)
SOG	07.2023	SGD 363	\$ 270	2	0	2	0,00
SSB	07.2023	CLP 365.054	454	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 454	CLP 366.108	0	0	0	0,00
	09.2023	BRL 1.038	\$ 205	0	(8)	(8)	0,00
TOR	07.2023	¥ 57.100	409	14	0	14	0,00
	07.2023	\$ 726	AUD 1.099	6	0	6	0,00
	07.2023	1.298	CAD 1.717	1	(1)	0	0,00
	08.2023	AUD 1.099	\$ 726	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	CAD 1.716	1.298	1	(1)	0	0,00
UAG	07.2023	£ 16.133	20.104	0	(407)	(407)	(0,13)
	07.2023	\$ 396	AUD 599	2	0	2	0,00
	07.2023	234	CHF 210	1	0	1	0,00
	07.2023	4.965	SGD 6.557	0	(118)	(118)	(0,04)
	07.2023	2.383	TRY 54.909	0	(292)	(292)	(0,09)
	08.2023	AUD 599	\$ 396	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 1.920	\$ (2.793)	\$ (873)	(0,27)

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E AUD (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 19	\$ 12	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 24	AUD 36	1	0	1	0,00
	08.2023	12	19	0	0	0	0,00
BOA	07.2023	KRW 160	\$ 0	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 72	AUD 111	2	0	2	0,00
BPS	07.2023	AUD 103	\$ 68	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 37	AUD 58	1	0	1	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Inflation Multi-Asset Fund (Fort.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	08.2023	\$	64 AUD	97	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023		0 KRW	160	0	0	0,00
CBK	08.2023	KRW	160 \$	0	0	0	0,00
	07.2023	\$	15 AUD	23	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD	33 \$	22	0	0	0,00
	07.2023	\$	18 AUD	28	0	0	0,00
UAG	08.2023		22	33	0	0	0,00
	07.2023	AUD	101 \$	67	0	0	0,00
	08.2023	\$	67 AUD	101	0	0	0,00
				\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	938 \$	1.022	\$ 1	\$ (3)	0,00
	07.2023	\$	17.264 €	16.064	262	0	0,08
BPS	07.2023	€	51.685 \$	56.628	240	(1)	0,07
	07.2023	\$	56.373 €	52.440	840	0	0,27
CBK	08.2023		54.645	49.803	0	(237)	(0,07)
	07.2023	€	16.413 \$	17.803	1	(105)	(0,03)
JPM	08.2023	\$	13.294 €	12.211	46	0	0,01
	07.2023	€	49.469 \$	54.016	44	0	0,01
MBC	08.2023	\$	54.091 €	49.469	0	(46)	(0,01)
	07.2023	€	2.928 \$	3.146	1	(49)	(0,02)
SOG	07.2023	\$	56.411 €	52.440	801	0	0,25
				\$ 2.236	\$ (441)	\$ 1.795	0,56

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Partially Hedged) thesaurierend und Class E GBP (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	385 \$	489	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	KRW	10	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	\$	7 £	6	0	0	0,00
	07.2023		533	431	15	0	0,00
BRC	07.2023		11	9	0	0	0,00
	07.2023		2 KRW	3.074	0	0	0,00
CBK	08.2023	KRW	3.070 \$	2	0	0	0,00
	07.2023	£	20	25	0	0	0,00
JPM	07.2023		1.262	1.596	0	(9)	(0,00)
	08.2023	\$	1.596 £	1.262	9	0	0,00
MBC	07.2023	£	63 \$	78	0	(2)	(0,00)
	07.2023	\$	1.762 £	1.423	47	0	0,02
MYI	07.2023		1.790	1.440	41	0	0,01
RYL	07.2023		6	5	0	0	0,00
TOR	07.2023	£	1.265 \$	1.608	0	(1)	(0,00)
	08.2023	\$	1.608 £	1.265	1	0	0,00
UAG	07.2023	KRW	3.058	\$ 2	0	0	0,00
				\$ 113	\$ (12)	\$ 101	0,03

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Administrative SGD (Hedged) ausschüttend II und E Class SGD (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	\$	8 SGD	11	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	07.2023		654	885	0	0	0,00
GLM	07.2023	SGD	117 \$	87	1	0	0,00
JPM	07.2023		2.151	1.590	0	0	0,00
	08.2023	\$	1.590 SGD	2.149	0	0	0,00
MBC	07.2023		1.492	2.016	0	(3)	(0,00)
MYI	07.2023	SGD	2.133 \$	1.579	2	0	0,00
UAG	08.2023	\$	1.544 SGD	2.085	0	(2)	(0,00)
	07.2023	SGD	99 \$	74	1	0	0,00
	07.2023	\$	1.629 SGD	2.204	0	(1)	(0,00)
				\$ 4	\$ (6)	\$ (2)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 123	0,04
Summe Anlagen						\$ 360.568	111,23
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (36.390)	(11,23)
Nettovermögen						\$ 324.178	100,00



**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.  
 (b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
 (c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
 (d) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von 5.441 USD (31. Dezember 2022: 5.919 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.060 USD (31. Dezember 2022: 2.260 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 18.002	\$ 275.841	\$ 63	\$ 293.906
Investmentfonds	63.568	0	0	63.568
Pensionsgeschäfte	0	4.101	0	4.101
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	360	(1.367)	0	(1.007)
<b>Summen</b>	<b>\$ 81.930</b>	<b>\$ 278.575</b>	<b>\$ 63</b>	<b>\$ 360.568</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 8.543	\$ 311.578	\$ 0	\$ 320.121
Investmentfonds	68.975	0	0	68.975
Pensionsgeschäfte	0	40.720	0	40.720
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.933	2.088	0	4.021
<b>Summen</b>	<b>\$ 79.451</b>	<b>\$ 354.386</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 433.837</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
ÄZD	\$ 1	\$ 0	\$ 1	\$ 1	\$ 0	\$ 1
BOA	1.307	(1.360)	(53)	441	(240)	201
BPS	745	(690)	55	(230)	620	390
BRC	(34)	20	(14)	170	170	340
CBK	(760)	760	0	430	(240)	190
DUB	(6)	0	(6)	(119)	0	(119)
FAR	(164)	0	(164)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(15)	0	(15)	557	(550)	7
GST	(1)	0	(1)	(118)	260	142
JPM	(258)	440	182	40	400	440
MAC	(421)	890	469	192	0	192
MBC	(183)	0	(183)	375	(200)	175
MYC	(170)	260	90	(176)	260	84
MYI	(51)	0	(51)	(336)	550	214
RBC	(65)	0	(65)	(21)	0	(21)
RYL	143	0	143	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(2)	0	(2)	(2)	0	(2)
SCX	(7)	0	(7)	2.207	(260)	1.947
SOG	876	(650)	226	66	0	66
SSB	(8)	0	(8)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	14	0	14	1	0	1
UAG	(818)	690	(128)	475	(530)	(55)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	69,28	53,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	21,11	24,35
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,27	1,21
Investmentfonds	19,61	17,11
Pensionsgeschäfte	1,27	10,10
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	0,49
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,45)	(0,47)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,04	0,98

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	2,65	3,02
US-Regierungsbehörden	17,58	10,47
US-Schatzobligationen	28,19	29,26
Non-Agency-MBS	4,19	4,06
Forderungsbesicherte Wertpapiere	3,51	3,00
Staatsemissionen	27,67	20,01
Stammaktien	0,23	0,37
Vorzugswertpapiere	0,04	0,14
Real Estate Investment Trusts	5,32	1,75
Kurzfristige Instrumente	1,28	7,34
Investmentfonds	19,61	17,11
Pensionsgeschäfte	1,27	10,10
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,14	0,49
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,04)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	(0,45)	(0,47)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,16	0,14
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Inflation-Capped Options	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,32)	(0,23)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,05)	(0,04)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,06)	(0,20)
Devisenterminkontrakte	(0,27)	0,33
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,59	0,99
Sonstige Aktiva und Passiva	(11,23)	(7,63)
Nettovermögen	100,00	100,00





## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	91	\$ 150	0,02
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	42	(152)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.073	(3.156)	(0,36)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	297	(591)	(0,07)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	779	1.556	0,18
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	544	411	0,05
				<b>\$ (1.782)</b>	<b>(0,20)</b>
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				<b>\$ (1.782)</b>	<b>(0,20)</b>

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.12.2024	\$ 1.000	\$ 6	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-38 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2027	\$ 10.094	\$ (298)	(0,04)
CDX.IG-39 5-Year Index	(1,000)	20.12.2027	9.700	(86)	(0,01)
CDX.IG-40 5-Year Index	(1,000)	20.06.2028	112.100	(816)	(0,09)
				<b>\$ (1.200)</b>	<b>(0,14)</b>

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000 %	17.03.2024	¥ 5.680.000	\$ (71)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,380	18.06.2028	90.000	(9)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	\$ 3.930	141	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	2.900	(72)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	1.100	(19)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	1.200	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	1.800	(15)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,270	13.09.2024	5.000	47	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,350	14.09.2024	3.200	28	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	NZD 279.100	(2.375)	(0,27)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month NZD-BBR	4,500	13.09.2024	8.800	(66)	(0,01)
					<b>\$ (2.428)</b>	<b>(0,27)</b>
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					<b>\$ (3.622)</b>	<b>(0,41)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Average Duration Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	12.600	\$ 101	\$ 184	0,02
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	11.09.2023	11.800	88	170	0,02
							\$ 189	\$ 354	0,04

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250 %	12.09.2023	12.600	\$ (63)	\$ (125)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,750	12.09.2023	12.600	(38)	(71)	(0,01)
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,233	11.09.2023	11.800	(55)	(119)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,715	11.09.2023	11.800	(33)	(70)	(0,01)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	26.600	(193)	(5)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	26.600	(193)	(514)	(0,06)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	40.700	(148)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	40.700	(148)	(529)	(0,06)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	14.800	(46)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	14.800	(46)	(185)	(0,02)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,715	11.09.2023	10.700	(30)	(64)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	53.500	(361)	(10)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	53.500	(361)	(1.127)	(0,13)
							\$ (1.715)	\$ (2.825)	(0,32)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 2.000	\$ (94)	\$ 23	\$ (71)	(0,01)
CBK	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.600	(270)	72	(198)	(0,02)
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.900	(108)	50	(58)	(0,01)
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.300	(205)	104	(101)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.200	(195)	47	(148)	(0,02)
					\$ (872)	\$ 296	\$ (576)	(0,07)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 373	\$ 244	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	07.2023	\$ 513	AUD 773	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD 773	\$ 514	0	(2)	(2)	0,00
BOA	08.2023	¥ 54.000	383	7	0	7	0,00
	08.2023	NZD 615	390	13	0	13	0,00
	08.2023	\$ 588	€ 545	8	0	8	0,00
BPS	07.2023	1.357 AUD	2.016	2	(17)	(15)	0,00
	08.2023	AUD 553	\$ 366	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	\$ 4	CNY 29	0	0	0	0,00
	08.2023	5.132 €	4.767	80	0	80	0,01
	08.2023	179 ZAR	3.332	0	(3)	(3)	0,00
BRC	08.2023	£ 1.157	\$ 1.452	0	(19)	(19)	0,00
	08.2023	\$ 277	¥ 36.619	0	(22)	(22)	0,00
	08.2023	218 ZAR	4.032	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	20 ILS	71	0	(1)	(1)	0,00
CBK	08.2023	CNH 169	\$ 24	1	0	1	0,00
	08.2023	€ 104	114	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 101	PEN 393	8	0	8	0,00
DUB	07.2023	4.847 BRL	26.265	596	0	596	0,07
	10.2023	ZAR 78.208	\$ 4.295	198	0	198	0,02
GLM	07.2023	BRL 26.348	5.457	0	(5)	(5)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
JPM	09.2023	\$ 5.457	BRL 26.640	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	08.2023	£ 12.768	\$ 16.171	0	(65)	(65)	(0,01)
	08.2023	\$ 1.000	£ 808	27	0	27	0,00
	09.2023	PEN 1.470	\$ 399	0	(4)	(4)	0,00
MBC MYI	09.2023	\$ 19	ILS 68	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	€ 89.562	\$ 98.830	915	0	915	0,10
	07.2023	\$ 1.299	€ 1.192	1	0	1	0,00
	07.2023	53	£ 42	0	0	0	0,00
RBC	08.2023	NZD 830	\$ 521	13	0	13	0,00
	08.2023	\$ 3.946	¥ 524.367	0	(294)	(294)	(0,03)
	08.2023	211	ZAR 4.086	5	0	5	0,00
	08.2023	£ 2.468	\$ 3.118	0	(20)	(20)	0,00
SCX	08.2023	MXN 1.115	64	0	0	0	0,00
	07.2023	AUD 1.650	1.078	0	(20)	(20)	0,00
	07.2023	\$ 754	AUD 1.136	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD 1.136	\$ 755	0	(2)	(2)	0,00
SOG TOR	08.2023	CNH 319	46	3	0	3	0,00
	08.2023	NZD 218	136	3	0	3	0,00
	07.2023	AUD 2.461	1.610	0	(28)	(28)	0,00
	07.2023	1.302	852	0	(15)	(15)	0,00
UAG	07.2023	\$ 923	AUD 1.398	7	0	7	0,00
	08.2023	AUD 1.398	\$ 924	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	NZD 526	328	6	0	6	0,00
	08.2023	\$ 1.821	¥ 241.503	0	(140)	(140)	(0,02)
	07.2023	AUD 298	\$ 195	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	\$ 446	AUD 674	3	0	3	0,00
	08.2023	AUD 674	\$ 446	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	£ 11.184	14.136	0	(86)	(86)	(0,01)
UAG	08.2023	\$ 2.161	ZAR 41.491	27	(1)	26	0,00
	09.2023	16	ILS 59	0	(1)	(1)	0,00
	10.2023	ZAR 25.203	\$ 1.361	41	0	41	0,01
				\$ 1.972	\$ (771)	\$ 1.201	0,14

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 310	\$ 338	\$ 0	(1)	\$ (1)	0,00
	07.2023	\$ 19.673	€ 18.305	298	0	298	0,04
BPS	07.2023	€ 19.585	\$ 21.450	83	0	83	0,01
	07.2023	\$ 19.672	€ 18.300	293	0	293	0,03
CBK	08.2023	18.696	17.039	0	(81)	(81)	(0,01)
	07.2023	€ 18.165	\$ 19.759	4	(63)	(59)	(0,01)
CLY	07.2023	\$ 120	€ 112	2	0	2	0,00
	08.2023	18.135	16.657	63	0	63	0,01
JPM	07.2023	€ 2.917	\$ 3.123	0	(59)	(59)	(0,01)
	07.2023	16.657	18.188	15	0	15	0,00
MBC	08.2023	\$ 18.213	€ 16.657	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	€ 112	\$ 121	0	(1)	(1)	0,00
SOG	07.2023	\$ 2.830	€ 2.646	57	0	57	0,01
	07.2023	19.686	18.300	279	0	279	0,03
				\$ 1.094	\$ (221)	\$ 873	0,10

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	\$ 9.062	£ 7.327	\$ 253	\$ 0	\$ 253	0,03
BRC	07.2023	£ 15	\$ 19	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 17	£ 14	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£ 99	\$ 126	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 179	£ 140	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2023	£ 7.287	\$ 9.213	0	(51)	(51)	(0,01)
	08.2023	\$ 9.215	£ 7.287	51	0	51	0,01
MBC	07.2023	9.070	7.327	245	0	245	0,03
MYI	07.2023	9.041	7.274	207	0	207	0,02
TOR	07.2023	£ 7.307	\$ 9.285	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	\$ 9.287	£ 7.307	5	0	5	0,00
				\$ 761	\$ (57)	\$ 704	0,08

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (269) (0,03)



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Average Duration Fund (Forts.)

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,000 % fällig am 01.08.2053	\$ 24.500	\$ (21.597)	(2,44)
3,500 % fällig am 01.08.2053	31.000	(28.282)	(3,19)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (49.879)	(5,63)
Summe Anlagen		\$ 1.182.245	133,43
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (296.233)	(33,43)
Nettovermögen		\$ 886.012	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Reines Kapitalwertpapier.  
 (b) Nullkuponwertpapier.  
 (c) Mit dem Fonds verbunden.  
 (d) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,26 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	5,746 %	25.01.2026	18.01.2022	\$ 2.900	\$ 2.889	0,33

(e) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 221.382 USD (31. Dezember 2022: 143.852 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(f) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 19.552 USD (31. Dezember 2022: 4.050 USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 9.570 USD (31. Dezember 2022: 16.925 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.031 USD (31. Dezember 2022: 5.301 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.153.092	\$ 572	\$ 1.153.664
Investmentfonds	84.133	0	0	84.133
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(2)	(5.671)	0	(5.673)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(49.879)	0	(49.879)
<b>Summen</b>	<b>\$ 84.131</b>	<b>\$ 1.097.542</b>	<b>\$ 572</b>	<b>\$ 1.182.245</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.234.805	\$ 801	\$ 1.235.606
Investmentfonds	37.618	48.013	0	85.631
Pensionsgeschäfte	0	956	0	956
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.960	(9.079)	0	(7.119)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(76.949)	0	(76.949)
<b>Summen</b>	<b>\$ 39.578</b>	<b>\$ 1.197.746</b>	<b>\$ 801</b>	<b>\$ 1.238.125</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,180 %	14.06.2023	05.07.2023	\$ (26.570)	\$ (26.635)	(3,00)
	5,180	15.06.2023	13.07.2023	(139.826)	(140.148)	(15,82)
	5,180	20.06.2023	13.07.2023	(3.026)	(3.031)	(0,34)
GRE	5,180	22.06.2023	06.07.2023	(52.104)	(52.171)	(5,89)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (221.985)</b>	<b>(25,05)</b>

## Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	4,900 %	28.06.2023	05.07.2023	\$ (19.666)	\$ (19.674)	(2,22)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (19.674)</b>	<b>(2,22)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 11 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (4)	\$ 10	\$ 6	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	242	(340)	(98)	(1.233)	1.360	127
BPS	608	(690)	(82)	(2.779)	2.650	(129)
BRC	(48)	30	(18)	8	0	8
CBK	(184)	200	16	903	(890)	13
CLY	(59)	0	(59)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	794	(660)	134	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(19)	0	(19)	(22)	0	(22)
GLM	(1.240)	1.051	(189)	(802)	751	(51)
JPM	(44)	0	(44)	97	(190)	(93)
MBC	1.216	(1.310)	(94)	1.204	(980)	224
MYC	(1.508)	730	(778)	(1.239)	510	(729)
MYI	(68)	0	(68)	(103)	30	(73)
RBC	(20)	0	(20)	(1)	0	(1)
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)
SCX	(14)	10	(4)	277	(230)	47
SOG	251	(290)	(39)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(149)	0	(149)	5	(10)	(5)
UAG	(23)	0	(23)	215	0	215

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	89,92	70,91
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	40,28	43,49
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,78
Investmentfonds	9,50	7,98
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,20)	0,21
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,41)	(0,55)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,03)	(0,32)
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,63)	(7,17)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(25,05)	(13,50)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(2,22)	(0,38)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	24,65	28,04
US-Regierungsbehörden	29,18	22,99
US-Schatzobligationen	59,79	47,28
Non-Agency-MBS	5,71	6,37
Forderungsbesicherte Wertpapiere	10,87	9,23
Kurzfristige Instrumente	k. A.	1,27
Investmentfonds	9,50	7,98
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,20)	0,21

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,14)	(0,07)
Zinsswaps	(0,27)	(0,48)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,04	0,03
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,32)	(0,19)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,07)	(0,07)
Devisenterminkontrakte	0,14	(0,27)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,18	0,18
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,63)	(7,17)
Sonstige Aktiva und Passiva	(33,43)	(15,42)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
Delos Finance SARL				Cantor Fitzgerald LP				ING Belgium S.A.			
7,288 % fällig am 06.10.2023	\$	420	0,05	4,500 % fällig am 14.04.2027	\$	600	0,07	3,375 % fällig am 31.05.2027	€	2.300	0,31
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
ABN AMRO Bank NV	€	700	0,09	Charles Schwab Corp.				ING Groep NV			
3,625 % fällig am 10.01.2026		755		0,750 % fällig am 18.03.2024	2.600	2.509	0,31	1,000 % fällig am 20.09.2023	2.000	2.169	0,27
Aegon Bank NV		3.300	0,44	5,590 % fällig am 18.03.2024	1.500	1.496	0,19	Intesa Sanpaolo SpA	\$	2.200	0,27
0,625 % fällig am 21.06.2024		3.477		China Construction Bank Europe S.A.	€	2.800	0,37	5,017 % fällig am 26.06.2024	600	606	0,08
AerCap Ireland Capital DAC	\$	1.700	0,21	Citigroup, Inc.	\$	2.000	0,24	7,000 % fällig am 21.11.2025	1.000	929	0,12
1,150 % fällig am 29.10.2023		1.673		2,014 % fällig am 25.01.2026 (f)	3.200	3.062	0,38	Jackson National Life Global Funding			
2,875 % fällig am 14.08.2024		700	0,08	3,290 % fällig am 17.03.2026 (f)				1,750 % fällig am 12.01.2025	1.000	929	0,12
Ally Financial, Inc.		500	0,06	Cooperative Rabobank UA		300	0,04	John Deere Capital Corp.		1.000	0,13
1,450 % fällig am 02.10.2023		493		2,625 % fällig am 22.07.2024		290		5,202 % fällig am 11.10.2024		999	
AMCO - Asset Management Co. SpA	€	1.400	0,19	Corebridge Financial, Inc.		1.800	0,21	JPMorgan Chase & Co.		1.600	0,20
4,625 % fällig am 06.02.2027		1.518		3,650 % fällig am 05.04.2027		1.682		5,690 % fällig am 10.12.2025		1.594	
American Honda Finance Corp.	\$	1.800	0,22	Credit Agricole S.A.	€	2.300	0,30	KeyBank N.A.		250	0,03
5,000 % fällig am 23.05.2025		1.793		0,500 % fällig am 24.06.2024		2.426		5,432 % fällig am 03.01.2024		246	
American Tower Corp.		4.000	0,44	Credit Suisse AG	\$	300	0,04	Kilroy Realty LP		800	0,10
1,450 % fällig am 15.09.2026		3.523		4,750 % fällig am 09.08.2024		293		3,450 % fällig am 15.12.2024		758	
3,650 % fällig am 15.03.2027		900	0,11	6,500 % fällig am 08.08.2023 (e)	1.400	1.395	0,17	LeasePlan Corp. NV	€	3.600	0,49
5,250 % fällig am 15.07.2028		1.000	0,12	7,950 % fällig am 09.01.2025	3.000	3.062	0,38	0,125 % fällig am 13.09.2023	\$	1.500	0,18
Ares Capital Corp.		800	0,09	Cromwell Ereit Lux Finco SARL	€	1.600	0,19	2,875 % fällig am 24.10.2024		1.430	
2,875 % fällig am 15.06.2027		694		2,125 % fällig am 19.11.2025		1.507		Lloyds Banking Group PLC		2.000	0,25
Assurant, Inc.		250	0,03	CTP NV		100	0,01	4,050 % fällig am 16.08.2023		1.996	
4,200 % fällig am 27.09.2023		248		0,500 % fällig am 21.06.2025		97	0,01	Logicor Financing SARL	€	400	0,05
Athene Global Funding		2.500	0,31	0,875 % fällig am 20.01.2026		2.100	0,25	0,750 % fällig am 15.07.2024		800	0,09
5,790 % fällig am 24.05.2024		2.476		DAE Sukuk Dfc Ltd.	\$	700	0,08	1,625 % fällig am 15.07.2027		300	0,04
Aviation Capital Group LLC		800	0,10	3,750 % fällig am 15.02.2026		666		2,250 % fällig am 13.05.2025		305	
4,375 % fällig am 30.01.2024		787		Danske Bank A/S		2.100	0,26	Lseg Netherlands BV		1.000	0,13
5,500 % fällig am 15.12.2024		700	0,09	6,600 % fällig am 12.09.2023		2.103		0,000 % fällig am 06.04.2025 (c)		1.017	
Avolon Holdings Funding Ltd.		529	0,06	Deutsche Bank AG		1.600	0,19	LSEGA Financing PLC	\$	1.600	0,18
2,528 % fällig am 18.11.2027		447		1,447 % fällig am 01.04.2025 (f)	1.600	1.521	0,19	1,375 % fällig am 06.04.2026		1.428	
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	€	900	0,11	2,129 % fällig am 24.11.2026 (f)	500	445	0,06	MassMutual Global Funding		1.900	0,24
1,875 % fällig am 09.01.2026		874		3,961 % fällig am 26.11.2025	2.700	2.576	0,32	0,480 % fällig am 28.08.2023		1.886	0,24
2,625 % fällig am 28.04.2025		500	0,06	EPR Properties		400	0,05	4,500 % fällig am 10.04.2026		1.000	0,12
3,625 % fällig am 24.09.2024		4.100	0,54	4,500 % fällig am 01.06.2027		359	0,05	Metropolitan Life Global Funding	€	2.100	0,28
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	\$	1.400	0,17	Equitable Financial Life Global Funding		3.200	0,40	0,375 % fällig am 09.04.2024	\$	300	0,04
0,875 % fällig am 18.09.2023		1.386		5,500 % fällig am 02.12.2025		3.160		0,450 % fällig am 01.09.2023		297	
Banco BTG Pactual S.A.		500	0,06	Extra Space Storage LP		400	0,05	Mitsubishi HC Capital, Inc.		200	0,02
4,500 % fällig am 10.01.2025		483		5,700 % fällig am 01.04.2028		400		3,960 % fällig am 19.09.2023		1.200	0,15
Banco de Sabadell S.A.	€	600	0,08	F&G Global Funding		1.000	0,11	5,080 % fällig am 15.09.2027		1.200	0,15
5,125 % fällig am 10.11.2028		660		2,300 % fällig am 11.04.2027		885		Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	€	2.300	0,31
Banco Santander Chile	\$	500	0,06	Fifth Third Bancorp		500	0,06	3,273 % fällig am 19.09.2025	\$	3.000	0,38
2,700 % fällig am 10.01.2025		479		2,375 % fällig am 28.01.2025		468		6,128 % fällig am 26.07.2023		3.001	
Bank of America Corp.	€	10.200	1,37	Ford Motor Credit Co. LLC	€	100	0,01	Mizuho Financial Group, Inc.	€	400	0,05
2,375 % fällig am 19.06.2024		10.951		1,744 % fällig am 19.07.2024		106		1,020 % fällig am 11.10.2023	€	433	0,05
5,080 % fällig am 20.01.2027	\$	2.266	0,28	2,386 % fällig am 17.02.2026		308	0,04	5,628 % fällig am 13.06.2028	€	2.100	0,32
Bank of Ireland Group PLC		1.100	0,14	3,021 % fällig am 06.03.2024		800	0,11	Morgan Stanley	€	2.100	0,29
6,253 % fällig am 16.09.2026		1.093		3,250 % fällig am 15.09.2025		200	0,03	4,656 % fällig am 02.03.2029	\$	455	0,06
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT		700	0,09	4,174 % fällig am 01.12.2024		1.100	0,15	5,686 % fällig am 24.01.2025		454	
4,625 % fällig am 20.07.2023		700		4,535 % fällig am 06.03.2025	£	600	0,09	Morgan Stanley Bank N.A.		3.000	0,37
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.	£	3.000	0,46	4,950 % fällig am 28.05.2027	\$	500	0,06	4,754 % fällig am 21.04.2026		500	0,06
4,875 % fällig am 25.09.2025		3.658		Freedom Mortgage Corp.		400	0,05	Nasdaq, Inc.		500	0,06
Barclays PLC	€	400	0,05	8,125 % fällig am 15.11.2024		397		5,650 % fällig am 28.06.2025		1.500	0,19
3,375 % fällig am 02.04.2025		431		FS KKR Capital Corp.		800	0,09	National Bank of Canada		1.497	0,19
BGC Partners, Inc.	\$	400	0,05	1,650 % fällig am 12.10.2024		744		5,579 % fällig am 06.08.2024		450	0,06
8,000 % fällig am 25.05.2028		387		2,625 % fällig am 15.01.2027		341	0,04	Nationwide Mutual Insurance Co.		450	0,06
Blackstone Private Credit Fund		900	0,11	GA Global Funding Trust		1.400	0,17	7,842 % fällig am 15.12.2024		450	0,06
2,350 % fällig am 22.11.2024		841		1,000 % fällig am 08.04.2024		1.336		NatWest Group PLC		2.000	0,25
4,700 % fällig am 24.03.2025		700	0,08	Gaci First Investment Co.		1.200	0,15	5,847 % fällig am 02.03.2027		1.200	0,15
BNP Paribas S.A.		1.500	0,17	4,750 % fällig am 14.02.2030		1.183		7,472 % fällig am 10.11.2026		1.228	0,15
2,219 % fällig am 09.06.2026		1.388		General Motors Financial Co., Inc.	£	1.400	0,21	NatWest Markets PLC	€	1.300	0,17
3,800 % fällig am 10.01.2024		494	0,06	5,150 % fällig am 15.08.2026	\$	2.900	0,36	1,000 % fällig am 28.05.2024		1.379	0,17
BPCE S.A.		1.075	0,13	6,290 % fällig am 17.11.2023		2.902		Nissan Motor Acceptance Co. LLC	\$	1.400	0,16
1,625 % fällig am 14.01.2025		1.004		Goldman Sachs Group, Inc.		2.000	0,25	1,125 % fällig am 16.09.2024		1.305	0,16
1,652 % fällig am 06.10.2026		269	0,03	3,850 % fällig am 08.07.2024		1.962	0,25	3,875 % fällig am 21.09.2023		1.000	0,12
3,625 % fällig am 17.04.2026	€	600	0,08	5,749 % fällig am 24.01.2025		1.598	0,20	Nomura Holdings, Inc.		500	0,06
5,700 % fällig am 22.10.2023	\$	800	0,10	Groupe Bruxelles Lambert NV	€	1.700	0,22	1,851 % fällig am 16.07.2025		2.800	0,33
5,975 % fällig am 18.01.2027		2.775	0,35	1,875 % fällig am 19.06.2025		1.776		2,648 % fällig am 16.01.2025		2.800	0,34
Canadian Imperial Bank of Commerce		700	0,09	Hamburg Commercial Bank AG		1.700	0,23	5,386 % fällig am 06.07.2027		2.800	0,34
5,490 % fällig am 14.12.2023		699		4,875 % fällig am 17.03.2025		1.849	0,23	NongHyup Bank		2.500	0,30
				6,250 % fällig am 18.11.2024		2.190	0,27	Nordea Bank Abp		900	0,11
				HSBC Holdings PLC		1.000	0,13	1,125 % fällig am 16.02.2027	€	886	0,11
				3,019 % fällig am 15.06.2027		1.040		Nova Kreditna Banka Maribor d.d.		600	0,08
				Hudson Pacific Properties LP	\$	500	0,05	1,875 % fällig am 27.01.2025		1.160	0,15
				5,950 % fällig am 15.02.2028		398		NTT Finance Corp.	\$	1.200	0,15
								0,583 % fällig am 01.03.2024		1.160	0,15

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
4,142 % fällig am 26.07.2024	\$ 1.800	\$ 1.772	0,22	UniCredit SpA		\$ 2.236	0,28	Charter Communications Operating LLC	\$ 250	\$ 251	0,03
4,239 % fällig am 25.07.2025	2.100	2.044	0,26	5,850 % fällig am 15.11.2027	€ 2.000	2.113	0,26	China Modern Dairy Holdings Ltd.			
4,372 % fällig am 27.07.2027	300	293	0,04	7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 2.100			2,125 % fällig am 14.07.2026	1.400	1.199	0,15
Nykredit Realkredit A/S				VICI Properties LP		749	0,09	CK Hutchison International Ltd.			
1,375 % fällig am 12.07.2027	€ 3.000	2.922	0,37	4,250 % fällig am 01.12.2026	800	378	0,05	4,750 % fällig am 21.04.2028	1.800	1.781	0,22
Pacific Life Global Funding				4,500 % fällig am 01.09.2026	400	696	0,09	CommonSpirit Health			
1,375 % fällig am 14.04.2026	\$ 1.700	1.520	0,19	5,625 % fällig am 01.05.2024	700			2,760 % fällig am 01.10.2024	100	96	0,01
Principal Life Global Funding				Virgin Money UK PLC		923	0,12	ConocoPhillips Co.			
5,471 % fällig am 23.08.2024	500	498	0,06	4,625 % fällig am 29.10.2028	€ 900	3.399	0,43	2,400 % fällig am 07.03.2025	11	10	0,00
Protective Life Global Funding				Volkswagen Financial Services NV		3.649	0,46	Continental Resources, Inc.			
1,170 % fällig am 15.07.2025	1.000	906	0,11	1,125 % fällig am 18.09.2023	£ 2.700			2,268 % fällig am 15.11.2026	500	445	0,06
1,646 % fällig am 13.01.2025	1.000	934	0,12	5,500 % fällig am 07.12.2026	3.000	1.564	0,20	Cox Communications, Inc.			
4,714 % fällig am 06.07.2027	3.300	3.209	0,40	Vonovia SE		2.162	0,27	5,876 % fällig am 15.09.2028	1.000	1.000	0,13
QNB Finance Ltd.				1,375 % fällig am 28.01.2026	€ 1.300	1.295	0,16	CPUK Finance Ltd.			
1,375 % fällig am 26.01.2026	300	272	0,03	Wells Fargo & Co.		1.564	0,20	5,876 % fällig am 28.08.2027	£ 1.000	1.207	0,15
Realty Income Corp.				4,540 % fällig am 15.08.2026	\$ 1.600			CSL Finance PLC			
4,700 % fällig am 15.12.2028	1.000	970	0,12	Weyerhaeuser Co.		2.162	0,27	3,850 % fällig am 27.04.2027	\$ 800	764	0,10
Royal Bank of Canada				4,750 % fällig am 15.05.2026	2.200	4	0,00	DAE Funding LLC			
4,125 % fällig am 05.07.2028 (a)	€ 2.300	2.495	0,31	Yango Justice International Ltd.				1,625 % fällig am 15.02.2024	900	868	0,11
6,205 % fällig am 05.10.2023	\$ 600	601	0,08	5,300 % fällig am 11.01.2022 ^	200	271.329	33,99	2,625 % fällig am 20.03.2025	300	282	0,04
Sagax AB				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Daimler Truck Finance North America LLC			
2,250 % fällig am 13.03.2025	€ 2.200	2.268	0,28	ABB Finance BV				5,125 % fällig am 19.01.2028	1.300	1.289	0,16
Sagax Euro MTN NL BV				0,625 % fällig am 31.03.2024	€ 2.100	2.237	0,28	5,200 % fällig am 17.01.2025	1.100	1.092	0,14
1,625 % fällig am 24.02.2026	1.500	1.466	0,18	Air Canada Pass-Through Trust		604	0,08	Delta Air Lines, Inc.			
Santander Holdings USA, Inc.				3,750 % fällig am 15.06.2029	\$ 662	1.726	0,22	2,900 % fällig am 28.10.2024	2.100	2.018	0,25
6,499 % fällig am 09.03.2029	\$ 4.000	3.960	0,50	Amazon.com, Inc.		1.800	0,22	Devon Energy Corp.			
Santander UK Group Holdings PLC				0,450 % fällig am 12.05.2024	1.800	1.572	0,20	5,250 % fällig am 15.10.2027	600	591	0,07
1,532 % fällig am 21.08.2026	1.200	1.069	0,13	American Airlines Pass-Through Trust		1.688	0,20	eBay, Inc.			
6,833 % fällig am 21.11.2026	2.400	2.407	0,30	3,600 % fällig am 22.03.2029	1.688	3.099	0,39	Energy Transfer LP			
SBA Tower Trust				American Medical Systems Europe BV		3.099	0,39	5,550 % fällig am 15.02.2028	4.000	3.993	0,50
1,631 % fällig am 15.05.2051	1.900	1.641	0,21	0,750 % fällig am 08.03.2025	€ 3.000	2.488	0,31	Entergy Louisiana LLC			
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				Amgen, Inc.		2.488	0,31	0,620 % fällig am 17.11.2023	1.632	1.601	0,20
5,125 % fällig am 29.10.2022 ^	1.400	84	0,01	5,250 % fällig am 02.03.2025	\$ 2.500	1.572	0,20	0,950 % fällig am 01.10.2024	1.400	1.320	0,17
5,250 % fällig am 23.05.2023 ^ (e)	500	30	0,00	Arcadis NV		436	0,05	EQM Midstream Partners LP			
Shinhan Bank Co. Ltd.				4,875 % fällig am 28.02.2028	€ 400	2.053	0,26	4,000 % fällig am 01.08.2024	75	73	0,01
0,250 % fällig am 16.10.2024	€ 1.100	1.139	0,14	ArcelorMittal S.A.		2.162	0,27	Equifax, Inc.			
1,183 % fällig am 29.09.2025	AUD 800	484	0,06	6,550 % fällig am 29.11.2027	\$ 2.000	1.267	0,16	5,100 % fällig am 01.06.2028	600	592	0,07
Sirius Real Estate Ltd.				Asahi Group Holdings Ltd.		500	0,06	Expedia Group, Inc.			
1,125 % fällig am 22.06.2026	€ 1.200	1.083	0,14	0,010 % fällig am 19.04.2024	€ 1.200	518	0,06	6,250 % fällig am 01.05.2025	2.015	2.023	0,25
SLM Corp.				0,155 % fällig am 23.10.2024	500	350	0,04	Flex Ltd.			
3,125 % fällig am 02.11.2026	\$ 600	520	0,07	Ashtead Capital, Inc.		350	0,04	6,000 % fällig am 15.01.2028	1.700	1.728	0,22
SMBC Aviation Capital Finance DAC				1,500 % fällig am 12.08.2026	\$ 400	600	0,07	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide			
3,550 % fällig am 15.04.2024	3.330	3.261	0,41	Astrazeneca Finance LLC		600	0,07	1,625 % fällig am 09.07.2024	€ 2.600	2.763	0,35
4,125 % fällig am 15.07.2023	2.290	2.288	0,29	4,875 % fällig am 03.03.2028	600	1.056	0,13	GE HealthCare Technologies, Inc.			
Societe Generale S.A.				BAE Systems Holdings, Inc.		1.100	0,13	5,550 % fällig am 15.11.2024	\$ 2.400	2.389	0,30
1,488 % fällig am 14.12.2026	2.400	2.113	0,26	3,850 % fällig am 15.12.2025	1.100	324	0,04	Georgia-Pacific LLC			
Standard Chartered PLC				BAT Capital Corp.		874	0,11	0,625 % fällig am 15.05.2024	2.700	2.591	0,32
0,991 % fällig am 12.01.2025	1.000	970	0,12	1,125 % fällig am 16.11.2023	€ 300			Glencore Funding LLC			
1,214 % fällig am 23.03.2025	500	481	0,06	3,222 % fällig am 15.08.2024	\$ 900	2.369	0,30	4,000 % fällig am 27.03.2027	1.500	1.431	0,18
6,170 % fällig am 09.01.2027	300	300	0,04	Baxter International, Inc.		2.369	0,30	Global Payments, Inc.			
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				5,531 % fällig am 29.11.2024	2.389	513	0,06	4,950 % fällig am 15.08.2027	2.000	1.950	0,24
0,010 % fällig am 10.09.2025	€ 5.000	4.988	0,62	Bayer AG		500	0,06	GN Store Nord A/S			
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				0,050 % fällig am 12.01.2025	€ 500	1.735	0,22	0,875 % fällig am 25.11.2024	€ 1.500	1.527	0,19
0,800 % fällig am 12.09.2023	\$ 700	694	0,09	Bayer U.S. Finance LLC		1.737	0,22	Haleon Netherlands Capital BV			
Svenska Handelsbanken AB				6,562 % fällig am 15.12.2023	\$ 1.737	2.616	0,33	1,250 % fällig am 29.03.2026	3.700	3.749	0,47
1,418 % fällig am 11.06.2027	300	263	0,03	BMW Canada, Inc.		3.500	0,43	Haleon U.S. Capital LLC			
Synchrony Bank				4,760 % fällig am 10.02.2025 (f)	CAD 3.500	446	0,06	3,375 % fällig am 24.03.2027	\$ 750	702	0,09
5,400 % fällig am 22.08.2025	1.400	1.341	0,17	BMW U.S. Capital LLC		500	0,06	Home Depot, Inc.			
Synchrony Financial				1,250 % fällig am 12.08.2026	\$ 500	306	0,04	2,875 % fällig am 15.04.2027	600	564	0,07
4,375 % fällig am 19.03.2024	600	588	0,07	0,100 % fällig am 08.03.2025	€ 300	875	0,11	HPHT Finance Ltd.			
Synovus Bank				4,000 % fällig am 15.11.2026	800	760	0,09	2,875 % fällig am 05.11.2024	700	673	0,08
5,625 % fällig am 15.02.2028	500	452	0,06	Bureau Veritas S.A.		700	0,09	Huntington Ingalls Industries, Inc.			
Toronto-Dominion Bank				1,250 % fällig am 07.09.2023	700	1.618	0,20	3,844 % fällig am 01.05.2025	1.200	1.155	0,14
5,440 % fällig am 10.09.2024	410	409	0,05	CDW LLC		1.107	0,14	Hyatt Hotels Corp.			
TP ICAP Finance PLC				2,670 % fällig am 01.12.2026	\$ 1.800	1.107	0,14	1,300 % fällig am 01.10.2023	1.700	1.685	0,21
2,625 % fällig am 18.11.2028	£ 600	564	0,07	4,125 % fällig am 01.05.2025	1.149	3.155	0,40	1,800 % fällig am 01.10.2024	800	762	0,10
Trust Bank				Central Japan Railway Co.		300	0,04	4,850 % fällig am 15.03.2026	300	294	0,04
2,150 % fällig am 06.12.2024	\$ 3.000	2.830	0,35	2,200 % fällig am 02.10.2024	3.300	2.386	0,30	Hyundai Capital America			
U.S. Bancorp				3,400 % fällig am 06.09.2023	300	1.450	0,18	0,875 % fällig am 14.06.2024	1.600	1.526	0,19
4,653 % fällig am 01.02.2029	1.000	956	0,12	CGI, Inc.		2.700	0,34	1,500 % fällig am 15.06.2026	500	443	0,06
UBS AG				1,450 % fällig am 14.09.2026	2.700	1.848	0,23	2,750 % fällig am 27.09.2026	1.900	1.729	0,22
5,125 % fällig am 15.05.2024 (e)	300	295	0,04	Chanel Ceres PLC		1.900	0,23	5,800 % fällig am 26.06.2025	500	499	0,06
UBS Group AG				0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 1.900			Illumina, Inc.			
1,494 % fällig am 10.08.2027	2.300	1.977	0,25					5,800 % fällig am 12.12.2025	1.500	1.504	0,19
4,488 % fällig am 12.05.2026	3.500	3.385	0,42								
6,373 % fällig am 15.07.2026	3.000	2.982	0,37								
6,442 % fällig am 11.08.2028	2.235	2.245	0,28								

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
IMCD NV 2,125 % fällig am 31.03.2027	€ 2.700	\$ 2.665	0,33	Sage Group PLC 3,820 % fällig am 15.02.2028	€ 1.000	\$ 1.078	0,13	Var Energi ASA 7,500 % fällig am 15.01.2028	\$ 1.700	\$ 1.750	0,22
Imperial Brands Finance PLC 3,500 % fällig am 26.07.2026	\$ 500	466	0,06	Sands China Ltd. 2,800 % fällig am 08.03.2027	\$ 3.200	2.780	0,35	VMware, Inc. 0,600 % fällig am 15.08.2023	2.000	1.988	0,25
6,125 % fällig am 27.07.2027	1.595	1.599	0,20	5,625 % fällig am 08.08.2025	900	879	0,11	4,500 % fällig am 15.05.2025	1.600	1.568	0,20
Infor, Inc. 1,450 % fällig am 15.07.2023	300	299	0,04	Sealed Air Corp. 1,573 % fällig am 15.10.2026	1.400	1.219	0,15	Volkswagen Group of America Finance LLC 4,350 % fällig am 08.06.2027	800	771	0,10
InterContinental Hotels Group PLC 1,625 % fällig am 08.10.2024	€ 800	844	0,11	SEB S.A. 1,375 % fällig am 16.06.2025	€ 500	516	0,06	6,040 % fällig am 07.06.2024	3.000	3.007	0,38
3,375 % fällig am 08.10.2028	£ 800	864	0,11	1,500 % fällig am 31.05.2024	200	213	0,03	Warnermedia Holdings, Inc. 3,755 % fällig am 15.03.2027	1.200	1.120	0,14
John Lewis PLC 6,125 % fällig am 21.01.2025	200	245	0,03	Sherwin-Williams Co. 4,250 % fällig am 08.08.2025	\$ 1.600	1.567	0,20	Weir Group PLC 2,200 % fällig am 13.05.2026	4.700	4.212	0,53
Kenvue, Inc. 5,500 % fällig am 22.03.2025	\$ 2.600	2.608	0,33	Siemens Energy Finance BV 4,250 % fällig am 05.04.2029	€ 400	425	0,05	6,875 % fällig am 14.06.2028	£ 400	502	0,06
Komatsu Finance America, Inc. 0,849 % fällig am 09.09.2023	2.350	2.328	0,29	Sika Capital BV 3,750 % fällig am 03.11.2026	3.800	4.121	0,52	Werfen S.A. 4,625 % fällig am 06.06.2028	€ 900	970	0,12
Lenovo Group Ltd. 5,875 % fällig am 24.04.2025	600	597	0,07	Silfin NV 2,875 % fällig am 11.04.2027	800	785	0,10	West Fraser Timber Co. Ltd. 4,350 % fällig am 15.10.2024	\$ 200	195	0,02
Marriott International, Inc. 5,750 % fällig am 01.05.2025	74	74	0,01	Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	2.100	2.211	0,28	Westinghouse Air Brake Technologies Corp. 3,200 % fällig am 15.06.2025	562	534	0,07
Marvell Technology, Inc. 2,450 % fällig am 15.04.2028	1.800	1.573	0,20	SK Hynix, Inc. 1,000 % fällig am 19.01.2024	\$ 1.300	1.264	0,16	Williams Cos., Inc. 5,400 % fällig am 02.03.2026	1.000	998	0,12
Mercedes-Benz Finance North America LLC 4,950 % fällig am 30.03.2025	800	794	0,10	Sky Ltd. 1,875 % fällig am 24.11.2023	€ 2.100	2.273	0,28	Woodside Finance Ltd. 3,650 % fällig am 05.03.2025	600	578	0,07
Meta Platforms, Inc. 3,500 % fällig am 15.08.2027	1.650	1.568	0,20	Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % fällig am 09.10.2025	200	208	0,03	Worley Financial Services Pty. Ltd. 5,950 % fällig am 13.10.2028	AUD 2.600	1.674	0,21
Mondelez International, Inc. 2,125 % fällig am 17.03.2024	2.300	2.244	0,28	Spirit AeroSystems, Inc. 7,500 % fällig am 15.04.2025	\$ 3.100	3.067	0,38	Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024	\$ 2.100	2.050	0,26
Mundys SpA 1,625 % fällig am 03.02.2025	€ 1.300	1.356	0,17	Stryker Corp. 0,250 % fällig am 03.12.2024	€ 1.000	1.035	0,13	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 3,550 % fällig am 01.04.2025	1.600	1.542	0,19
National Fuel Gas Co. 5,500 % fällig am 01.10.2026	\$ 1.000	976	0,12	1,125 % fällig am 30.11.2023	2.500	2.696	0,34	Zoetis, Inc. 5,400 % fällig am 14.11.2025	1.700	1.706	0,21
Newell Brands, Inc. 4,700 % fällig am 01.04.2026	650	611	0,08	Studio City Co. Ltd. 7,000 % fällig am 15.02.2027	\$ 2.800	2.626	0,33			230.427	28,87
Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	€ 2.000	2.173	0,27	Studio City Finance Ltd. 6,000 % fällig am 15.07.2025	600	558	0,07	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
3,043 % fällig am 15.09.2023	\$ 2.400	2.383	0,30	Suntory Holdings Ltd. 2,250 % fällig am 16.10.2024	1.100	1.045	0,13	AES Corp. 5,450 % fällig am 01.06.2028	600	590	0,07
NXP BV 5,000 % fällig am 15.01.2033	400	384	0,05	Swedish Match AB 0,875 % fällig am 23.09.2024	€ 500	522	0,07	Ameren Illinois Co. 3,800 % fällig am 15.05.2028	1.000	953	0,12
Occidental Petroleum Corp. 6,375 % fällig am 01.09.2028	1.600	1.628	0,20	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	800	838	0,10	Appalachian Power Co. 3,300 % fällig am 01.06.2027	600	561	0,07
Open Text Corp. 6,900 % fällig am 01.12.2027	3.200	3.261	0,41	4,892 % fällig am 24.04.2025	\$ 400	392	0,05	Avangrid, Inc. 3,150 % fällig am 01.12.2024	500	480	0,06
Oracle Corp. 1,650 % fällig am 25.03.2026 (f)	1.900	1.725	0,22	T-Mobile USA, Inc. 2,250 % fällig am 15.02.2026	1.100	1.012	0,13	Black Hills Corp. 5,950 % fällig am 15.03.2028	3.000	3.037	0,38
Ovintiv, Inc. 5,650 % fällig am 15.05.2025	1.500	1.489	0,19	3,500 % fällig am 15.04.2025	450	433	0,05	Constellation Energy Generation LLC 5,600 % fällig am 01.03.2028	700	706	0,09
Pandora A/S 4,500 % fällig am 10.04.2028	€ 300	327	0,04	4,800 % fällig am 15.07.2028	1.800	1.764	0,22	DTE Electric Co. 1,900 % fällig am 01.04.2028	1.000	876	0,11
Penske Truck Leasing Co. LP 4,125 % fällig am 01.08.2023	\$ 700	699	0,09	4,950 % fällig am 15.03.2028	500	492	0,06	Duke Energy Corp. 4,300 % fällig am 15.03.2028	1.000	961	0,12
PepsiCo, Inc. 4,450 % fällig am 15.05.2028	1.600	1.600	0,20	Take-Two Interactive Software, Inc. 3,300 % fällig am 28.03.2024	35	34	0,00	5,000 % fällig am 08.12.2025	3.800	3.775	0,47
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,450 % fällig am 19.05.2028	900	885	0,11	Targa Resources Corp. 5,200 % fällig am 01.07.2027	2.500	2.456	0,31	East Ohio Gas Co. 1,300 % fällig am 15.06.2025	1.800	1.651	0,21
Philip Morris International, Inc. 5,125 % fällig am 15.11.2024	2.500	2.490	0,31	TD SYNNEX Corp. 1,250 % fällig am 09.08.2024	2.000	1.892	0,24	EnBW International Finance BV 3,625 % fällig am 22.11.2026	€ 2.000	2.170	0,27
Pioneer Natural Resources Co. 5,100 % fällig am 29.03.2026	1.000	994	0,12	1,750 % fällig am 09.08.2026	900	785	0,10	Enel Finance America LLC 7,100 % fällig am 14.10.2027	\$ 200	210	0,03
Qorvo, Inc. 1,750 % fällig am 15.12.2024	2.550	2.374	0,30	Tennessee Gas Pipeline Co. LLC 7,000 % fällig am 15.10.2028	1.396	1.475	0,18	Enel Finance International NV 0,000 % fällig am 17.06.2024 (c)	€ 800	840	0,11
Regal Rexnord Corp. 6,050 % fällig am 15.02.2026	500	501	0,06	TenneT Holding BV 3,875 % fällig am 28.10.2028	€ 600	663	0,08	1,375 % fällig am 12.07.2026	\$ 1.000	883	0,11
Renesas Electronics Corp. 1,543 % fällig am 26.11.2024	4.100	3.834	0,48	Tesco Corporate Treasury Services PLC 1,375 % fällig am 24.10.2023	250	271	0,03	2,650 % fällig am 10.09.2024	4.200	4.043	0,51
Ritchie Bros Holdings, Inc. 6,750 % fällig am 15.03.2028	800	807	0,10	Texas Instruments, Inc. 4,600 % fällig am 15.02.2028	\$ 1.000	1.002	0,13	4,250 % fällig am 15.06.2025	1.700	1.651	0,21
Robert Bosch GmbH 3,625 % fällig am 02.06.2027	€ 400	434	0,05	Thermo Fisher Scientific Finance BV 3,582 % fällig am 18.11.2023	€ 3.700	4.036	0,51	EP Infrastructure A/S 1,659 % fällig am 26.04.2024	€ 600	624	0,08
Royalty Pharma PLC 0,750 % fällig am 02.09.2023	\$ 1.100	1.090	0,14	TransDigm, Inc. 6,750 % fällig am 15.08.2028	\$ 1.300	1.307	0,16	Evergy Missouri West, Inc. 5,150 % fällig am 15.12.2027	\$ 2.000	1.975	0,25
Sabine Pass Liquefaction LLC 5,000 % fällig am 15.03.2027	568	559	0,07	Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 4,125 % fällig am 02.02.2026	1.900	1.829	0,23	Eversource Energy 5,339 % fällig am 15.08.2023	700	700	0,09
5,750 % fällig am 15.05.2024	2.500	2.496	0,31	Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	€ 700	587	0,07	5,450 % fällig am 01.03.2028	1.200	1.209	0,15
				Union Pacific Corp. 4,750 % fällig am 21.02.2026	\$ 1.800	1.789	0,22	Florida Power & Light Co. 5,050 % fällig am 01.04.2028	700	706	0,09
				United Airlines Pass-Through Trust 4,300 % fällig am 15.02.2027	520	501	0,06	Georgia Power Co. 2,100 % fällig am 30.07.2023	200	199	0,02
				United Airlines, Inc. 4,375 % fällig am 15.04.2026	1.400	1.331	0,17	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	250	244	0,03



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Ipalco Enterprises, Inc. 3,700 % fällig am 01.09.2024	\$ 1.348	\$ 1.304	0,16	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2053	\$ 8.900	\$ 8.120	1,02	Becton Dickinson and Co. 5,390 % fällig am 10.07.2023	\$ 700	\$ 699	0,09
ITC Holdings Corp. 4,950 % fällig am 22.09.2027	850	837	0,11	4,000 % fällig am 01.08.2053	27.100	25.456	3,19	Constellation Brands, Inc. 5,580 % fällig am 17.07.2023	250	249	0,03
Jersey Central Power & Light Co. 4,700 % fällig am 01.04.2024	1.083	1.072	0,13	4,500 % fällig am 01.07.2053	5.200	5.000	0,63	5,580 % fällig am 11.07.2023	850	848	0,11
KeySpan Gas East Corp. 2,742 % fällig am 15.08.2026	1.600	1.454	0,18	5,000 % fällig am 01.09.2053	4.300	4.216	0,53	5,610 % fällig am 11.07.2023	300	299	0,04
Lorca Telecom Bondco S.A. 4,000 % fällig am 18.09.2027	€ 600	599	0,08			45.132	5,66	Crown Castle, Inc. 5,870 % fällig am 20.07.2023	600	598	0,08
Midwest Connector Capital Co. LLC 3,900 % fällig am 01.04.2024	\$ 200	196	0,02	<b>US-SCHATZOBLIGATIONEN</b>				Dominion Resources, Inc. 5,400 % fällig am 19.07.2023	300	299	0,04
Mississippi Power Co. 3,950 % fällig am 30.03.2028	2.495	2.349	0,29	<b>U.S. Treasury Notes</b>				5,410 % fällig am 11.07.2023	250	250	0,03
5,392 % fällig am 28.06.2024	3.090	3.069	0,38	1,500 % fällig am 30.11.2024	800	760	0,09	Electricite de France S.A. 5,570 % fällig am 14.07.2023	3.700	3.692	0,46
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. 5,362 % fällig am 18.10.2024	975	968	0,12	3,500 % fällig am 15.09.2025	6.700	6.520	0,82	Enbridge, Inc. 5,400 % fällig am 12.07.2023	2.300	2.296	0,29
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD 2.500	1.503	0,19	3,875 % fällig am 31.03.2025	16.500	16.177	2,03	5,480 % fällig am 17.07.2023	1.000	997	0,13
5,481 % fällig am 03.11.2023	\$ 2.900	2.900	0,36	4,000 % fällig am 15.12.2025	6.100	6.006	0,75	J.M. Smucker Co. 5,410 % fällig am 17.07.2023	5.300	5.287	0,66
6,112 % fällig am 21.03.2024	500	500	0,06	4,125 % fällig am 31.01.2025	41.600	40.953	5,13	L3Harris Technologies, Inc. 5,530 % fällig am 17.07.2023	2.900	2.893	0,36
ONEOK, Inc. 4,550 % fällig am 15.07.2028	1.600	1.518	0,19	4,250 % fällig am 15.10.2025	20.900	20.670	2,59	Leidos, Inc. 5,900 % fällig am 10.07.2023	400	399	0,05
Pacific Gas & Electric Co. 3,300 % fällig am 15.03.2027	300	272	0,03	4,375 % fällig am 31.10.2024	23.100	22.825	2,86	Parker Hannifin Corp. 5,400 % fällig am 18.07.2023	900	898	0,11
3,400 % fällig am 15.08.2024	100	97	0,01	4,500 % fällig am 15.11.2025	5.100	5.074	0,64	5,400 % fällig am 19.07.2023	900	898	0,11
3,450 % fällig am 01.07.2025	100	94	0,01			118.985	14,91	5,400 % fällig am 20.07.2023	900	897	0,11
3,500 % fällig am 15.06.2025	1.700	1.610	0,20	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				5,400 % fällig am 21.07.2023	700	698	0,09
3,750 % fällig am 15.02.2024	200	197	0,02	<b>GSR Mortgage Loan Trust</b>				Penske Truck Leasing Co. LP 5,350 % fällig am 11.07.2023	1.500	1.498	0,19
3,850 % fällig am 15.11.2023	200	198	0,02	4,070 % fällig am 25.09.2035	2	2	0,00	Thomson Reuters Corp. 5,470 % fällig am 18.07.2023	1.200	1.197	0,15
4,250 % fällig am 01.08.2023	2.400	2.398	0,30	<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>					32.672	4,10	
4,950 % fällig am 08.06.2025	2.000	1.940	0,24	5,190 % fällig am 25.11.2034	:	2	0,00	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
Pennsylvania Electric Co. 4,150 % fällig am 15.04.2025	1.950	1.877	0,24	6,297 % fällig am 25.01.2034	278	276	0,03	HF Sinclair Corp. 2,625 % fällig am 01.10.2023	1.300	1.289	0,16
Potomac Electric Power Co. 3,600 % fällig am 15.03.2024	1.262	1.244	0,16	<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>				Summe kurzfristige Instrumente		33.961	4,26
San Diego Gas & Electric Co. 2,500 % fällig am 15.05.2026	226	211	0,03	4,470 % fällig am 25.01.2033	4	3	0,00	Summe übertragbare Wertpapiere		\$ 821.335	102,90
Sempra Energy 3,300 % fällig am 01.04.2025	3.100	2.975	0,37	5,225 % fällig am 25.01.2047	165	149	0,02	<b>AKTIEN</b>			
Southern California Edison Co. 0,975 % fällig am 01.08.2024	800	760	0,10			432	0,05	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
4,200 % fällig am 01.06.2025	3.200	3.122	0,39	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
5,300 % fällig am 01.03.2028	1.500	1.501	0,19	<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	627.529	6.249	0,78
5,850 % fällig am 15.11.2023	100	102	0,01	5,770 % fällig am 25.12.2035	307	294	0,04	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (d)	5.163	67	0,01
5,922 % fällig am 01.04.2024	557	556	0,07	<b>OCP Euro CLO DAC</b>				Summe Investmentfonds		\$ 6.316	0,79
Southern Power Co. 0,900 % fällig am 15.01.2026	3.000	2.690	0,34	4,713 % fällig am 20.01.2033	€ 1.000	1.089	0,13				
Sprint LLC 7,125 % fällig am 15.06.2024	125	126	0,02			1.383	0,17				
7,875 % fällig am 15.09.2023	1.100	1.104	0,14	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
State Grid Overseas Investment BVI Ltd. 0,797 % fällig am 05.08.2026	€ 500	495	0,06	<b>Canada Government International Bond</b>							
System Energy Resources, Inc. 2,140 % fällig am 09.12.2025	\$ 1.150	1.044	0,13	1,500 % fällig am 01.09.2024	CAD 2.800	2.036	0,26				
Tampa Electric Co. 3,875 % fällig am 12.07.2024	800	786	0,10	Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % fällig am 05.05.2026	\$ 2.000	1.975	0,25				
Trans-Allegheny Interstate Line Co. 3,850 % fällig am 01.06.2025	1.305	1.255	0,16	France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2025 (c)	€ 9.000	9.279	1,16				
Verizon Communications, Inc. 5,882 % fällig am 20.03.2026	800	801	0,10	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % fällig am 01.04.2026 (c)	2.700	2.659	0,33				
Vistra Operations Co. LLC 3,550 % fällig am 15.07.2024	3.325	3.212	0,40	Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 13.03.2025	6.700	7.220	0,90				
WEC Energy Group, Inc. 4,750 % fällig am 09.01.2026	1.500	1.478	0,19	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 139.500	7.669	0,96				
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		79.458	9,95	United Kingdom Gilt 1,625 % fällig am 22.10.2028	£ 7.200	7.861	0,99				
		581.214	72,81			38.699	4,85				
<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>AKTIEN</b>							
State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020 1,258 % fällig am 01.07.2025	1.200	1.109	0,14	<b>STAMMAKTEN</b>							
				<b>FINANZWERTE</b>							
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				Stearns Holdings LLC 'B' (b)	43.861	0	0,00				
Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2053	2.700	2.340	0,29	<b>OPTIONSSCHEINE</b>							
				Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31.12.2060	211	0	0,00				
				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
				<b>COMMERCIAL PAPER</b>							
				American Electric Power Co., Inc. 5,480 % fällig am 01.08.2023	\$ 2.000	1.990	0,25				
				5,480 % fällig am 14.08.2023	1.300	1.291	0,16				
				AT+T, Inc. 5,700 % fällig am 19.03.2024	4.700	4.499	0,56				



**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	
								% des Nettovermögens	
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 563	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (574)	\$ 563	\$ 563	0,07
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (574)	\$ 563	\$ 563	0,07

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	16	\$ 37	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	109	(187)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	270	(537)	(0,07)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	106	138	0,02
				\$ (549)	(0,07)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (549)	(0,07)

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2024	\$ 1.300	\$ (12)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	200	(2)	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2023	€ 500	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	\$ 800	7	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2024	1.500	47	0,01
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	1.300	12	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	1.200	75	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	3.700	(8)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	400	0	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	80	(5)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2028	95	2	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.06.2028	€ 500	2	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20.12.2023	\$ 900	(61)	(0,01)
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2026	300	(4)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 2.200	4	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	500	3	0,00
Ryder System, Inc.	1,000	20.12.2023	\$ 1.100	(8)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	200	3	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	2.300	7	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	€ 1.200	(12)	0,00
				\$ 50	0,01

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 4.900	\$ 22	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	30.800	212	0,03
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000	20.06.2028	€ 500	17	0,00
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	13.600	36	0,00
				\$ 287	0,03

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,399 %	18.06.2028	¥ 77.700	\$ 10	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	\$ 9.400	(426)	(0,05)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,000	14.11.2023	CAD 14.700	(156)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,050	16.11.2023	7.800	(85)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,070	22.11.2023	11.900	(129)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,250	15.06.2024	24.700	(183)	(0,02)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Fort.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,300 %	28.04.2027	ZAR 68.300	\$ 147	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 1.700	(76)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	4.400	(459)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	3.200	(300)	(0,04)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	35.100	(67)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	15.800	7	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	HUF 1.604.100	(23)	0,00
					<b>\$ (1.740)</b>	<b>(0,22)</b>
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (1.403)</b>	<b>(0,18)</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 100	\$ (3)	\$ 3	\$ 0	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	700	(16)	11	(5)	0,00
					<b>\$ (19)</b>	<b>\$ 14</b>	<b>\$ (5)</b>	<b>0,00</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	\$ 85	AUD 128	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2023	AUD 128	\$ 85	0	0	0	0,00
BOA	07.2023	£ 370	465	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	\$ 4.409	¥ 636.145	2	0	2	0,00
BPS	09.2023	606	IDR 9.070.817	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	AUD 198	\$ 129	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	€ 152.870	164.336	0	(2.446)	(2.446)	(0,31)
	07.2023	\$ 60	AUD 91	0	0	0	0,00
	07.2023	172.041	€ 157.037	0	(715)	(715)	(0,09)
	07.2023	3.583	¥ 498.029	0	(137)	(137)	(0,02)
	07.2023	651	MXN 11.631	27	0	27	0,00
	08.2023	AUD 91	\$ 61	0	0	0	0,00
	08.2023	€ 150.325	164.942	714	0	714	0,09
	09.2023	\$ 102	IDR 1.536.140	0	0	0	0,00
	10.2023	ZAR 69.220	\$ 3.729	104	0	104	0,01
	12.2023	\$ 226	MXN 4.038	2	0	2	0,00
BRC	08.2023	838	COP 3.571.258	6	0	6	0,00
	09.2023	IDR 10.084	\$ 1	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 280	IDR 4.197.133	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CAD 6.311	\$ 4.631	0	(138)	(138)	(0,02)
	07.2023	€ 1.580	1.695	0	(28)	(28)	0,00
	07.2023	\$ 651	MXN 11.631	27	0	27	0,00
	08.2023	529	NOK 5.518	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	£ 6.316	\$ 7.875	0	(155)	(155)	(0,02)
GLM	07.2023	\$ 803	BRL 4.348	100	0	100	0,01
	07.2023	BRL 4.362	\$ 903	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 22	CHF 19	0	0	0	0,00
	08.2023	661	NOK 7.015	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	ZAR 71.904	\$ 3.874	83	0	83	0,01
	09.2023	\$ 903	BRL 4.410	1	0	1	0,00
JPM	09.2023	2.516	MXN 43.978	11	0	11	0,00
	07.2023	¥ 169.602	\$ 1.186	13	0	13	0,00
	08.2023	\$ 33	CHF 29	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
	08.2023	\$	5.344	¥	742.124	\$	0	\$	(179)	\$	(179)	(0,02)	
	08.2023		244	NOK	2.587		0		(2)		(2)	0,00	
	08.2023		401	ZAR	7.335		0		(14)		(14)	0,00	
	09.2023		253	IDR	3.803.628		0		0		0	0,00	
	09.2023		1.288	INR	106.133		2		0		2	0,00	
MBC	07.2023	€	926	\$	992		0		(19)		(19)	0,00	
	07.2023	£	17.353		21.481		0		(582)		(582)	(0,07)	
MYI	07.2023		19		24		0		0		0	0,00	
	07.2023	IDR	2.391.180		160		0		0		0	0,00	
	07.2023	\$	1.631	€	1.502		8		0		8	0,00	
	07.2023		2.532	£	2.037		57		0		57	0,01	
	07.2023		159	IDR	2.391.180		0		0		0	0,00	
	09.2023		391		5.840.410		0		(3)		(3)	0,00	
	09.2023		278	INR	22.924		1		0		1	0,00	
RBC	07.2023	MXN	3.315	\$	172		0		(21)		(21)	0,00	
SCX	07.2023	\$	125	AUD	188		0		0		0	0,00	
	08.2023	AUD	188	\$	125		0		0		0	0,00	
	09.2023	\$	720	IDR	10.713.840		0		(8)		(8)	0,00	
	09.2023		806	INR	66.378		1		0		1	0,00	
TOR	07.2023	AUD	422	\$	276		0		(5)		(5)	0,00	
	07.2023	\$	152	AUD	231		1		0		1	0,00	
	07.2023		4.770	CAD	6.311		3		(3)		(3)	0,00	
	07.2023		28.012	£	22.045		14		0		14	0,00	
	08.2023	AUD	231	\$	153		0		(1)		(1)	0,00	
	08.2023	CAD	6.309		4.770		3		(3)		(3)	0,00	
	08.2023	£	22.045		28.018		0		(14)		(14)	0,00	
	08.2023	HUF	148.436		424		0		(5)		(5)	0,00	
UAG	07.2023	AUD	143		94		0		(2)		(2)	0,00	
	07.2023	\$	74	AUD	111		0		0		0	0,00	
	08.2023	AUD	111	\$	74		0		0		0	0,00	
							\$	1.180	\$	(4.511)	\$	(3.331)	(0,42)

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
BOA	07.2023	€	1.943	\$	2.124	\$	4	\$	0	\$	4	0,00	
	07.2023	\$	164.009	€	152.608		2.486		0		2.486	0,31	
BPS	07.2023	€	154.056	\$	168.798		722		0		722	0,09	
	07.2023	\$	164.765	€	153.248		2.437		(8)		2.429	0,31	
	08.2023		168.473		153.543		0		(729)		(729)	(0,09)	
CBK	07.2023	€	155.370	\$	168.886		0		(622)		(622)	(0,08)	
	07.2023	\$	3.667	€	3.352		0		(10)		(10)	0,00	
	08.2023		166.366		152.807		575		0		575	0,07	
JPM	07.2023	€	152.807	\$	166.850		137		0		137	0,02	
	07.2023	\$	164.409	€	153.772		3.357		0		3.357	0,42	
	08.2023		167.083		152.807		0		(143)		(143)	(0,02)	
MBC	07.2023	€	812	\$	888		4		(2)		2	0,00	
	07.2023	\$	118	€	109		1		0		1	0,00	
SCX	07.2023		2.956		2.762		58		0		58	0,01	
							\$	9.781	\$	(1.514)	\$	8.267	1,04

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
BOA	07.2023	£	23	\$	29	\$	0	\$	0	\$	0	0,00	
	07.2023	\$	67	£	53		1		0		1	0,00	
BPS	07.2023		9.723		7.861		271		0		271	0,03	
BRC	07.2023	£	13	\$	16		0		0		0	0,00	
	07.2023	\$	40	£	32		0		0		0	0,00	
CBK	07.2023	£	89	\$	113		0		0		0	0,00	
	07.2023	\$	27	£	22		0		0		0	0,00	
JPM	07.2023	£	7.803	\$	9.867		0		(54)		(54)	(0,01)	
	08.2023	\$	9.869	£	7.803		54		0		54	0,01	
MBC	07.2023	£	3	\$	4		0		0		0	0,00	
	07.2023	\$	9.716	£	7.849		262		0		262	0,03	
MYI	07.2023		9.695		7.800		222		0		222	0,03	
RYL	07.2023		19		15		0		0		0	0,00	
TOR	07.2023	£	7.825	\$	9.943		0		(5)		(5)	0,00	
	08.2023	\$	9.945	£	7.825		5		0		5	0,00	
							\$	815	\$	(59)	\$	756	0,09

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Fort.)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 10.024	NOK 111.442	\$ 378	\$ 0	\$ 378	0,05
CBK	07.2023	NOK 511	\$ 46	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 4.982	NOK 56.024	247	0	247	0,03
GLM	07.2023	NOK 46.057	\$ 4.273	0	(26)	(26)	0,00
	07.2023	\$ 26	NOK 283	0	0	0	0,00
	08.2023	4.273	46.012	26	0	26	0,00
				\$ 651	\$ (28)	\$ 623	0,08
<b>Summe Freiverkehrsfinauzderivate</b>						\$ 6.310	0,79
<b>Summe Anlagen</b>						\$ 832.572	104,30
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						\$ (34.355)	(4,30)
<b>Nettovermögen</b>						\$ 798.217	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 1,31 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BMW Canada, Inc.	4,760 %	10.02.2025	07.02.2023	\$ 2.601	\$ 2.616	0,33
Citigroup, Inc.	2,014	25.01.2026	18.01.2022	2.000	1.880	0,24
Citigroup, Inc.	3,290	17.03.2026	10.03.2022	3.200	3.062	0,38
Deutsche Bank AG	1,447	01.04.2025	30.03.2021	1.600	1.521	0,19
Deutsche Bank AG	2,129	24.11.2026	17.11.2020	500	445	0,06
Oracle Corp.	1,650	25.03.2026	22.03.2021	1.899	1.725	0,22
				\$ 11.800	\$ 11.249	1,42

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 12.682 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 1.396 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 9.374 USD (31. Dezember 2022: 9.433 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 310 USD (31. Dezember 2022: 426 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 821.219	\$ 116	\$ 821.335
Investmentfonds	6.316	0	0	6.316
Pensionsgeschäfte	0	563	0	563
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(187)	4.545	0	4.358
<b>Summen</b>	<b>\$ 6.129</b>	<b>\$ 826.327</b>	<b>\$ 116</b>	<b>\$ 832.572</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 691.422	\$ 0	\$ 691.422
Investmentfonds	643	0	0	643
Pensionsgeschäfte	0	1.604	0	1.604
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(614)	2.737	0	2.123
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(14.029)	0	(14.029)
<b>Summen</b>	<b>\$ 29</b>	<b>\$ 681.734</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 681.763</b>

- (1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.  
 (2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.  
 (3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 2.863	\$ (2.200)	\$ 663	\$ (35)	\$ 0	\$ (35)
BPS	239	(310)	(71)	(202)	140	(62)
BRC	5	0	5	146	(120)	26
CBK	36	0	36	4.468	(4.360)	108
DUB	(55)	0	(55)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	89	0	89	(12)	16	4
JPM	3.166	(2.550)	616	84	0	84
MBC	(336)	310	(26)	170	(290)	(120)
MYI	285	(320)	(35)	(74)	0	(74)
RBC	(21)	0	(21)	13	0	13
SCX	51	0	51	4.065	(3.850)	215
TOR	(10)	0	(10)	6	(20)	(14)
UAG	(2)	0	(2)	(199)	270	71

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	71,89	73,17
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	31,01	32,43
Investmentfonds	0,79	0,10
Pensionsgeschäfte	0,07	0,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,07)	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,18)	(1,02)
Freiverkehrsfinaanzderivate	0,79	1,30
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(2,14)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(1,95)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,22)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,05	0,55
Unternehmensanleihen und Wechsel	72,81	83,16
Kommunalanleihen und Wechsel	0,14	0,17
US-Regierungsbehörden	5,66	6,33
US-Schatzobligationen	14,91	10,55
Non-Agency-MBS	0,05	0,07
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,17	0,22
Staatsemissionen	4,85	3,40
Stammaktien	0,00	0,00
Optionsscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	4,26	1,15
Investmentfonds	0,79	0,10
Pensionsgeschäfte	0,07	0,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,07)	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,01	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes - Schutzverkauf	0,03	0,01
Zinsswaps	(0,22)	(1,00)
Freiverkehrsfinaanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,00	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,42)	(0,48)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,21	1,77
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(2,14)
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,30)	(4,13)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Income Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
American Airlines, Inc. 10,000 % fällig am 20.04.2028	\$ 900	\$ 920	0,06	EPR Properties 4,750 % fällig am 15.12.2026	\$ 8	\$ 7	0,00	NPC Ukrenargo 6,875 % fällig am 09.11.2028 ^	\$ 200	\$ 43	0,00
Carnival Corp. 7,168 % fällig am 30.06.2025	€ 3.386	3.685	0,25	4,950 % fällig am 15.04.2028	34	30	0,00	Petroleos de Venezuela S.A. 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	220	9	0,00
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. 8,584 % - 8,807 % fällig am 21.08.2026	\$ 0	0	0,00	GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2030	100	87	0,01	Petroleos Mexicanos 5,950 % fällig am 28.01.2031	4.300	3.145	0,22
Emerald TopCo, Inc. 8,584 % fällig am 24.07.2026	72	71	0,01	5,300 % fällig am 15.01.2029	3.888	3.706	0,26	6,700 % fällig am 16.02.2032	1.831	1.394	0,10
Envision Healthcare Corp. 16,070 % fällig am 29.04.2027	677	807	0,06	5,750 % fällig am 01.06.2028	500	490	0,03	Prime Healthcare Services, Inc. 7,250 % fällig am 01.11.2025	6.355	6.030	0,41
16,695 % fällig am 28.04.2028 ^	1.648	1.214	0,08	HSBC Holdings PLC 2,848 % fällig am 04.06.2031	5.900	4.899	0,34	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,750 % fällig am 01.12.2026	4.100	3.444	0,24
iHeartCommunications, Inc. 8,217 % fällig am 01.05.2026	6.168	5.358	0,37	Nationwide Building Society 4,302 % fällig am 08.03.2029	2.100	1.948	0,13	Rolls-Royce PLC 5,750 % fällig am 15.10.2027	£ 1.100	1.300	0,09
8,469 % fällig am 01.05.2026	1.584	1.379	0,10	Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % fällig am 24.06.2024 (n/j)	£ 4.169	4.972	0,34	Royal Caribbean Cruises Ltd. 11,500 % fällig am 01.06.2025	\$ 876	930	0,06
Intelsat Jackson Holdings S.A. 9,443 % fällig am 01.02.2029	814	812	0,06	SLM Student Loan Trust 4,076 % fällig am 15.12.2033	€ 3.162	3.184	0,22	Sands China Ltd. 4,300 % fällig am 08.01.2026	1.400	1.317	0,09
Lealand Finance Co. BV 8,193 % fällig am 28.06.2024	8	7	0,00	Societe Generale S.A. 6,447 % fällig am 12.01.2027	\$ 3.200	3.194	0,22	Surgery Center Holdings, Inc. 10,000 % fällig am 15.04.2027	1.825	1.868	0,13
Lealand Finance Co. BV (2,666 % bar oder 3,000 % PIK) 3,000 % - 6,193 % fällig am 30.06.2025 (c)	24	14	0,00	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (j)	3.490	3.437	0,24	T-Mobile USA, Inc. 4,800 % fällig am 15.07.2028	7.000	6.859	0,47
Poseidon BidCo S.A.S 8,848 % fällig am 14.07.2028	€ 4.000	4.277	0,29	UBS Group AG 4,194 % fällig am 01.04.2031	5.000	4.453	0,31	Topaz Solar Farms LLC 4,875 % fällig am 30.09.2039	37	34	0,00
PUG LLC 8,525 % fällig am 12.02.2027	\$ 29	26	0,00	6,373 % fällig am 15.07.2026	2.400	2.385	0,16	5,750 % fällig am 30.09.2039	199	195	0,01
Syniverse Holdings, Inc. 12,242 % fällig am 13.05.2027	58	53	0,00	6,442 % fällig am 11.08.2028	3.150	3.164	0,22	U.S. Renal Care, Inc. 10,625 % fällig am 15.07.2027	40	10	0,00
TransDigm, Inc. TBD % fällig am 30.05.2025	0	0	0,00	7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 1.400	1.694	0,12	United Airlines Pass-Through Trust 3,100 % fällig am 07.01.2030	1.987	1.800	0,12
TBD % fällig am 09.12.2025	0	0	0,00	UniCredit SpA 7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 12.260	12.334	0,85	4,150 % fällig am 25.02.2033	525	482	0,03
8,492 % fällig am 24.08.2028	12.047	12.054	0,83	Unique Pub Finance Co. PLC 7,395 % fällig am 28.03.2024	£ 25	32	0,00	5,875 % fällig am 15.04.2029	3.378	3.353	0,23
U.S. Renal Care, Inc. 10,192 % fällig am 26.06.2026	293	138	0,01	Uniti Group LP 6,500 % fällig am 15.02.2029	\$ 1.875	1.329	0,09	Valaris Ltd. 8,375 % fällig am 30.04.2030	942	946	0,07
Westmoreland Coal Co. (15,000 % PIK) TBD % fällig am 15.03.2029 (c)	13	9	0,00	10,500 % fällig am 15.02.2028	2.508	2.490	0,17	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 15.08.2029	300	262	0,02
Windstream Services LLC 11,452 % fällig am 21.09.2027	3	3	0,00	VICI Properties LP 4,500 % fällig am 01.09.2026	2.000	1.891	0,13	4,125 % fällig am 15.08.2031	300	258	0,02
Wm Morrison Supermarkets Ltd. 8,073 % fällig am 04.11.2027	€ 2.374	2.229	0,15	4,500 % fällig am 15.01.2028	4.325	3.978	0,27	Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	900	915	0,06
		33.056	2,27	4,625 % fällig am 01.12.2029	4.900	4.453	0,31	8,375 % fällig am 01.06.2031	900	909	0,06
				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Viking Cruises Ltd. 13,000 % fällig am 15.05.2025	3.600	3.783	0,26
				Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029	2.090	2.011	0,14	Windstream Escrow LLC 7,750 % fällig am 15.08.2028	2.373	1.972	0,14
				Altice France S.A. 8,125 % fällig am 01.02.2027	3.400	2.948	0,20			80.971	5,57
				American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % fällig am 01.11.2028	60	54	0,00	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
				British Airways Pass-Through Trust 4,250 % fällig am 15.05.2034	467	427	0,03	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 15.04.2025	€ 11.000	9.301	0,64
				Broadcom, Inc. 3,469 % fällig am 15.04.2034	2.453	2.013	0,14	Pacific Gas & Electric Co. 2,100 % fällig am 01.08.2027	\$ 3.785	3.236	0,22
				Carvana Co. 5,500 % fällig am 15.04.2027	120	80	0,01	2,950 % fällig am 01.03.2026 ^	1.772	1.624	0,11
				10,250 % fällig am 01.05.2030	3.700	2.919	0,20	3,300 % fällig am 15.03.2027 ^	773	702	0,05
				CDW LLC 2,670 % fällig am 01.12.2026	6.460	5.808	0,40	3,300 % fällig am 01.12.2027 ^	7.662	6.724	0,46
				Community Health Systems, Inc. 5,625 % fällig am 15.03.2027	4.054	3.576	0,25	3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	2.173	2.103	0,15
				8,000 % fällig am 15.03.2026	742	724	0,05	3,450 % fällig am 01.07.2025	1.869	1.765	0,12
				CoStar Group, Inc. 2,800 % fällig am 15.07.2030	1.300	1.074	0,07	3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	1.437	1.361	0,09
				DISH DBS Corp. 5,250 % fällig am 01.12.2026	2.550	2.050	0,14	3,750 % fällig am 15.02.2024 ^	1.490	1.466	0,10
				5,750 % fällig am 01.12.2028	2.520	1.879	0,13	3,750 % fällig am 01.07.2028	1.459	1.309	0,09
				Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030	3.297	3.010	0,21	3,750 % fällig am 15.08.2042 ^	12	8	0,00
				JetBlue Pass-Through Trust 4,000 % fällig am 15.05.2034	2.760	2.521	0,17	4,000 % fällig am 01.12.2046 ^	2	1	0,00
				Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 2.100	1.850	0,13	4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	61	44	0,00
				Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % fällig am 15.12.2030	£ 36	41	0,00	4,450 % fällig am 15.04.2042 ^	66	50	0,00
				Motorola Solutions, Inc. 2,300 % fällig am 15.11.2030	\$ 4.383	3.543	0,24	4,500 % fällig am 15.12.2041 ^	26	19	0,00
				Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	2.800	2.549	0,18	4,550 % fällig am 01.07.2030	4.717	4.273	0,30
				4,810 % fällig am 17.09.2030	300	263	0,02	4,950 % fällig am 08.06.2025	2.600	2.521	0,17
				NMG Holding Co., Inc. 7,125 % fällig am 01.04.2026	400	373	0,03	4,950 % fällig am 01.07.2050	1.381	1.087	0,08
								Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	904	909	0,06
								9,750 % fällig am 06.01.2027	517	534	0,04
								Sprint LLC 7,125 % fällig am 15.06.2024	2.868	2.896	0,20
										41.933	2,88
								Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		217.503	14,95
				<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>			
								DISH Network Corp. 2,375 % fällig am 15.03.2024	600	534	0,04







# Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Income Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>GSAMP Trust</b>				<b>STAASTEMISSIONEN</b>				<b>RECHTE</b>			
5,870 % fällig am 25.11.2035	\$ 2.100	\$ 1.699	0,12	Argentina Government International Bond				Intelsat Jackson Holdings			
Harvest SBA Loan Trust				0,500 % fällig am 09.07.2030	\$ 2.796	\$ 854	0,06	S.A. - Exp. 05.12.2025	9.740	58	0,00
7,388 % fällig am 25.08.2044	163	159	0,01	1,000 % fällig am 09.07.2029	120	39	0,00	<b>OPTIONSSCHEINE</b>			
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				1,500 % fällig am 09.07.2035	1.732	510	0,03	Intelsat Emergence S.A. -			
5,310 % fällig am 25.07.2037	377	202	0,01	3,500 % fällig am 09.07.2041	3.129	1.008	0,07	Exp. 17.02.2027	661	1	0,00
5,350 % fällig am 25.07.2037	5.053	2.712	0,19	15,500 % fällig am 17.10.2026	1.188	0	0,00	Windstream Holdings II, LLC - Exp.			
HSI Asset Securitization Corp. Trust				Australia Government International Bond				21.09.2055	361	\$ 6	0,00
5,290 % fällig am 25.12.2036	8.705	7.316	0,50	1,750 % fällig am 21.06.2051	2.500	969	0,07				
5,340 % fällig am 25.01.2037	2.866	1.982	0,14	Autonome Stadt Buenos Aires							
IXIS Real Estate Capital Trust				95,317 % fällig am							
5,610 % fällig am 25.01.2037	3.423	1.245	0,08	29.03.2024 (a)	ARS 610	1	0,00	<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>			
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				Peru Government International Bond				CBL & Associates Properties,			
5,410 % fällig am 25.06.2037	335	334	0,02	5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN 1.022	237	0,01	Inc.	174	4	0,00
Lehman XS Trust				5,400 % fällig am 12.08.2034	1	0	0,00	Uniti Group, Inc.	247	1	0,00
5,670 % fällig am 25.05.2046 ^	1.393	1.244	0,09	6,150 % fällig am 12.08.2032	88	23	0,00				
6,500 % fällig am 25.06.2046	50	42	0,00	6,950 % fällig am 12.08.2031	59	17	0,00				
7,450 % fällig am 25.12.2037	1.298	1.315	0,09	Provincia de Buenos Aires							
Long Beach Mortgage Loan Trust				88,734 % fällig am							
5,430 % fällig am 25.06.2036	481	441	0,03	12.04.2025 (a)	ARS 6.240	11	0,00	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
5,750 % fällig am 25.01.2036	3.069	2.799	0,19	Romania Government International Bond				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
Man GLG Euro CLO DAC				2,000 % fällig am 14.04.2033	€ 2.500	1.932	0,13	Federal Home Loan Bank			
3,917 % fällig am 15.10.2030	€ 2.908	3.109	0,21	3,750 % fällig am 07.02.2034	1.200	1.061	0,07	5,170 % fällig am			
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				Russia Government International Bond				29.11.2023	\$ 27.300	27.312	1,87
5,430 % fällig am 25.05.2037	\$ 4.400	2.332	0,16	4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	\$ 5.600	2.436	0,17	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
5,450 % fällig am 25.08.2037	283	265	0,02	4,750 % fällig am 27.05.2026 ^	200	101	0,01	(28,578) % fällig am			
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	200	89	0,01	18.10.2023 (e)(f)	ARS 75.997	150	0,01
3,580 % fällig am 25.01.2035	1.330	1.022	0,07	5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	400	24	0,00	(12,549) % fällig am			
5,350 % fällig am 25.05.2037	927	513	0,03	7,150 % fällig am 12.11.2025 ^	RUB 19.414	114	0,01	23.11.2023 (e)(f)	270.916	547	0,04
5,450 % fällig am 25.06.2036	1.856	1.568	0,11	7,950 % fällig am 07.10.2026 ^	13.158	77	0,01	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
6,065 % fällig am 25.03.2035	829	817	0,06	South Africa Government International Bond				(0,206) % fällig am			
New Century Home Equity Loan Trust				10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 193.200	10.622	0,73	18.07.2023 (e)(f)	¥ 193.000	1.335	0,09
5,870 % fällig am 25.10.2035	439	420	0,03	Turkey Government International Bond				(0,200) % fällig am			
NovaStar Mortgage Funding Trust				4,250 % fällig am 13.03.2025	\$ 1.200	1.122	0,08	24.07.2023 (e)(f)	330.000	2.283	0,16
6,725 % fällig am 25.12.2034	3.425	3.255	0,22	5,250 % fällig am 13.03.2030	1.000	823	0,06	(0,199) % fällig am			
Oak Hill European Credit Partners DAC				5,750 % fällig am 11.05.2047	741	508	0,03	11.09.2023 (e)(f)	1.523.000	10.540	0,72
3,930 % fällig am 20.01.2032	€ 2.596	2.768	0,19	Venezuela Government International Bond				(0,197) % fällig am			
OHA Loan Funding Ltd.				8,250 % fällig am 13.10.2024 ^	2.000	185	0,01	31.07.2023 (e)(f)	93.000	644	0,05
6,363 % fällig am 23.07.2031	\$ 3.000	2.974	0,20	9,000 % fällig am 07.05.2023 ^	1.600	144	0,01	(0,197) % fällig am			
Option One Mortgage Loan Trust								28.08.2023 (e)(f)	2.220.000	15.363	1,06
5,400 % fällig am 25.03.2037	4.999	2.470	0,17					(0,188) % fällig am			
5,915 % fällig am 25.08.2035	2.000	1.888	0,13					18.07.2023 (e)(f)	92.000	637	0,04
6,575 % fällig am 25.11.2034	835	833	0,06					(0,184) % fällig am			
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates								04.09.2023 (e)(f)	510.000	3.529	0,24
6,725 % fällig am 25.02.2035	8.704	8.417	0,58	<b>AKTIEN</b>				(0,179) % fällig am			
People's Choice Home Loan Securities Trust				<b>STAMMAKTIONEN</b>				11.09.2023 (e)(f)	340.000	2.353	0,16
7,175 % fällig am 25.10.2034	477	390	0,03	<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				(0,178) % fällig am			
Pretium Mortgage Credit Partners LLC				Clear Channel Outdoor				31.07.2023 (e)(f)	27.000	187	0,01
2,487 % fällig am 25.07.2051	1.985	1.842	0,13	Holdings, Inc. (d)	173.174	237	0,02	(0,169) % fällig am			
Renaissance Home Equity Loan Trust				iHeartMedia, Inc. 'A' (d)	41.444	151	0,01	19.09.2023 (e)(f)	750.000	5.190	0,36
5,580 % fällig am 25.11.2036	1.235	454	0,03	iHeartMedia, Inc. 'B' (d)	32.182	105	0,01	(0,150) % fällig am			
Residential Asset Mortgage Products Trust				Intelsat Emergence S.A. (d)(k)	45.479	1.046	0,07	25.09.2023 (e)(f)	691.000	4.782	0,33
6,230 % fällig am 25.03.2035	2.000	1.902	0,13								
Saxon Asset Securities Trust				<b>BASISKONSUMGÜTER</b>							
5,490 % fällig am 25.10.2046	4.845	4.685	0,32	Neiman Marcus Group Ltd.							
SoFi Professional Loan Program LLC				LLC (d)(k)	5.145	782	0,05	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
2,630 % fällig am 25.07.2040	197	195	0,01	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				Westmoreland Mining				PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
5,350 % fällig am 25.11.2037	366	203	0,01	Holdings LLC (d)(k)	231	1	0,00	US Dollar Short-Term			
Starwood Commercial Mortgage Trust				<b>IMMOBILIEN</b>				Floating NAV Fund (i)	14.658.227	145.966	10,03
6,296 % fällig am 15.07.2038	6.260	6.207	0,43	Adler Group S.A. (d)	64.865	34	0,00				
Structured Asset Investment Loan Trust				Adler Group S.A.	143.630	87	0,01				
5,870 % fällig am 25.01.2036	471	450	0,03								
6,150 % fällig am 25.09.2034	1.926	1.877	0,13								
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust											
5,380 % fällig am 25.05.2047	192	182	0,01								
6,125 % fällig am 25.05.2035	2.900	2.840	0,19								
Terwin Mortgage Trust											
6,530 % fällig am 25.03.2035	406	378	0,03								
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust											
5,900 % fällig am 25.12.2035	701	685	0,05								
6,875 % fällig am 25.11.2035	5.050	4.972	0,34								
		113.215	7,78								

\* Das Engagement des Low Duration Income Fund in den Anlagefonds stieg etwas über 10 %. Ab dem 3. Juli 2023 erfüllte der Fonds die Vorgaben wieder.

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,120 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 276.200	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.07.2025	\$ (281.598)	\$ 276.200	\$ 276.318	18,97
	5,170	30.06.2023	03.07.2023	46.400	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.10.2051	(48.032)	46.400	46.420	3,19
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	3.892	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(3.970)	3.892	3.892	0,27
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (333.600)	\$ 326.492	\$ 326.630	22,43

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	42	\$ 280	0,02
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	22	97	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	23	75	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	29	170	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	22	80	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	35	224	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	20	79	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	21	65	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	26	132	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	17	58	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	53	73	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	81	168	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	927	1.857	0,12
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	23	(26)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	16	(2)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	82	(136)	(0,01)
				\$ 3.194	0,22

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	80	\$ (35)	\$ (30)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	80	(28)	(4)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	15	(6)	(2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	15	(8)	(3)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	33	(54)	(2)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	35	(72)	(7)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	33	(61)	(7)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	50	(97)	(3)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	50	(104)	(8)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	50	(41)	(3)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	33	(63)	(116)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	35	(68)	(129)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	33	(63)	(126)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	50	(99)	(199)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	50	(106)	(221)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	50	(47)	(236)	(0,02)
				\$ (952)	\$ (1.096)	(0,07)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ 2.098 0,15

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 7.600	\$ 205	0,02
Airbus Finance BV	1,000	20.06.2026	3.100	(31)	0,00
Airbus Finance BV	1,000	20.06.2028	200	(1)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2025	\$ 700	22	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	2.500	(15)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	1.500	(12)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	600	4	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	1.000	9	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Income Fund (Fort.)

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Co.	5,000 %	20.12.2024	\$ 2.600	\$ (100)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	100	3	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	100	5	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	200	9	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	400	30	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	4.700	22	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	€ 2.400	236	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2027	1.100	60	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 3.000	(45)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	400	(7)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	4.300	15	0,00
				\$ 409	0,03

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000 %	20.06.2024	\$ 688	\$ 27	0,00
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	510	23	0,00
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	1.196	6	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	12.972	253	0,02
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	1.300	57	0,00
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	2.700	71	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	5.782	(247)	(0,02)
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	2.254	(11)	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	11.187	189	0,01
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	58.600	1.597	0,12
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	2.300	16	0,00
				\$ 1.981	0,14

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,060 %	21.02.2052	£ 300	\$ (179)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,096	14.02.2052	600	(354)	(0,02)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,101	21.02.2052	300	(176)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175	28.02.2052	600	(342)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053	1.900	170	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	¥ 8.473.000	493	0,03
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	550.000	1	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	2.140.000	162	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	1.140.000	246	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	140.000	38	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.07.2023	\$ 3.600	49	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	02.08.2023	1.000	14	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	283.500	3.911	0,27
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	09.08.2023	1.100	(15)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	06.09.2023	6.400	89	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	12.09.2023	15.700	(219)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	56.300	(803)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	400	6	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	32.600	2.843	0,20
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	56.300	5.046	0,35
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	10.869	(1.109)	(0,08)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	76.933	(8.543)	(0,60)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,928	06.05.2026	2.200	212	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,940	08.06.2026	2.900	269	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	3.600	266	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	4.070	368	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	20.713	4.263	0,29
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,030	17.06.2026	3.600	323	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,235	12.05.2028	1.100	139	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	4.400	462	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	22.690	(2.238)	(0,15)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.12.2050	12.600	3.739	0,26
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	8.700	2.023	0,14
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	283.500	(4.649)	(0,32)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,317	16.12.2050	400	(149)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	15.02.2027	6.700	655	0,05
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	20.07.2031	1.400	245	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,370	19.07.2031	900	157	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	3.600	(375)	(0,03)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,418	20.01.2027	1.300	(125)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	2.500	(237)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,438	22.01.2051	9.000	(3.185)	(0,22)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	6.300	597	0,04
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	2.000	342	0,02

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500 %	15.12.2028	\$ 7.919	\$ (1.112)	(0,08)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	1.200	123	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	05.10.2031	1.500	(247)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	17.06.2050	7.700	3.765	0,26
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	800	(99)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	1.500	(243)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	22.10.2031	1.000	(161)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,545	26.10.2031	1.000	(161)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,570	12.01.2027	1.400	(128)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	2.800	(246)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,580	13.01.2051	9.300	(3.127)	(0,21)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	17.200	630	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	15.02.2027	26.800	(2.321)	(0,16)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,625	06.01.2030	300	46	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	1.300	(153)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	08.02.2032	1.700	(258)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,655	24.01.2032	1.300	(202)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	06.03.2024	6.400	(152)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	25.000	(2.076)	(0,14)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	1.600	(232)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,735	12.01.2032	1.100	(166)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2025	38.000	1.154	0,08
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	3.538	164	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.01.2030	4.600	642	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.608	68	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	28.100	3.956	0,27
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	600	(84)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,768	02.02.2032	1.000	(152)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	2.100	(178)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	1.100	349	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	2.300	(193)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,815	24.01.2052	300	(88)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,867	26.01.2052	300	(85)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,910	17.10.2049	400	121	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,988	09.02.2032	1.100	145	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	2.100	49	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	10.12.2029	21.000	2.486	0,17
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	11.170	143	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	12.02.2030	2.500	323	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	10.03.2030	1.200	133	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	17.930	494	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,008	09.02.2032	1.900	243	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	17.06.2027	5.600	(356)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	12.03.2050	15.700	3.518	0,24
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	12.300	446	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	21.900	511	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	1.400	115	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,436	08.06.2032	6.800	539	0,04
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	43.700	1.037	0,07
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	5.430	414	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,451	08.06.2032	8.700	680	0,05
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,543	05.02.2024	1.000	16	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,550	05.02.2024	1.000	16	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,559	05.02.2024	1.000	16	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,571	05.02.2024	500	8	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,580	05.02.2024	1.500	23	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,605	05.02.2024	1.500	23	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,605	28.06.2027	3.900	(192)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,607	05.02.2024	500	8	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	19.12.2023	19.100	(42)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	15.500	(748)	(0,05)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	19.06.2024	24.000	1.210	0,08
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	19.06.2026	12.700	981	0,07
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	85.750	3.413	0,23
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	7.110	257	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	270	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	1.400	(60)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	1.400	(60)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	2.000	(86)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	1.200	(22)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	1.400	(56)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	43.820	1.295	0,09
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	2.000	(47)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	3.200	(79)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	500	15	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	2.000	(34)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	3.200	(47)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	2.100	(30)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,420	24.05.2033	7.600	(71)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	2.100	(26)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	3.900	(42)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	3.900	(65)	0,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Income Fund (Fort.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500 %	21.06.2026	\$ 6.720	\$ 178	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	12.200	(109)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	8.700	57	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.05.2033	29.710	(447)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	8.100	(6)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	1.100	9	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	66.350	(164)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	13.900	84	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	2.000	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,040	20.06.2024	7.900	(60)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,060	20.06.2024	31.700	(234)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,140	22.06.2024	13.200	(87)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	65.120	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	144.940	(69)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,100	22.05.2024	125.980	52	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,400	06.06.2024	281.160	245	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	02.01.2025	BRL 100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,160	02.01.2025	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,220	04.01.2027	200	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,245	04.01.2027	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,260	04.01.2027	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,350	02.01.2025	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,715	04.01.2027	200	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	04.01.2027	500	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,000	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,015	04.01.2027	57.400	406	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,080	02.01.2025	500	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,140	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,145	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,160	02.01.2025	500	1	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.07.2023	\$ 3.600	(48)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	02.08.2023	1.000	(14)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	283.500	(3.889)	(0,27)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	09.08.2023	1.100	15	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	06.09.2023	6.400	(90)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	12.09.2023	15.700	222	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	56.300	809	0,06
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	400	(6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023	21.731	285	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.09.2023	76.933	(958)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,928	06.08.2023	2.200	24	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,940	08.09.2023	2.900	34	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.09.2023	20.713	245	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,030	17.09.2023	3.600	40	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,235	12.08.2023	1.100	12	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023	21.300	233	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.09.2023	4.400	47	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	20.07.2023	1.400	9	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	15.08.2023	6.700	46	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,370	19.07.2023	900	6	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,418	20.07.2023	1.300	(8)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,425	18.07.2023	2.500	(16)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,438	22.07.2023	9.000	(56)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	16.07.2023	2.000	12	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	17.08.2023	6.300	41	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	05.07.2023	1.500	(14)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023	7.919	(83)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	17.09.2023	7.700	78	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.09.2023	1.200	12	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023	800	(5)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	15.07.2023	1.500	(14)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	22.07.2023	1.000	(10)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	26.07.2023	1.000	(10)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	12.07.2023	1.400	(8)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	13.07.2023	9.300	(51)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	16.08.2023	2.800	(16)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,600	15.08.2023	26.800	(152)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	06.07.2023	300	2	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.07.2023	1.300	(7)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,655	24.07.2023	1.300	(7)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	17.08.2023	25.000	(130)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,735	12.07.2023	1.100	(5)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.07.2023	4.600	21	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2023	1.100	6	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,815	24.07.2023	300	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,867	26.07.2023	300	(1)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,910	17.07.2023	400	3	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.08.2023	2.500	10	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.09.2023	22.200	195	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,008	09.08.2023	1.900	7	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,543	05.08.2023	1.000	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,550	05.08.2023	1.000	1	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,559 %	05.08.2023	\$ 1.000	\$ 1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,571	05.08.2023	500	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,580	05.08.2023	1.500	2	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,605	05.08.2023	1.500	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,607	05.08.2023	500	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	19.09.2023	19.100	136	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.09.2023	36.700	234	0,02
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	AUD 12.400	(651)	(0,04)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	€ 2.500	1.088	0,07
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,294	30.06.2026	100	12	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	200	21	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	300	26	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	200	14	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024	300	14	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,453	29.12.2023	400	11	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050	600	280	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	2.400	(107)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	14.200	(1.478)	(0,10)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	4.800	(503)	(0,03)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	27.100	1.174	0,08
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	9.800	(919)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	4.700	(441)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	21.09.2027	3.500	(209)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	9.900	(155)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	15.000	(237)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	8.600	(146)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	9.900	(137)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	9.200	(137)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	9.600	(143)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	4.900	(109)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	11.600	(103)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,000	15.09.2031	£ 900	(169)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,020	15.10.2031	1.200	(218)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,055	15.09.2031	800	(149)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031	1.700	(286)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,140	15.10.2031	2.300	(382)	(0,03)
					\$ 13.070	0,89
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 15.460</b>	<b>1,06</b>

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110 %	26.07.2032	1.100	\$ 178	\$ 129	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	1.600	259	319	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,053	20.07.2023	15.900	96	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,053	20.07.2023	15.900	96	350	0,02
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	15.900	119	27	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	15.900	119	247	0,02
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,590	19.07.2024	11.300	156	42	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,590	19.07.2024	11.300	155	287	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	1.200	158	100	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	1.400	185	230	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,170	19.07.2032	1.200	190	144	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,170	19.07.2032	1.400	222	271	0,02
							\$ 1.933	\$ 2.146	0,15

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Income Fund (Fort.)

## VERKAUFSOPTIENEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2022	6.000	\$ (19)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2022	6.000	(19)	(81)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2022	2.800	(11)	(13)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2022	2.800	(11)	(8)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2022	2.800	(18)	(7)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2022	2.800	(18)	(2)	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2022	1.000	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2022	1.000	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2022	2.300	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2022	2.300	(7)	(2)	0,00
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2022	3.600	(25)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2022	3.600	(25)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2022	1.200	(4)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2022	1.200	(4)	(6)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2022	1.400	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2022	1.400	(3)	(5)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2022	2.100	(17)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2022	2.100	(17)	(39)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2022	4.800	(29)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2022	4.800	(29)	(103)	(0,01)
BRC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2022	3.300	(25)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2022	3.300	(25)	(57)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,765	25.07.2022	6.900	(43)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,765	25.07.2022	6.900	(43)	(172)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,468	25.07.2022	1.500	(36)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,468	25.07.2022	1.500	(36)	(94)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2022	4.800	(30)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2022	4.800	(30)	(103)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2022	3.900	(25)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2022	3.900	(25)	(79)	(0,01)
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2022	3.900	(27)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2022	3.900	(27)	(75)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2022	3.900	(27)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2022	3.900	(27)	(73)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2022	3.900	(27)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2022	3.900	(27)	(72)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2022	3.900	(27)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2022	3.900	(27)	(81)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2022	3.800	(26)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2022	3.800	(26)	(83)	(0,01)
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2022	3.800	(28)	(1)	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2022	3.800	(28)	(73)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2022	3.700	(25)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2022	3.700	(25)	(77)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2022	7.200	(26)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2022	7.200	(26)	(94)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2022	7.200	(25)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2022	7.200	(25)	(100)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2022	6.100	(19)	(1)	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2022	6.100	(19)	(76)	(0,01)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2022	12.300	(97)	(15)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2022	12.300	(97)	(226)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2022	4.100	(31)	(5)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2022	4.100	(31)	(74)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2022	2.300	(8)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2022	2.300	(8)	(11)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2022	1.400	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2022	1.400	(3)	(5)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,050	19.07.2022	6.900	(41)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,050	19.07.2022	6.900	(41)	(153)	(0,01)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,052	20.07.2022	6.900	(42)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,052	20.07.2022	6.900	(42)	(152)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,700	19.07.2022	1.500	(35)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,700	19.07.2022	1.500	(35)	(79)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,675	20.07.2022	1.500	(35)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,675	20.07.2022	1.500	(35)	(81)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2022	4.400	(30)	(1)	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2022	4.400	(30)	(93)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2022	2.300	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2022	2.300	(7)	(2)	0,00
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2022	4.000	(14)	(1)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2022	4.000	(14)	(3)	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2022	2.200	(7)	(4)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2022	2.200	(7)	(9)	0,00	
Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,550	19.07.2022	400	(29)	0	0,00	
Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,550	19.07.2022	400	(29)	(47)	0,00	
Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,537	20.07.2022	400	(29)	0	0,00	
Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,537	20.07.2022	400	(29)	(48)	0,00	
							\$ (1.928)	\$ (2.619)	(0,18)



## ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,030 %	24.07.2024	15.900	\$ (119)	\$ (350)	(0,02)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	15.900	(119)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	15.900	(139)	(254)	(0,02)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	15.900	(139)	(36)	0,00
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	11.300	(200)	(321)	(0,02)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	11.300	(200)	(75)	(0,01)
						\$ (916)	\$ (1.040)	(0,07)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ (12)	\$ 8	\$ (4)	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	500	(45)	23	(22)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(2)	3	1	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	900	(41)	22	(19)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(13)	12	(1)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	640	(82)	57	(25)	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(14)	2	(12)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(2)	3	1	0,00
DUB	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	100	(4)	0	(4)	0,00
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	500	(18)	3	(15)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	300	(27)	14	(13)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(11)	8	(3)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	700	(79)	52	(27)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	300	(10)	11	1	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	700	(27)	6	(21)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	800	(71)	36	(35)	(0,01)
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	300	(2)	5	3	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(3)	6	3	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.400	(62)	12	(50)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(16)	14	(2)	0,00
					\$ (541)	\$ 297	\$ (244)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500 %	16.12.2072	\$ 62.300	\$ 92	\$ (1.027)	\$ (935)	(0,06)
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	15.300	(74)	(95)	(169)	(0,01)
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	25.375	(78)	(25)	(103)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	25.375	(193)	16	(177)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	(2)	(1)	(3)	0,00
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	25.500	86	(469)	(383)	(0,03)
					\$ (169)	\$ (1.601)	\$ (1.770)	(0,12)

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	KRW	223.531	\$ 171	\$ 1	\$ 1	0,00
	07.2023	\$	6.450	MXN 118.750	456	456	0,03
	08.2023	AUD	73	\$ 48	0	0	0,00
	08.2023	£	1.313	1.648	0	(21)	0,00
	08.2023	¥	1.058.165	7.674	292	292	0,02
	08.2023	\$	11.982	AUD 17.725	0	(169)	(0,01)
	08.2023		1.034	€ 959	14	14	0,00
	08.2023		1.506	NZD 2.375	0	(51)	0,00
	09.2023	¥	1.441.000	\$ 10.300	208	208	0,01
	09.2023	TWD	46.342	1.527	36	36	0,00
	09.2023	\$	632	IDR 9.457.672	0	(4)	0,00
	09.2023		1.260	KRW 1.596.349	0	(43)	0,00
BPS	07.2023	KRW	33.984	\$ 26	0	0	0,00
	08.2023	CNH	541	78	4	4	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Income Fund (Fort.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	KRW	2.227.911	\$ 1.699	\$ 6	\$ 6	0,00
	08.2023	TWD	23.196	760	15	15	0,00
	08.2023	\$	92	CNH 642	0	(4)	0,00
	08.2023		684	€ 625	0	(1)	0,00
	08.2023		1.944	INR 159.719	1	1	0,00
	08.2023	ZAR	89.047	\$ 4.848	153	153	0,01
	09.2023	\$	232	IDR 3.489.845	0	0	0,00
	10.2023	ZAR	47.252	\$ 2.539	64	64	0,00
BRC	07.2023	¥	285.000	2.203	228	228	0,02
	07.2023	KRW	224.770	172	1	1	0,00
	07.2023	\$	1.265	BRL 6.050	0	(10)	0,00
	08.2023	£	18.058	\$ 22.665	0	(298)	(0,02)
	08.2023	\$	173	CNH 1.196	0	(8)	0,00
	08.2023		3.833	¥ 507.304	0	(301)	(0,02)
	08.2023	ZAR	4.892	\$ 265	7	7	0,00
	09.2023	IDR	18.085	1	0	0	0,00
	09.2023	¥	510.000	3.726	164	164	0,01
CBK	07.2023	BRL	5.713	1.191	6	6	0,00
	07.2023	PEN	357	98	0	0	0,00
	07.2023	\$	92	PEN 357	7	7	0,00
	08.2023	AUD	79	\$ 53	0	0	0,00
	08.2023	€	1.137	1.244	1	1	0,00
	08.2023	¥	1.161.835	8.432	327	327	0,02
	08.2023	TWD	24.150	791	16	16	0,00
	08.2023	\$	2.914	CLP 2.396.204	56	56	0,00
	08.2023		628	¥ 83.400	0	(47)	0,00
	08.2023		2.462	NOK 25.677	0	(61)	0,00
	08.2023		558	ZAR 10.215	0	(20)	0,00
	09.2023	KRW	204.470	\$ 158	2	2	0,00
	09.2023	\$	1.177	BRL 5.713	0	(6)	0,00
	09.2023		5	IDR 73.375	0	0	0,00
DUB	07.2023	PEN	357	\$ 98	0	(1)	0,00
	07.2023	\$	9.827	BRL 53.244	1.212	1.212	0,08
	07.2023		196	PEN 715	1	1	0,00
	10.2023	ZAR	8.696	\$ 478	22	22	0,00
GLM	07.2023	BRL	106.402	22.036	0	(21)	0,00
	07.2023	KRW	88.882	68	0	0	0,00
	08.2023	CHF	2.864	3.236	21	21	0,00
	08.2023	KRW	1.061.378	807	0	0	0,00
	08.2023	\$	2.997	INR 246.205	1	1	0,00
	08.2023		3.076	NOK 32.641	0	(25)	0,00
	09.2023	TWD	35.334	\$ 1.161	24	24	0,00
	09.2023	\$	22.036	BRL 107.581	17	17	0,00
	09.2023		1.186	PEN 4.370	12	12	0,00
	10.2023	MXN	5.411	\$ 308	0	(1)	0,00
	10.2023	ZAR	9.925	530	10	10	0,00
MBC	07.2023	¥	330.000	2.527	237	237	0,02
	08.2023	CNH	378	55	3	3	0,00
	08.2023	€	147.971	163.283	1.513	1.513	0,10
	08.2023	\$	742	CHF 663	2	2	0,00
	08.2023		1.343	€ 1.225	0	(4)	0,00
	09.2023	¥	1.863.000	\$ 13.571	546	546	0,04
	09.2023	\$	2.320	KRW 2.959.169	0	(65)	(0,01)
	07.2023	€	86	\$ 93	0	0	0,00
	07.2023	IDR	2.493.164	167	0	0	0,00
	07.2023	\$	547	£ 433	4	4	0,00
	07.2023		166	IDR 2.493.164	0	0	0,00
	08.2023	TWD	25.051	\$ 826	22	22	0,00
	08.2023	\$	779	€ 719	7	7	0,00
	08.2023		8.203	¥ 1.090.123	0	(614)	(0,04)
	08.2023	ZAR	6.258	\$ 323	0	(7)	0,00
	09.2023	KRW	1.098.743	846	9	9	0,00
	09.2023	\$	539	IDR 8.059.149	0	(4)	0,00
	09.2023		2.599	KRW 3.325.627	0	(64)	0,00
	07.2023		1	MXN 23	0	0	0,00
RBC	08.2023	£	38.516	\$ 48.665	0	(315)	(0,02)
	08.2023	\$	2.139	CHF 1.914	10	10	0,00
	08.2023		880	MXN 15.242	2	2	0,00
SCX	08.2023	CNH	637	\$ 93	5	5	0,00
	08.2023	NZD	3.092	1.879	0	(15)	0,00
	08.2023	\$	1.161	NOK 12.340	0	(7)	0,00
	08.2023		526	NZD 843	0	(10)	0,00
	09.2023	KRW	201.646	\$ 156	2	2	0,00
	09.2023	TWD	38.723	1.270	24	24	0,00
	09.2023	\$	5.578	IDR 83.020.457	0	(63)	0,00
SSB	07.2023	¥	120.000	\$ 910	76	76	0,01
	07.2023	KRW	164.720	126	1	1	0,00
	07.2023	\$	10.516	BRL 52.821	434	434	0,03
	12.2023		166	INR 13.701	0	0	0,00
UAG	08.2023	£	38.597	\$ 48.785	0	(296)	(0,02)
	08.2023	\$	790	CHF 712	9	9	0,00
	08.2023		7.881	£ 6.228	39	39	0,00
	08.2023	ZAR	33.736	\$ 1.757	1	(22)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
	09.2023	SGD	191	\$	143	\$	1	0,00	
	09.2023	ZAR	15.714		896		70	0,00	
				\$	6.402	\$	(2.578)	3.824	0,26

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend und Class Z EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2023	€	18	\$	20	\$	0	0,00	
	07.2023	\$	248.660	€	231.375		3.770	0,26	
BPS	07.2023	€	234.220	\$	256.635		1.101	0,08	
	07.2023	\$	250.174	€	232.693		3.693	0,25	
	08.2023		256.956		234.184		0	(0,08)	
CBK	07.2023	€	236.181	\$	256.765		0	(0,06)	
	07.2023	\$	697	€	641		3	0,00	
	08.2023		256.018		235.152		884	0,06	
MBC	07.2023	€	191	\$	205		0	(0,00)	
	07.2023	\$	3.712	€	3.455		59	0,01	
SCX	07.2023		249.465		233.109		4.857	0,33	
				\$	14.367	\$	(2.027)	12.340	0,85

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BPS	07.2023	\$	105.036	£	84.920	\$	2.927	0,20	
BRC	07.2023		75.791		59.524		0	(0,01)	
	07.2023	£	1.700	\$	2.150		(11)	0,00	
CBK	07.2023	\$	54	£	43		0	0,00	
MBC	07.2023		105.325		85.082		2.844	0,20	
MYI	07.2023		104.636		84.189		2.398	0,16	
				\$	8.169	\$	(126)	8.043	0,55

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BRC	07.2023	\$	3.561	SGD	4.819	\$	(1)	0,00	
GLM	07.2023	SGD	129	\$	95		0	0,00	
	07.2023	\$	585	SGD	784		(5)	0,00	
MBC	07.2023		3.252		4.394		(5)	0,00	
	08.2023		4		5		0	0,00	
MYI	07.2023	SGD	5.215	\$	3.860		6	0,00	
	08.2023	\$	3.860	SGD	5.210		(6)	0,00	
SCX	07.2023		387		523		0	0,00	
UAG	07.2023	SGD	9	\$	7		0	0,00	
	07.2023	\$	4.396	SGD	5.936		(10)	0,00	
				\$	7	\$	(27)	(20)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 20.660 1,42

Summe Anlagen

\$ 2.218.704 152,45

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (763.319) (52,45)

Nettovermögen

\$ 1.455.385 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(e) Nullkuponwertpapier.

(f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Income Fund (Fort.)

- (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
 (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
 (i) Mit dem Fonds verbunden.  
 (j) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (k) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,77 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Intelsat Emergence S.A.	05.09.2018 - 23.02.2022	\$ 3.227	\$ 1.046	0,07
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	166	782	0,05
Westmoreland Mining Holdings LLC	26.03.2019	1	1	0,00
		\$ 3.394	1.829	0,12

Barmittel in Höhe von 36.784 USD (31. Dezember 2022: 28.338 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 4.353 USD (31. Dezember 2022: 9.984 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 480	\$ 1.699.324	\$ 8.224	\$ 1.708.028
Investmentfonds	145.966	0	0	145.966
Pensionsgeschäfte	0	326.492	0	326.492
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	73	38.145	0	38.218
Summen	\$ 146.519	\$ 2.063.961	\$ 8.224	\$ 2.218.704

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.018	\$ 1.197.881	\$ 14.709	\$ 1.213.608
Investmentfonds	106.140	0	0	106.140
Pensionsgeschäfte	0	98.831	0	98.831
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	579	14.698	0	15.277
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(5.209)	0	(5.209)
Summen	\$ 107.737	\$ 1.306.201	\$ 14.709	\$ 1.428.647

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ (35)	\$ 0	\$ (35)
BOA	4.367	(3.450)	917	(2.834)	2.820	(14)
BPS	6.825	(5.480)	1.345	(1.952)	1.730	(222)
BRC	(394)	750	356	(307)	301	(6)
CBK	195	0	195	6.696	(6.666)	30
DUB	1.066	(1.170)	(104)	(582)	370	(212)
GLM	(1.123)	996	(127)	(2.097)	2.036	(61)
GST	(993)	1.154	161	(885)	904	19
HUS	1	0	1	1	0	1
MBC	5.124	(4.570)	554	4.371	(3.930)	441
MEI	(169)	280	111	(56)	260	204
MYC	(783)	1.173	390	(562)	813	251
MYI	1.751	(1.090)	661	(223)	270	47
RBC	(303)	0	(303)	(39)	0	(39)
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(49)	0	(49)
SCX	4.793	(4.320)	473	6.363	(5.950)	413
SSB	511	(570)	(59)	16	0	16
UAG	(208)	0	(208)	(687)	480	(207)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	50,04	35,07
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	67,31	75,51
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	1,33
Investmentfonds	10,03	9,79
Pensionsgeschäfte	22,43	9,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,15	0,19
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,06	0,57
Freiverkehrsfinanzderivate	1,42	0,66
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,48)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	2,27	6,41
Unternehmensanleihen und Wechsel	14,95	26,11
Wandelanleihen & Wechsel	0,04	0,05
US-Regierungsbehörden	53,28	33,41
US-Schatzobligationen	10,20	9,02
Non-Agency-MBS	21,96	19,47
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,78	8,93
Staatsemissionen	1,57	3,00
Stammaktien	0,17	0,29
Bezugsrechte	0,00	0,01
Optionsscheine	0,00	0,00
Real Estate Investment Trusts	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	5,14	5,21
Investmentfonds	10,03	9,79
Pensionsgeschäfte	22,43	9,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,22	0,20
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,07)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,14	0,00
Zinsswaps	0,89	0,57
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,15	0,19
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,18)	(0,32)
Zinscaps	(0,07)	(0,08)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	(0,04)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,12)	(0,13)
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,26	(0,55)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,40	1,60
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,48)
Sonstige Aktiva und Passiva	(52,45)	(31,75)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Opportunities Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
American Airlines, Inc. 10,000 % fällig am 20.04.2028	\$ 1.100	\$ 1.125	0,10	Credit Suisse Group AG ^ 2,125 % fällig am 19.11.2025	\$ 7.900	\$ 316	0,03	Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030 3,650 % fällig am 19.11.2029	€ 2.400	\$ 2.226	0,20 1,298
IRB Holding Corp. 8,202 % fällig am 15.12.2027	4.840	4.812	0,43	Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 2.000	1.883	0,17	Peugeot Invest 1,875 % fällig am 30.10.2026	3.800	3.778	0,34
MPH Acquisition Holdings LLC 9,726 % fällig am 01.09.2028	3.832	3.435	0,31	CTP NV 0,625 % fällig am 27.09.2026 1,500 % fällig am 27.09.2031	2.700 2.500	2.382 1.904	0,21 0,17	Piper Sandler Cos. 5,200 % fällig am 15.10.2023	\$ 1.600	1.596	0,14
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % fällig am 16.11.2025	1.215	1.128	0,10	Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 20.01.2027 2,625 % fällig am 16.12.2024 3,729 % fällig am 14.01.2032 (i)	2.000 £ 3.000 \$ 2.200	1.940 3.550 1.665	0,17 0,32 0,15	Protective Life Global Funding 3,104 % fällig am 15.04.2024	5.000	4.894	0,44
		10.500	0,94	DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	€ 2.100	1.740	0,16	Rexford Industrial Realty LP 2,150 % fällig am 01.09.2031	21	16	0,00
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL BANKEN UND FINANZEN</b>											
Acef Holding S.C.A. 1,250 % fällig am 26.04.2030	€ 1.000	836	0,07	Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % fällig am 29.04.2030	\$ 700	657	0,06	Sagax AB 1,125 % fällig am 30.01.2027	€ 1.700	1.565	0,14
AGFC Capital Trust 7,010 % fällig am 15.01.2067	\$ 500	270	0,02	Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % fällig am 19.07.2024 2,900 % fällig am 16.02.2028 3,021 % fällig am 06.03.2024 3,250 % fällig am 15.09.2025 3,375 % fällig am 13.11.2025	€ 2.900 \$ 900 € 100 200 \$ 600	3.063 772 108 210 558	0,27 0,07 0,01 0,02 0,05	Sagax Euro MTN NL BV 0,750 % fällig am 26.01.2028 1,000 % fällig am 17.05.2029	600 1.000	497 778	0,04 0,07
Aircastle Ltd. 2,850 % fällig am 26.01.2028	1.500	1.277	0,11	Goldman Sachs Group, Inc. 3,691 % fällig am 05.06.2028 4,223 % fällig am 01.05.2029	100 2.500	94 2.363	0,01 0,21	Santander Holdings USA, Inc. 3,244 % fällig am 05.10.2026	\$ 100	90	0,01
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023 2,250 % fällig am 17.07.2027	€ 505 2.900	551 2.874	0,05 0,26	HSBC Holdings PLC 5,750 % fällig am 20.12.2027 6,000 % fällig am 29.03.2040 6,254 % fällig am 09.03.2034	€ 100 200 \$ 2.100	121 223 2.154	0,01 0,02 0,19	Santander UK Group Holdings PLC 3,625 % fällig am 14.01.2026 3,823 % fällig am 03.11.2028 4,796 % fällig am 15.11.2024	£ 300 \$ 300 4.000	349 270 3.970	0,03 0,02 0,35
American Assets Trust LP 3,375 % fällig am 01.02.2031	\$ 2.050	1.606	0,14	Huarong Finance Co. Ltd. 3,375 % fällig am 24.02.2030 3,625 % fällig am 30.09.2030 4,250 % fällig am 07.11.2023 4,500 % fällig am 29.05.2029 4,750 % fällig am 27.04.2027	800 1.500 200 1.400 1.000	607 1.139 167 1.123 866	0,05 0,10 0,01 0,10 0,08	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	€ 1.100	992	0,09
American Tower Corp. 4,400 % fällig am 15.02.2026 5,250 % fällig am 15.07.2028	850 2.000	824 1.979	0,07 0,18	ING Groep NV 1,726 % fällig am 01.04.2027	3.000	2.674	0,24	Sofina S.A. 1,000 % fällig am 23.09.2028	2.500	2.184	0,19
Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	3.100	2.297	0,20	Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h)	€ 1.700	1.796	0,16	Standard Chartered PLC 1,214 % fällig am 23.03.2025	\$ 1.500	1.443	0,13
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	1.806	1.525	0,14	JPMorgan Chase & Co. 1,963 % fällig am 23.03.2030	1.000	964	0,09	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 2,550 % fällig am 10.03.2025 3,629 % fällig am 06.04.2026	2.400 € 2.600	2.268 2.802	0,20 0,25
Balder Finland Oyj 1,000 % fällig am 18.01.2027 1,000 % fällig am 20.01.2029	€ 1.900 500	1.563 348	0,14 0,03	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 17.11.2025	2.900	2.808	0,25	Sun Communities Operating LP 4,200 % fällig am 15.04.2032	\$ 2.500	2.186	0,20
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 7,677 % fällig am 18.01.2028	3.800	3.493	0,31	LeasePlan Corp. NV 2,875 % fällig am 24.10.2024	\$ 1.200	1.144	0,10	Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€ 8.000	8.716	0,78
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h)	1.000	1.082	0,10	Legal & General Group PLC 5,625 % fällig am 24.03.2031 (f)(h)	£ 600	590	0,05	TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028 5,250 % fällig am 29.05.2026	£ 1.000 1.400	940 1.640	0,08 0,15
Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 7.000	1.852	0,17	Lloyds Banking Group PLC 2,250 % fällig am 16.10.2024 3,750 % fällig am 11.01.2027 3,750 % fällig am 18.03.2028 4,375 % fällig am 22.03.2028 4,716 % fällig am 11.08.2026	900 \$ 2.500 1.000 400 3.000	1.083 2.344 924 380 2.916	0,10 0,21 0,08 0,03 0,26	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)	\$ 100	98	0,01
Bank of America Corp. 3,384 % fällig am 02.04.2026 3,864 % fällig am 23.07.2024 4,376 % fällig am 27.04.2028	\$ 2.300 1.800 1.000	2.206 1.798 961	0,20 0,16 0,09	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,339 % fällig am 19.07.2024 5,242 % fällig am 19.04.2029	€ 1.600 € 600	1.679 591	0,15 0,05	UBS Group AG 1,000 % fällig am 24.06.2027 2,125 % fällig am 12.09.2025 2,125 % fällig am 15.11.2029 3,091 % fällig am 14.05.2032 3,750 % fällig am 26.03.2025 4,194 % fällig am 01.04.2031 4,550 % fällig am 17.04.2026	€ 500 € 200 £ 2.400 \$ 3.500 150 800 1.000	484 238 2.387 2.833 144 712 962	0,04 0,02 0,21 0,25 0,01 0,06 0,09
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 1,250 % fällig am 05.12.2025	€ 1.200	1.340	0,12	Mizuho Financial Group, Inc. 3,477 % fällig am 12.04.2026	3.050	2.889	0,26	UniCredit SpA 7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h)	€ 1.200	1.289	0,12
Barclays PLC 3,125 % fällig am 17.01.2024 4,375 % fällig am 12.01.2026 4,972 % fällig am 16.05.2029 5,746 % fällig am 09.08.2033 7,125 % fällig am 15.06.2025 (f)(h)	100 \$ 1.700 800 100 € 1.800	125 1.634 757 97 2.081	0,01 0,15 0,07 0,01 0,19	NatWest Group PLC 2,000 % fällig am 04.03.2025 4,800 % fällig am 05.04.2026 4,892 % fällig am 18.05.2029 8,000 % fällig am 10.08.2025 (f)(h)	€ 200 € 2.300 \$ 700 700 300	159 2.463 680 667 292	0,01 0,22 0,06 0,06 0,03	Volkswagen Financial Services NV 1,625 % fällig am 10.02.2024 1,875 % fällig am 03.12.2024	€ 1.100 2.000	1.359 2.378	0,12 0,21
BNP Paribas S.A. 1,875 % fällig am 14.12.2027 1,904 % fällig am 30.09.2028	1.900 \$ 3.400	1.971 2.900	0,18 0,26	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,450 % fällig am 15.09.2028	\$ 800	639	0,06	Wells Fargo & Co. 4,808 % fällig am 25.07.2028	\$ 2.000	1.957	0,17
BPCE S.A. 1,500 % fällig am 13.01.2042 (h) 4,625 % fällig am 12.09.2028	€ 1.800 \$ 2.500	1.656 2.346	0,15 0,21	Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 2.200	2.322	0,21			190.893	17,02
Canadian Imperial Bank of Commerce 3,250 % fällig am 31.03.2027	€ 3.200	3.428	0,31								
CapitalLand Ascendas REIT 0,750 % fällig am 23.06.2028	1.100	960	0,09								
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % fällig am 27.01.2028 0,900 % fällig am 12.10.2029	1.600 1.600	1.381 1.278	0,12 0,11								
Cooperative Rabobank UA 3,100 % fällig am 29.06.2028 (f)(h)	3.800	3.233	0,29								
CPI Property Group S.A. 1,750 % fällig am 14.01.2030 2,750 % fällig am 22.01.2028	3.000 € 700	1.987 596	0,18 0,05								
Credit Suisse AG 0,250 % fällig am 01.09.2028 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	€ 3.000 \$ 4.100	2.630 4.085	0,23 0,36								







BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
Euro-Galaxy CLO DAC 3,765 % fällig am 11.04.2031	€ 1.183	\$ 1.267	0,11	5,370 % fällig am 25.04.2037	\$ 583	\$ 416	0,04	5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	400	24	0,00
Fieldstone Mortgage Investment Trust 5,818 % fällig am 25.04.2047	\$ 1.993	1.407	0,13	5,370 % fällig am 25.05.2037	643	380	0,03	South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029	\$ 2.000	\$ 1.763	0,16
Fremont Home Loan Trust 5,285 % fällig am 25.10.2036	148	131	0,01	OZLM Ltd. 6,280 % fällig am 15.04.2031	2.400	2.364	0,21	Turkey Government International Bond 5,750 % fällig am 22.03.2024	1.000	985	0,09
5,350 % fällig am 25.08.2036	211	71	0,01	6,340 % fällig am 17.04.2031	985	972	0,09	6,350 % fällig am 10.08.2024	2.500	2.462	0,22
6,020 % fällig am 25.05.2034	1.325	1.225	0,11	6,400 % fällig am 20.01.2031	1.717	1.700	0,15			12.007	1,07
GE-WMC Mortgage Securities Trust 5,450 % fällig am 25.08.2036	5.159	2.258	0,20	OZLME DAC 4,088 % fällig am 27.07.2032	€ 2.198	2.339	0,21				
Greenwood Park CLO Ltd. 6,290 % fällig am 15.04.2031	1.250	1.240	0,11	Palmer Square European Loan Funding DAC 5,025 % fällig am 12.04.2032	4.774	5.237	0,47				
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd. 6,373 % fällig am 15.09.2037	2.253	2.223	0,20	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 5,645 % fällig am 25.07.2036	\$ 638	597	0,05				
GSA Home Equity Trust 5,772 % fällig am 25.11.2036 ^	468	144	0,01	RAAC Trust 5,910 % fällig am 25.10.2046	94	89	0,01				
5,985 % fällig am 25.06.2036	1.350	373	0,03	Residential Asset Securities Corp. Trust 5,490 % fällig am 25.11.2036	44	41	0,00				
GSAMP Trust 5,290 % fällig am 25.11.2036	1.900	905	0,08	5,735 % fällig am 25.03.2036	965	951	0,08				
5,670 % fällig am 25.02.2046	531	488	0,04	Sculptor European CLO DAC 3,916 % fällig am 14.01.2032	€ 5.000	5.359	0,48				
HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,930 % fällig am 25.01.2036	2.200	1.722	0,15	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 5,470 % fällig am 25.10.2036	\$ 9.702	3.377	0,30				
ICG U.S. CLO Ltd. 6,353 % fällig am 22.07.2031	5.200	5.141	0,46	5,810 % fällig am 25.08.2035 ^	55	43	0,00				
Jubilee CLO DAC 4,326 % fällig am 15.12.2029	€ 1.160	1.251	0,11	Segovia European CLO DAC 4,080 % fällig am 20.07.2032	€ 6.900	7.335	0,65				
LCM LP 6,290 % fällig am 20.10.2027	\$ 126	126	0,01	SG Mortgage Securities Trust 5,360 % fällig am 25.10.2036	\$ 3.600	2.493	0,22				
Lehman XS Trust 6,119 % fällig am 25.03.2037	1.901	1.877	0,17	Sierra Madre Funding Ltd. 5,571 % fällig am 07.09.2039	2.087	1.495	0,13				
LoanCore Issuer Ltd. 6,616 % fällig am 17.01.2037	500	492	0,04	Sound Point CLO Ltd. 6,368 % fällig am 26.07.2031	1.000	983	0,09				
Long Beach Mortgage Loan Trust 5,590 % fällig am 25.02.2036	340	329	0,03	6,412 % fällig am 18.04.2031	7.400	7.271	0,65				
6,065 % fällig am 25.08.2035	4.270	3.769	0,34	Soundview Home Loan Trust 5,350 % fällig am 25.06.2037	2.237	1.529	0,14				
Madison Park Funding Ltd. 6,103 % fällig am 22.04.2027	546	543	0,05	5,410 % fällig am 25.02.2037	1.004	291	0,03				
Man GLG Euro CLO DAC 3,857 % fällig am 15.10.2030	€ 2.198	2.355	0,21	5,650 % fällig am 25.10.2036	1.395	1.302	0,12				
4,023 % fällig am 15.05.2031	499	535	0,05	Structured Asset Investment Loan Trust 6,125 % fällig am 25.01.2035	1.685	1.507	0,13				
4,047 % fällig am 15.01.2030	440	474	0,04	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,305 % fällig am 25.09.2036	4.731	2.975	0,27				
Midocean Credit CLO 6,385 % fällig am 19.07.2028	\$ 104	104	0,01	6,670 % fällig am 25.04.2035	27	27	0,00				
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,220 % fällig am 25.10.2036	1.420	617	0,06	Toro European CLO DAC 4,097 % fällig am 15.07.2030	€ 223	241	0,02				
5,280 % fällig am 25.11.2036	1.660	754	0,07	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust 5,375 % fällig am 25.05.2037	\$ 485	445	0,04				
5,290 % fällig am 25.05.2037	1.361	1.184	0,11	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 5,750 % fällig am 25.04.2037	4.701	3.241	0,29				
5,380 % fällig am 25.10.2036	1.152	610	0,05	6,875 % fällig am 25.11.2035	100	98	0,01				
5,380 % fällig am 25.11.2036	5.128	2.828	0,25			220.863	19,70				
5,400 % fällig am 25.07.2036	426	367	0,03								
5,450 % fällig am 25.09.2036	15.068	5.672	0,51								
5,650 % fällig am 25.04.2036	99	92	0,01								
5,690 % fällig am 25.12.2034	1.362	1.194	0,11								
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 5,660 % fällig am 25.02.2036	1.800	1.624	0,14								
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 6,226 % fällig am 25.10.2036 ^	272	84	0,01								
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 5,950 % fällig am 25.02.2037 ^	3.172	945	0,08								
NovaStar Mortgage Funding Trust 5,310 % fällig am 25.09.2037	17	16	0,00								
5,470 % fällig am 25.05.2036	44	43	0,00								
Oak Hill European Credit Partners DAC 3,930 % fällig am 20.01.2032	€ 669	718	0,06								
Option One Mortgage Loan Trust 5,290 % fällig am 25.01.2037	\$ 51	29	0,00								
5,290 % fällig am 25.02.2037	614	404	0,04								
5,290 % fällig am 25.03.2037	728	653	0,06								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,120 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 87.900	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	\$ (89.679)	\$ 87.900	\$ 87.938	7,84
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	4.300	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025	(4.392)	4.300	4.302	0,38

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Opportunities Fund (Fort.)

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	5,180 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 100	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.04.2025	\$ (102)	\$ 100	\$ 100	0,01
	2,400	30.06.2023	03.07.2023	2.587	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(2.639)	2.587	2.587	0,23
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (96.812)	\$ 94.887	\$ 94.927	8,46

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	297	\$ 541	0,05
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	165	234	0,02
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	12	27	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	435	426	0,04
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	445	(1.217)	(0,11)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	531	1.084	0,10
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	1.433	2.576	0,23
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	522	393	0,03
				\$ 4.064	0,36

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	133	\$ 0	\$ (7)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	133	0	(626)	(0,05)
				\$ 0	\$ (633)	(0,05)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ 3.431 0,31

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 3.200	\$ 16	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	1.700	(19)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	200	1	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	500	23	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.700	8	0,00
				\$ 29	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-34 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2025	\$ 20.700	\$ (1.972)	(0,17)
CDX.HY-39 5-Year Index	(5,000)	20.12.2027	10.989	(517)	(0,05)
CDX.HY-40 5-Year Index	(5,000)	20.06.2028	15.000	(350)	(0,03)
				\$ (2.839)	(0,25)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	\$ 1.600	\$ 12	0,00

#### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		3,500 %	20.09.2033	£ 29.800	\$ (1.475)	(0,13)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		3,750	20.09.2028	27.500	1.778	0,16

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000 %	04.08.2023	\$ 335.700	\$ 4.631	0,41
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	17.09.2023	5.000	(68)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	16.480	(1.277)	(0,11)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	5.000	697	0,06
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	335.700	(6.658)	(0,59)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	34.600	2.571	0,23
Zahlung <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,827	03.07.2028	73.000	(6.790)	(0,61)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,853	18.05.2032	37.780	(4.768)	(0,43)
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,999	03.07.2053	14.900	3.317	0,30
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	12.02.2030	9.900	1.280	0,11
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	10.03.2030	4.900	541	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	13.000	33	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	1.000	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	1.400	(24)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	2.800	(41)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	1.400	(20)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	1.400	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	1.900	(24)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	1.500	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	4.900	(82)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	2.600	(21)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,055	04.01.2027	BRL 18.600	23	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,086	04.01.2027	114.100	139	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,098	04.01.2027	76.900	99	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,734	02.01.2025	24.800	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,800	02.01.2025	111.000	14	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,814	04.01.2027	69.000	404	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,835	02.01.2025	111.000	29	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,868	04.01.2027	14.300	88	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,000	14.11.2023	CAD 44.700	(549)	(0,05)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,060	28.10.2023	139.400	(1.735)	(0,16)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	111.800	(813)	(0,07)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	01.11.2023	NZD 120.200	(1.031)	(0,09)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023	139.900	(1.155)	(0,10)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	\$ 335.700	(4.605)	(0,41)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	17.09.2023	5.000	69	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023	16.480	(216)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.08.2023	9.900	39	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.09.2023	4.900	20	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	€ 11.000	(164)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	11.300	(169)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	18.300	(60)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	6.000	53	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,985	11.10.2027	PLN 69.300	(1.821)	(0,16)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,015	11.10.2027	64.100	(1.705)	(0,15)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,156	13.10.2027	42.800	(1.206)	(0,11)
					\$ (20.707)	(1,85)
					\$ (23.505)	(2,10)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Opportunities Fund (Fort.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021 %	25.10.2023	6.200	\$ 354	\$ 1.572	0,14
FAR	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021	15.09.2023	10.500	551	2.529	0,23
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021	15.09.2023	11.000	598	2.739	0,24
							\$ 1.503	\$ 6.840	0,61

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020 %	25.10.2023	31.000	\$ (355)	\$ (2.790)	(0,25)
FAR	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	15.09.2023	52.500	(551)	(4.876)	(0,43)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	4.600	(30)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	4.600	(30)	(93)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	4.600	(32)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	4.600	(32)	(88)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	4.600	(32)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	4.600	(32)	(86)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	4.600	(32)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	4.600	(32)	(85)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	4.600	(32)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	4.600	(32)	(95)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	4.700	(32)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	4.700	(32)	(102)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	24.600	(89)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	24.600	(89)	(320)	(0,03)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	36.100	(126)	(3)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	36.100	(126)	(500)	(0,04)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	13.300	(41)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	13.300	(42)	(166)	(0,01)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	15.09.2023	55.000	(598)	(5.183)	(0,46)
							\$ (2.397)	\$ (14.397)	(1,28)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	UBS AG	(1,000) %	20.06.2024	\$ 200	\$ 13	\$ (13)	\$ 0	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 200	\$ (26)	\$ 22	\$ (4)	0,00
GLM	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2023	1.200	(88)	92	4	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(3)	5	2	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	2.300	(102)	102	0	0,00
					\$ (219)	\$ 221	\$ 2	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 2.200	\$ (9)	\$ 0	\$ (9)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	100	(4)	3	(1)	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.500	(3)	(3)	(6)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	300	(9)	8	(1)	0,00
					\$ (25)	\$ 8	\$ (17)	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, (ii) oder er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 1.039	\$ 689	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07.2023	\$ 459	AUD 702	8	0	8	0,00
	08.2023	690	1.039	2	0	2	0,00
BOA	07.2023	¥ 800	\$ 6	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN 62.112	3.374	0	(239)	(239)	(0,02)
	07.2023	PLN 9.887	2.400	0	(32)	(32)	0,00
	07.2023	\$ 1.564	AUD 2.401	34	0	34	0,00
	07.2023	1.129	£ 893	6	0	6	0,00
	07.2023	519	PLN 2.173	16	0	16	0,00
	08.2023	CNY 287	\$ 42	2	0	2	0,00
	08.2023	NZD 356	226	8	0	8	0,00
	08.2023	\$ 749	BRL 3.647	4	0	4	0,00
	08.2023	ZAR 97	\$ 5	0	0	0	0,00
	09.2023	TWD 886	29	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	AUD 743	492	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	€ 220.055	236.596	2	(3.485)	(3.483)	(0,31)
	07.2023	PEN 6.822	1.865	0	(17)	(17)	0,00
	07.2023	PLN 22.175	5.165	0	(288)	(288)	(0,02)
	07.2023	\$ 238.529	€ 217.701	2	(1.019)	(1.017)	(0,09)
	07.2023	1.339	£ 1.054	1	0	1	0,00
	07.2023	14.447	¥ 2.008.078	0	(553)	(553)	(0,05)
	07.2023	3.742	PEN 13.643	21	0	21	0,00
	08.2023	CNH 2.053	\$ 297	14	0	14	0,00
	08.2023	CNY 151	22	1	0	1	0,00
	08.2023	€ 216.580	237.640	1.028	0	1.028	0,09
	08.2023	TWD 443	15	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 492	AUD 743	2	0	2	0,00
	08.2023	44	CNH 307	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	889	ZAR 16.553	0	(17)	(17)	0,00
	09.2023	42	PEN 153	0	0	0	0,00
	BRC	09.2023	0	THB 5	0	0	0
07.2023		MYR 27	\$ 6	0	0	0	0,00
07.2023		PLN 1.430	342	0	(9)	(9)	0,00
07.2023		\$ 1.079	£ 867	23	0	23	0,00
08.2023		2.409	COP 10.264.091	19	0	19	0,00
08.2023		1.061	HUF 364.628	0	(7)	(7)	0,00
08.2023		1.084	ZAR 20.028	0	(28)	(28)	0,00
10.2023		MXN 112.225	\$ 5.990	0	(428)	(428)	(0,04)
07.2023		CAD 1.784	1.309	0	(39)	(39)	0,00
07.2023		CLP 5.783.983	7.147	0	(56)	(56)	(0,01)
CBK	07.2023	PEN 6.822	1.878	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	\$ 1.086	€ 1.004	9	0	9	0,00
	07.2023	2.286	PEN 8.474	51	0	51	0,01
	07.2023	4	PHP 225	0	0	0	0,00
	08.2023	CNY 14	\$ 2	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD 427	14	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 7.154	CLP 5.853.517	91	0	91	0,01
	08.2023	1.343	PEN 5.246	99	0	99	0,01
	09.2023	IDR 88.939	\$ 6	0	0	0	0,00
	07.2023	BRL 53.329	11.045	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	\$ 9.869	BRL 53.160	1.149	0	1.149	0,10
	07.2023	1.775	PLN 7.517	73	0	73	0,01
	08.2023	BRL 10.431	\$ 2.040	0	(112)	(112)	(0,01)
	09.2023	PEN 25.621	6.954	0	(72)	(72)	(0,01)
	09.2023	\$ 11.045	BRL 53.920	9	0	9	0,00
MBC	10.2023	2.530	MXN 44.410	10	0	10	0,00
	07.2023	CAD 987	\$ 740	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	€ 741	793	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	£ 66.391	82.183	0	(2.223)	(2.223)	(0,20)
	07.2023	PLN 57.869	13.366	0	(866)	(866)	(0,08)
	07.2023	\$ 550	€ 514	10	0	10	0,00
	08.2023	HUF 310.241	\$ 909	13	0	13	0,00
MYI	08.2023	\$ 638	CNH 4.382	0	(34)	(34)	0,00
	07.2023	PLN 1.262	\$ 310	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 204	€ 187	0	0	0	0,00
	07.2023	1.258	£ 997	9	0	9	0,00
	07.2023	1.233	¥ 178.000	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	1.065	PLN 4.465	33	0	33	0,00
	08.2023	TWD 477	\$ 16	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 6	TWD 183	0	0	0	0,00
	09.2023	THB 13.411	\$ 392	11	0	11	0,00
RBC	07.2023	\$ 3	MXN 55	0	0	0	0,00
	08.2023	7.469	129.443	17	0	17	0,00
SCX	07.2023	AUD 1.526	\$ 1.013	0	(3)	(3)	0,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Opportunities Fund (Fort.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	\$	1.346	AUD	2.060	\$ 25	0,00
	08.2023	CNH	2.418	\$	351	\$ 18	0,00
	08.2023	NZD	126		79	2	0,00
	08.2023	\$	1.014	AUD	1.526	3	0,00
	09.2023	THB	9.533	\$	276	5	0,00
	09.2023	TWD	740		24	1	0,00
	09.2023	\$	147	PEN	541	2	0,00
SSB	07.2023	PEN	7.397	\$	2.028	0	0,00
	07.2023	\$	7.211	CLP	5.792.275	2	0,00
	08.2023	CLP	5.809.004	\$	7.211	1	0,00
	08.2023	\$	2.025	PEN	7.397	10	0,00
	09.2023	BRL	3.661	\$	722	0	0,00
TOR	07.2023	AUD	1.878		1.240	0	0,00
	07.2023	\$	1.605	AUD	2.454	29	0,00
	07.2023		2.094	CAD	2.771	2	0,00
	07.2023		82.127	£	64.631	42	0,01
	08.2023	CAD	2.770	\$	2.094	1	0,00
	08.2023	£	64.631		82.145	0	0,00
	08.2023	\$	1.241	AUD	1.878	10	0,00
UAG	07.2023	AUD	2.993	\$	1.999	10	0,00
	07.2023	\$	368	AUD	562	6	0,00
	08.2023		2.000		2.993	4	0,00
	08.2023	ZAR	33.701	\$	1.755	1	0,00
						\$ 2.952	
						\$ (9.701)	
						\$ (6.749)	
							(0,60)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$	12.204	€	11.353	\$ 182	0,02
BPS	07.2023	€	11.365	€	12.453	54	0,00
	07.2023	\$	12.085	€	11.241	179	0,02
	08.2023		12.449		11.346	0	(0,01)
CBK	07.2023	€	9.565	\$	10.398	0	0,00
	07.2023	\$	269	€	248	1	0,00
	08.2023		10.291		9.452	0	0,00
MBC	07.2023	€	91	\$	98	0	0,00
	07.2023	\$	119	€	110	2	0,00
MYI	07.2023	€	5.661	\$	6.182	5	0,00
SCX	07.2023	\$	12.026	€	11.238	234	0,02
						\$ 693	
						\$ (94)	
						\$ 599	
							0,05

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	212	\$	269	\$ 0	0,00
BPS	07.2023		1.480		1.894	14	0,00
	07.2023	\$	270.851	£	218.978	7.547	0,67
BRC	07.2023	£	507	\$	635	0	0,00
CBK	07.2023		968		1.227	1	0,00
	07.2023	\$	5	£	4	0	0,00
MBC	07.2023	£	73	\$	94	1	0,00
	07.2023	\$	270.330	£	218.380	7.307	0,65
MYI	07.2023		270.897		217.962	6.209	0,56
TOR	07.2023	£	218.130	\$	277.177	0	(0,01)
	08.2023	\$	277.238	£	218.130	137	0,01
UAG	07.2023		95.805		75.739	486	0,04
						\$ 21.702	
						\$ (158)	
						\$ 21.544	
							1,92

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 7.822 0,70

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2053	\$ 55.800	\$ (45.584)	(4,07)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (45.584)	(4,07)
Summe Anlagen		\$ 1.200.912	107,09
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (79.535)	(7,09)
Nettovermögen		\$ 1.121.377	100,00



**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.  
 (b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.  
 (c) Nullkuponwertpapier.  
 (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
 (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
 (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
 (g) Mit dem Fonds verbunden.  
 (h) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,12 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 67	\$ 67	0,01
Deutsche Bank AG 3,729 %, fällig am 14.01.2032	11.01.2021 - 24.02.2021	2.202	1.665	0,15
		\$ 2.269	\$ 1.732	0,16

Barmittel in Höhe von 29.215 USD (31. Dezember 2022: 29.843 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 6.884 USD (31. Dezember 2022: 27.963 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.054.967	\$ 368	\$ 1.055.335
Investmentfonds	108.526	0	0	108.526
Pensionsgeschäfte	0	94.887	0	94.887
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.228	(13.480)	0	(12.252)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(45.584)	0	(45.584)
Summen	\$ 109.754	\$ 1.090.790	\$ 368	\$ 1.200.912

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.216.185	\$ 561	\$ 1.216.746
Investmentfonds	72.181	60.875	0	133.056
Pensionsgeschäfte	0	118.800	0	118.800
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	79	(54.248)	0	(54.169)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(94.108)	0	(94.108)
Summen	\$ 72.260	\$ 1.247.504	\$ 561	\$ 1.320.325

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 8	\$ 0	\$ 8	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(1.237)	1.040	(197)	(3.452)	3.430	(22)
BPS	3.426	(1.500)	1.926	(3.383)	3.100	(283)
BRC	(443)	270	(173)	(105)	30	(75)
CBK	148	0	148	287	(540)	(253)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(20)	0	(20)
FAR	(2.347)	2.270	(77)	(1.707)	1.460	(247)
GLM	(497)	580	83	(15.394)	15.157	(237)

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
GST	\$ (7)	\$ 0	\$ (7)	\$ (12)	\$ 22	\$ 10
MBC	4.186	(3.050)	1.136	(1.943)	1.280	(663)
MYC	(2.445)	2.370	(75)	(1.783)	1.490	(293)
MYI	6.264	(4.190)	2.074	510	(320)	190
RBC	17	0	17	(28)	0	(28)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	(25)	0	(25)
SAL	(6)	94	88	(102)	94	(8)
SCX	287	(280)	7	354	(460)	(106)
SSB	(27)	260	233	(2.629)	1.900	(729)
TOR	25	(20)	5	191	(750)	(559)
UAG	470	0	470	42	(20)	22

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	57,79	44,59
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	36,29	43,14
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,03	2,68
Investmentfonds	9,68	9,89
Pensionsgeschäfte	8,46	8,83
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,31	0,66
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(2,10)	(2,52)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,70	(2,17)
Leerverkaufte Wertpapiere	(4,07)	(6,99)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,94	2,57
Unternehmensanleihen und Wechsel	25,58	23,54
Kommunalanleihen und Wechsel	0,69	0,56
US-Regierungsbehörden	18,71	14,02
US-Schatzobligationen	17,36	14,38
Non-Agency-MBS	8,52	7,79
Forderungsbesicherte Wertpapiere	19,70	17,36
Staatsemissionen	1,07	2,15
Stammaktien	0,01	0,01
Vorzugswertpapiere	0,01	0,03
Kurzfristige Instrumente	1,52	8,00
Investmentfonds	9,68	9,89
Pensionsgeschäfte	8,46	8,83
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,36	0,69
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,05)	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,25)	(0,15)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(1,85)	(2,37)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,61	0,75
Verkaufsoptionen	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes		
Zinsswapoptionen	(1,28)	(2,34)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	k. A.	0,08
Devisenterminkontrakte	(0,60)	(0,77)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,97	0,12
Leerverkaufte Wertpapiere	(4,07)	(6,99)
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,09)	1,89
Nettovermögen	100,00	100,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Opportunities ESG Fund (Fort.)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt/ variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500 %	20.09.2033	£ 150	\$ (8)	(0,18)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	100	6	0,12
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,060	28.10.2023	CAD 600	0	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	500	(4)	(0,07)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	€ 100	0	0,01
					<b>\$ (6)</b>	<b>(0,12)</b>
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					<b>\$ (6)</b>	<b>(0,12)</b>

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	08.2023	\$ 14	AUD 21	\$ 0	\$ 0	\$ 0	(0,01)	
	08.2023	€ 3	€ 3	0	0	0	0,00	
BRC	08.2023	£ 13	\$ 16	0	0	0	(0,01)	
	08.2023	\$ 15	¥ 1.938	0	(1)	(1)	(0,02)	
CBK	08.2023	CAD 14	\$ 10	0	0	0	0,00	
	08.2023	€ 3	€ 3	0	0	0	0,00	
	08.2023	\$ 2	¥ 319	0	0	0	0,00	
GLM	08.2023	CAD 4	\$ 3	0	0	0	0,00	
MBC	08.2023	€ 620	€ 684	6	0	6	0,14	
MYI	08.2023	\$ 31	¥ 4.165	0	(3)	(3)	(0,05)	
RYL	08.2023	£ 2	\$ 3	0	0	0	0,00	
UAG	08.2023	7	9	0	0	0	0,00	
					<b>\$ 6</b>	<b>\$ (4)</b>	<b>\$ 2</b>	<b>0,05</b>

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Institutional EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2023	\$ 84	€ 78	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,03	
CBK	07.2023	€ 79	\$ 86	0	0	0	(0,01)	
	08.2023	\$ 85	€ 78	0	0	0	0,01	
MBC	07.2023	84	79	2	0	2	0,03	
SCX	07.2023	84	79	2	0	2	0,03	
					<b>\$ 5</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 5</b>	<b>0,09</b>

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
MBC	07.2023	\$ 84	£ 68	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,05	
MYI	07.2023	84	68	2	0	2	0,04	
UAG	07.2023	86	69	2	0	2	0,03	
					<b>\$ 6</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 6</b>	<b>0,12</b>

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

**\$ 13** **0,26**

Summe Anlagen

**\$ 5.392** **107,47**

Sonstige Aktiva und Passiva

**\$ (375)** **(7,47)**

Nettovermögen

**\$ 5.017** **100,00**

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Wertpapier per Emissionstermin.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

Barmittel in Höhe von 50 USD (31. Dezember 2022: 31 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.400	\$ 0	\$ 5.400
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	5	(13)	0	(8)
Summen	\$ 5	\$ 5.387	\$ 0	\$ 5.392

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.070	\$ 0	\$ 5.070
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(4)	(41)	0	(45)
Summen	\$ (4)	\$ 5.029	\$ 0	\$ 5.025

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 1	\$ 0	\$ 1	\$ 4	\$ 0	\$ 4
BRC	(1)	0	(1)	(8)	0	(8)
CBK	k. A.	k. A.	k. A.	(8)	0	(8)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
MBC	10	0	10	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(1)	0	(1)	(11)	0	(11)
SCX	2	0	2	(16)	0	(16)
UAG	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	88,08	32,23
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	19,55	70,65
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,30)	(0,18)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,12)	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate	0,26	(0,75)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,40	1,53
Unternehmensanleihen und Wechsel	38,47	34,48
US-Regierungsbehörden	13,14	5,49
Forderungsbesicherte Wertpapiere	2,13	2,12
Kurzfristige Instrumente	53,49	59,26
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,30)	(0,18)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,12)	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	0,05	(0,87)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,21	0,12
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,47)	(1,97)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
<b>KANADA STAMMAKTIE</b>								<b>U.S. TREASURY BILLS</b>				
Enbridge, Inc.	29.800	\$ 1.109	1,14	EQT Corp.	60.700	\$ 2.497	2,57	5,156 % fällig am 03.08.2023 (a)(b)	\$ 1.800	\$ 1.792	1,85	
Pembina Pipeline Corp.	75.700	2.383	2,45	Equitrans Midstream Corp.	105.200	1.006	1,04	5,177 % fällig am 15.08.2023 (a)(b)	28.400	28.225	29,07	
TC Energy Corp.	29.720	1.202	1,24	Hess Midstream LP 'A'	22.700	696	0,72	5,239 % fällig am 07.09.2023 (a)(b)	1.800	1.783	1,84	
Summe Kanada		4.694	4,83	Kinder Morgan, Inc.	125.600	2.163	2,23	5,242 % fällig am 20.07.2023 (a)(b)	3.100	3.093	3,18	
<b>USA STAMMAKTIE ENERGIE</b>								<b>Summe kurzfristige Instrumente</b>				
Antero Midstream Corp.	107.900	1.252	1,29	Marathon Oil Corp.	58.500	1.347	1,39	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>				
Cheniere Energy, Inc.	31.133	4.743	4,88	Occidental Petroleum Corp.	26.066	1.533	1,58	<b>\$ 86.230 88,81</b>				
Chesapeake Energy Corp.	34.400	2.879	2,96	ONEOK, Inc.	55.730	3.440	3,54	<b>AKTIEN</b>				
ConocoPhillips	16.700	1.730	1,78	Pioneer Natural Resources Co.	11.200	2.320	2,39	<b>INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				
Devon Energy Corp.	30.200	1.460	1,50	Targa Resources Corp.	67.700	5.152	5,31	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)</b>				
DTE Midstream LLC	84.900	4.208	4,33	Williams Cos., Inc.	148.100	4.832	4,98	939.277	9,353	9,63		
EnLink Midstream LLC	225.400	2.389	2,46	Summe USA		44.643	45,98	<b>Summe Investmentfonds</b>				
EOG Resources, Inc.	8.700	996	1,03					<b>\$ 9.353 9,63</b>				
								<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				
								<b>Federal Home Loan Bank 5,100 % fällig am 25.08.2023</b>				
								<b>\$ 2.000 2,000 2,06</b>				

## PENSIONS-GESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 840	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	\$ (857)	\$ 840	\$ 840	0,87
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (857)</b>	<b>\$ 840</b>	<b>\$ 840</b>	<b>0,87</b>

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	AMZX Index	1.179	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 1.851	11.10.2023	\$ 0	\$ 69	\$ 69	0,07

## TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	Energy Transfer LP	241.320	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 3.074	11.10.2023	\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	(0,01)
	Erhalt	MPLX LP	212.600	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	7.088	15.11.2023	0	96	96	0,10
	Erhalt	Plains All American Pipeline LP	186.056	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.404	15.11.2023	0	209	209	0,22
	Erhalt	Sunoco LP	60.200	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.588	15.11.2023	0	23	23	0,03
	Erhalt	Energy Transfer LP	242.369	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.005	17.01.2024	0	59	59	0,06
	Erhalt	Enterprise Products Partners LP	260.070	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	6.588	17.01.2024	0	236	236	0,24
	Erhalt	Western Midstream Partners LP	121.461	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.066	17.01.2024	0	142	142	0,15
	Erhalt	Energy Transfer LP	205.784	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.622	11.10.2023	0	(9)	(9)	(0,01)
FAR	Erhalt	Crestwood Equity Partners LP	56.900	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	1.460	06.09.2023	0	46	46	0,05
	Erhalt	Crestwood Equity Partners LP	41.700	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.070	06.09.2023	0	30	30	0,03
JPM	Erhalt	Crestwood Equity Partners LP	13.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	334	06.09.2023	0	9	9	0,01
MYI	Erhalt	Enterprise Products Partners LP	25.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	656	11.10.2023	0	3	3	0,00
	Erhalt	Western Midstream Partners LP	77.089	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.032	11.10.2023	0	12	12	0,01
	Erhalt	Western Midstream Partners LP	68.832	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.737	15.11.2023	0	80	80	0,08

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variable Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
	Erhalt	Plains All American Pipeline LP	426.400	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 5.509	17.01.2024	\$ 0	\$ 478	\$ 478	0,49
							\$ 0	\$ 1.405	\$ 1.405	1,45

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CAD 8.737	\$ 6.421	\$ 0	\$ (182)	\$ (182)	(0,19)
BPS	08.2023	\$ 163	€ 149	0	0	0	0,00
BRC	08.2023	€ 110	\$ 120	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	\$ 1.467	CAD 1.977	27	0	27	0,03
	07.2023	110	£ 89	3	0	3	0,00
MYI	07.2023	49	€ 45	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	£ 89	\$ 113	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 5.109	CAD 6.760	4	(4)	0	0,00
	08.2023	CAD 6.758	\$ 5.109	4	(4)	0	0,00
	08.2023	\$ 113	£ 89	0	0	0	0,00
				\$ 38	\$ (190)	\$ (152)	(0,16)

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Institutional EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 995	\$ 1.076	\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	(0,01)
	07.2023	\$ 14.006	€ 13.032	213	0	213	0,22
BPS	07.2023	€ 12.765	\$ 13.986	59	0	59	0,06
	07.2023	\$ 14.010	€ 13.032	208	0	208	0,21
	08.2023	13.653	12.443	0	(60)	(60)	(0,06)
CBK	07.2023	€ 13.530	\$ 14.710	3	(55)	(52)	(0,05)
	08.2023	\$ 12.357	€ 11.349	43	0	43	0,04
JPM	07.2023	€ 12.553	\$ 13.707	11	0	11	0,01
	08.2023	\$ 13.726	€ 12.553	0	(12)	(12)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 789	\$ 852	2	(10)	(8)	(0,01)
	07.2023	\$ 1.650	€ 1.533	22	0	22	0,02
SOG	07.2023	14.020	13.032	199	0	199	0,21
				\$ 760	\$ (146)	\$ 614	0,63

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 40	\$ 50	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2023	\$ 571	£ 462	16	0	16	0,02
CBK	07.2023	58	46	1	0	1	0,00
JPM	07.2023	£ 479	\$ 605	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	\$ 605	£ 479	3	0	3	0,00
MBC	07.2023	£ 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 570	£ 460	15	0	15	0,02
MYI	07.2023	572	460	13	0	13	0,01
TOR	07.2023	£ 476	\$ 604	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 604	£ 476	0	0	0	0,00
				\$ 48	\$ (3)	\$ 45	0,05

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 1.981 2,04

Summe Anlagen

\$ 98.404 101,35

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (1.313) (1,35)

Nettovermögen

\$ 97.091 100,00

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 2.870 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.



Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 49.337	\$ 36.893	\$ 0	\$ 86.230
Investmentfonds	9.353	0	0	9.353
Pensionsgeschäfte	0	840	0	840
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	1.981	0	1.981
<b>Summen</b>	<b>\$ 58.690</b>	<b>\$ 39.714</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 98.404</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 64.970	\$ 41.989	\$ 0	\$ 106.959
Investmentfonds	11.833	0	0	11.833
Pensionsgeschäfte	0	811	0	811
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	1.210	0	1.210
<b>Summen</b>	<b>\$ 76.803</b>	<b>\$ 44.010</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 120.813</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 778	\$ (820)	\$ (42)	\$ (129)	\$ 1.610	\$ 1.481
BPS	292	(320)	(28)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(17)	0	(17)	488	(370)	118
FAR	76	0	76	(18)	550	532
JPM	8	0	8	18	0	18
MBC	59	0	59	305	(310)	(5)
MYI	586	(340)	246	17	710	727
SOG	199	(270)	(71)	466	(270)	196
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	63	0	63

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	86,75	54,07
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	2,06	34,95
Investmentfonds	9,63	9,85
Pensionsgeschäfte	0,87	0,68
Freiverkehrsfinanzderivate	2,04	1,01

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kanada	4,83	9,07
USA	45,98	45,00
Kurzfristige Instrumente	38,00	34,95
Investmentfonds	9,63	9,85
Pensionsgeschäfte	0,87	0,68
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	0,07	(0,01)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	1,45	(0,10)
Devisenterminkontrakte	(0,16)	0,08
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,68	1,04
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,35)	(0,56)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				<b>BANKEN UND FINANZEN</b>			
SLM Student Loan Trust 4,076 % fällig am 15.12.2033	€ 643	\$ 647	0,10	Freddie Mac 0,000 % fällig am 15.12.2032 - 15.12.2048	3,003	2,030	0,33	1,292 % fällig am 16.02.2040 (a)	\$ 1.679	98	0,02
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>US-SCHATZBLIGATIONEN</b>			
Times Square Hotel Trust 8,528 % fällig am 01.08.2026	\$ 92	91	0,02	0,000 % fällig am 01.02.2035 - 15.08.2057 (b)(d)	3,479	2,573	0,41	1,554 % fällig am 20.05.2041 (a)	1.357	74	0,01
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		738	0,12	0,000 % fällig am 15.01.2038 - 15.08.2047 (a)	21.288	1.121	0,18	2,500 % fällig am 20.09.2027 (a)	3.118	118	0,02
				0,505 % fällig am 25.08.2024 (a)	55.718	225	0,04	3,000 % fällig am 20.12.2047 - 20.04.2050 (h)	7.245	6.548	1,06
				0,657 % fällig am 15.02.2041 (a)	276	20	0,00	3,000 % fällig am 20.12.2049 - 20.02.2052 (a)	12.836	1.411	0,23
				0,697 % fällig am 15.09.2043 (a)	747	67	0,01	3,000 % fällig am 20.10.2051	211	189	0,03
				0,757 % fällig am 15.07.2041 (a)	2.514	180	0,03	3,250 % fällig am 20.01.2047 (h)	441	392	0,06
				0,807 % fällig am 15.10.2041 - 15.08.2042 (a)	10.746	1.075	0,17	3,500 % fällig am 20.09.2029 - 20.09.2046 (a)	1.344	196	0,03
				0,857 % fällig am 15.08.2041 - 15.09.2044 (a)	7.495	694	0,11	3,500 % fällig am 20.03.2042 - 20.11.2052	2.191	1.882	0,30
				0,900 % fällig am 25.11.2049 - 25.06.2050 (a)	26.412	2.720	0,44	3,500 % fällig am 20.06.2042 - 20.12.2052 (h)	17.799	16.533	2,67
				0,907 % fällig am 15.02.2044 (a)	125	6	0,00	4,000 % fällig am 15.04.2047	849	818	0,13
				0,950 % fällig am 25.06.2050 (a)	16.878	1.898	0,31	4,000 % fällig am 15.06.2047 - 15.08.2048 (h)	1.620	1.555	0,25
				0,957 % fällig am 15.08.2025 - 15.10.2048 (a)	12.392	1.374	0,22	4,500 % fällig am 20.05.2043 - 20.09.2047 (a)	2.716	525	0,08
				1,000 % fällig am 25.05.2050 (a)	2.990	334	0,05	4,500 % fällig am 20.04.2048 - 20.02.2049	696	678	0,11
				1,007 % fällig am 15.03.2048 (a)	3.247	380	0,06	4,500 % fällig am 20.05.2048 (h)	1.367	1.323	0,21
				1,057 % fällig am 15.09.2042 (a)	934	62	0,01	5,000 % fällig am 20.09.2040 (a)	447	0	0,00
				1,107 % fällig am 15.10.2036 (a)	1.074	70	0,01	5,000 % fällig am 20.11.2048 (h)	946	938	0,15
				1,277 % fällig am 15.11.2037 (a)	220	15	0,00	5,352 % fällig am 20.03.2058 (h)	136	135	0,02
				1,297 % fällig am 15.01.2042 (a)	5.810	614	0,10	6,000 % fällig am 20.02.2047 (h)	15	16	0,00
				1,407 % fällig am 15.11.2041 (a)	140	6	0,00	6,150 % fällig am 20.06.2073	600	601	0,10
				1,457 % fällig am 15.07.2026 (a)	502	8	0,00	<b>Ginnie Mae, TBA</b>			
				1,507 % fällig am 15.09.2026 - 15.12.2042 (a)	1.782	173	0,03	3,000 % fällig am 01.08.2053	10.700	9.571	1,54
				1,537 % fällig am 15.09.2039 (a)	2.505	230	0,04	3,500 % fällig am 01.08.2053	3.950	3.650	0,59
				1,657 % fällig am 15.03.2038 (a)	462	35	0,01	4,500 % fällig am 01.08.2053	6.620	6.393	1,03
				2,000 % fällig am 25.11.2050 - 15.06.2052 (a)	22.646	2.711	0,44	<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>			
				2,500 % fällig am 15.11.2027 - 15.10.2052 (a)	54.677	7.156	1,15	2,500 % fällig am 01.01.2033 - 01.09.2051 (h)	18.221	15.660	2,52
				2,532 % fällig am 15.09.2032	268	251	0,04	3,000 % fällig am 01.01.2038 - 01.07.2052 (h)	57.296	51.324	8,27
				2,707 % fällig am 15.12.2031 (a)	51	5	0,00	3,000 % fällig am 01.12.2049 - 01.03.2051	776	690	0,11
				2,920 % fällig am 01.09.2036 (h)	1.328	1.096	0,18	3,500 % fällig am 01.02.2030	106	101	0,02
				3,000 % fällig am 15.03.2027 - 25.08.2050 (a)	91.849	13.349	2,15	3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.06.2052 (h)	44.146	41.192	6,64
				3,000 % fällig am 15.12.2046 - 15.04.2049 (a)	964	140	0,02	4,000 % fällig am 01.02.2037 - 01.08.2049 (h)	23.415	22.458	3,62
				3,314 % fällig am 15.12.2027 (a)	505	24	0,00	4,000 % fällig am 01.09.2042 - 01.05.2053	95.196	89.410	14,41
				3,500 % fällig am 15.03.2029 - 25.03.2052 (a)	31.718	5.047	0,81	4,500 % fällig am 01.12.2038 - 01.03.2053 (h)	150.451	144.840	23,35
				3,500 % fällig am 01.01.2038 - 01.11.2046 (h)	878	824	0,13	4,500 % fällig am 01.12.2044 - 01.04.2053	13.982	13.451	2,17
				3,500 % fällig am 01.12.2046	54	51	0,01	5,000 % fällig am 01.06.2048 - 01.03.2049 (h)	803	801	0,13
				3,554 % fällig am 25.09.2024	6.100	5.536	0,89	5,000 % fällig am 01.06.2053	114.926	112.676	18,16
				4,000 % fällig am 15.10.2041 - 25.08.2050 (a)	24.808	5.338	0,86	6,000 % fällig am 01.05.2053	10.822	10.922	1,76
				4,000 % fällig am 01.03.2046 - 01.03.2048 (h)	10.209	9.774	1,58	<b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b>			
				4,000 % fällig am 01.04.2048	135	129	0,02	3,500 % fällig am 01.07.2038 - 01.07.2053	3.400	3.197	0,52
				4,500 % fällig am 15.02.2037 - 25.10.2051 (a)	7.102	1.081	0,17	4,500 % fällig am 01.07.2038	23.500	23.043	3,71
				4,500 % fällig am 01.02.2048 (h)	534	523	0,08	5,000 % fällig am 01.07.2038 - 01.07.2053	14.500	14.306	2,31
				4,660 % fällig am 25.01.2031	2.200	2.175	0,35	5,500 % fällig am 01.07.2053	66.200	65.876	10,62
				5,000 % fällig am 15.05.2025 - 25.05.2048 (a)	1.770	293	0,05	6,000 % fällig am 01.08.2053	108.600	109.521	17,66
				5,000 % fällig am 01.03.2049 (h)	2.659	2.653	0,43	6,500 % fällig am 01.07.2053	74.400	75.969	12,25
				5,220 % fällig am 25.12.2036	7.074	5.619	0,91			1.024.285	165,12
				<b>Ginnie Mae</b>				<b>US-SCHATZBLIGATIONEN</b>			
				0,000 % fällig am 20.08.2033 - 20.01.2044 (b)(d)	1.898	1.700	0,27	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)</b>			
				0,000 % fällig am 20.05.2040 - 20.08.2047 (a)	57.685	1.873	0,30	0,125 % fällig am 15.07.2024	128	124	0,02
				0,000 % fällig am 20.11.2045	534	344	0,06	0,125 % fällig am 15.10.2024 (h)	946	912	0,15
				0,404 % fällig am 20.09.2043 (a)	1.053	15	0,00	0,500 % fällig am 15.04.2024 (h)	1.118	1.092	0,17
				0,563 % fällig am 20.09.2045 (a)	1.979	133	0,02	0,625 % fällig am 15.01.2024 (h)	4.836	4.754	0,77
				0,892 % fällig am 16.04.2040 - 16.08.2042 (a)	2.836	214	0,03			6.882	1,11
				0,943 % fällig am 20.12.2048 - 20.08.2049 (a)	7.502	545	0,09	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
				0,954 % fällig am 20.01.2035 (a)	1.897	55	0,01	<b>1166 Avenue of the Americas Commercial Mortgage Trust</b>			
				1,043 % fällig am 20.03.2035 - 20.09.2048 (a)	864	89	0,01	5,690 % fällig am 13.10.2037	2.000	1.582	0,25
				1,054 % fällig am 20.12.2047 (a)	1.159	118	0,02	<b>225 Liberty Street Trust</b>			
				1,093 % fällig am 20.07.2044 (a)	2.278	322	0,05	4,803 % fällig am 10.02.2036	5.000	3.965	0,64
				1,242 % fällig am 16.01.2038 (a)	19	0	0,00	<b>American Home Mortgage Assets Trust</b>			
								5,275 % fällig am 25.03.2047	2.102	1.868	0,30



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^	\$ 2.096	\$ 2.103	0,34	Long Beach Mortgage Loan Trust				Sapphire Aviation Finance Ltd.	\$ 5.392	\$ 4.493	0,72
5,370 % fällig am 25.09.2047 ^	932	891	0,14	5,750 % fällig am 25.02.2036	\$ 142	\$ 117	0,02	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5,633 % fällig am 25.06.2035	92	78	0,01	6,170 % fällig am 25.08.2033	112	112	0,02	5,270 % fällig am 25.09.2036	2.201	1.499	0,24
5,850 % fällig am 25.03.2036 ^	1.871	1.615	0,26	Man GLG Euro CLO DAC				SoFi Professional Loan Program LLC			
5,859 % fällig am 25.10.2046 ^	12	12	0,00	1,680 % fällig am 15.12.2031	€ 4.700	4.444	0,72	2,650 % fällig am 25.09.2040	43	41	0,01
6,125 % fällig am 25.01.2036	67	65	0,01	1,700 % fällig am 15.10.2030	5.000	4.829	0,78	Soundview Home Loan Trust			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				MAPS Ltd.				5,320 % fällig am 25.07.2037	5.834	4.792	0,77
6,125 % fällig am 25.10.2034	75	73	0,01	4,212 % fällig am 15.05.2043	\$ 1.938	1.731	0,28	6,050 % fällig am 25.10.2037	6.827	5.388	0,87
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				MASTR Asset-Backed Securities Trust				6,140 % fällig am 25.06.2035	683	646	0,10
2,817 % fällig am 25.05.2036	2.105	1.384	0,22	5,730 % fällig am 25.12.2035	160	159	0,03	6,450 % fällig am 25.10.2037	5.465	4.049	0,65
3,289 % fällig am 25.03.2034	276	276	0,05	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				Structured Asset Investment Loan Trust			
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust				6,230 % fällig am 25.10.2035	686	674	0,11	5,750 % fällig am 25.04.2036	11.187	6.020	0,97
3,535 % fällig am 25.02.2037	2.974	1.822	0,29	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
First Franklin Mortgage Loan Trust				3,580 % fällig am 25.01.2035	792	685	0,11	5,280 % fällig am 25.05.2036	312	300	0,05
5,810 % fällig am 25.01.2036	399	392	0,06	5,290 % fällig am 25.10.2036	1.017	443	0,07	6,275 % fällig am 25.04.2035	88	87	0,01
Fremont Home Loan Trust				5,400 % fällig am 25.07.2036	9.734	8.390	1,35	Taberna Preferred Funding Ltd.			
5,430 % fällig am 25.02.2037	5.972	4.602	0,74	5,450 % fällig am 25.07.2036	3.443	1.320	0,21	5,666 % fällig am 05.05.2038	3.739	3.515	0,57
5,630 % fällig am 25.08.2036	4.084	1.370	0,22	5,650 % fällig am 25.07.2036	3.443	1.330	0,21	5,693 % fällig am 05.07.2035	233	207	0,03
6,080 % fällig am 25.07.2035	4.000	3.082	0,50	5,720 % fällig am 25.12.2035	0	0	0,00	Terwin Mortgage Trust			
Goodgreen Trust				5,750 % fällig am 25.12.2035	0	0	0,00	6,095 % fällig am 25.06.2036	200	193	0,03
3,930 % fällig am 15.10.2053	1.977	1.761	0,28	Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.			
GSAA Home Equity Trust				5,730 % fällig am 25.01.2036	1.854	1.774	0,29	4,147 % fällig am 15.09.2038	6.836	5.849	0,94
5,610 % fällig am 25.04.2047	3.767	1.849	0,30	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
5,870 % fällig am 25.10.2035	1.950	1.702	0,27	5,250 % fällig am 25.04.2037	141	74	0,01	7,080 % fällig am 20.09.2039	2.363	2.257	0,36
GSAMP Trust				Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
5,420 % fällig am 25.03.2047	694	641	0,10	5,450 % fällig am 25.07.2036	3.566	1.453	0,23	5,570 % fällig am 25.03.2037	1.146	1.118	0,18
Harley Marine Financing LLC				National Collegiate Student Loan Trust							
6,682 % fällig am 15.05.2043	1.263	1.176	0,19	5,460 % fällig am 25.05.2032	2.236	2.124	0,34				
Harvest CLO DAC				Option One Mortgage Loan Trust							
1,040 % fällig am 15.07.2031	€ 800	796	0,13	5,290 % fällig am 25.03.2037	4.936	4.432	0,72				
Home Equity Asset Trust				Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates							
3,883 % fällig am 25.02.2036	\$ 949	912	0,15	6,725 % fällig am 25.02.2035	335	324	0,05				
5,470 % fällig am 25.08.2036	695	690	0,11	6,800 % fällig am 25.12.2034	238	245	0,04				
5,630 % fällig am 25.08.2037	564	556	0,09	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust							
6,440 % fällig am 25.08.2033	306	290	0,05	5,645 % fällig am 25.07.2036	2.407	2.252	0,36				
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				5,690 % fällig am 25.05.2036 ^	379	350	0,06				
5,390 % fällig am 25.04.2037	6.643	4.336	0,70	Renaissance Home Equity Loan Trust							
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				5,608 % fällig am 25.05.2036	5.982	2.898	0,47				
3,967 % fällig am 25.11.2036	194	167	0,03	5,746 % fällig am 25.05.2036	1.362	675	0,11				
5,270 % fällig am 25.12.2036	5.952	3.139	0,51	Residential Asset Mortgage Products Trust							
Jubilee CLO DAC				5,690 % fällig am 25.02.2036	200	188	0,03				
3,827 % fällig am 15.04.2031	€ 400	426	0,07	Residential Asset Securities Corp. Trust							
Laurelin DAC				4,906 % fällig am 25.06.2034	703	680	0,11				
1,800 % fällig am 20.10.2031	3.500	3.292	0,53	5,585 % fällig am 25.06.2036	1.400	1.335	0,22				
Lehman XS Trust				6,095 % fällig am 25.05.2035	38	37	0,01				
5,570 % fällig am 25.06.2046	\$ 3.169	2.899	0,47	6,185 % fällig am 25.08.2035	2.131	2.010	0,32				

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
U.S. TREASURY BILLS			
5,207 % fällig am			
10.08.2023 (d)(e)	4.800	4.774	0,77
Summe kurzfristige Instrumente		4.774	0,77
Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.421.861		229,21
AKTIEN			
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc -			
PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	2.399	24	0,00
Summe Investmentfonds	\$ 24		0,00

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 241	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (246)	\$ 241	\$ 241	0,04
	2,400	30.06.2023	03.07.2023	3.767	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(3.842)	3.767	3.767	0,61
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (4.088)	\$ 4.008	\$ 4.008	0,65

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	62	\$ (40)	(0,01)
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	89	62	0,01
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	54	(12)	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2023	27	9	0,00
30-Day Federal Fund February Futures	Short	02.2024	45	133	0,02
30-Day Federal Fund November Futures	Long	11.2023	45	(90)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	155	283	0,05
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	27	56	0,01

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Mortgage Opportunities Fund (Fort.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	135	\$ (256)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	174	363	0,06
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	27	(53)	(0,01)
				<b>\$ 455</b>	<b>0,07</b>

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	159	\$ (69)	\$ (60)	(0,01)
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	159	(56)	(8)	0,00
				<b>\$ (125)</b>	<b>\$ (68)</b>	<b>(0,01)</b>
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					<b>\$ 387</b>	<b>0,06</b>

#### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 400	\$ 36	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,827	03.07.2028	\$ 85.485	(7.951)	(1,28)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,998	09.03.2025	31.400	1.572	0,25
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,999	03.07.2053	17.445	3.883	0,63
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,034	02.03.2025	57.500	2.902	0,47
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	35.300	1.188	0,19
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	3.100	(119)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	35.100	703	0,11
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,260	08.06.2033	3.300	50	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2026	8.600	218	0,03
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	10.300	26	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,505	08.03.2033	900	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,510	08.03.2033	2.500	5	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,513	08.03.2030	12.000	116	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,635	08.03.2030	5.400	10	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,500	21.06.2024	300.400	1.412	0,23
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	€ 2.400	1.045	0,17
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	13.100	(116)	(0,02)
					<b>\$ 4.978</b>	<b>0,80</b>
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					<b>\$ 4.978</b>	<b>0,80</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500 %	18.09.2023	88.600	\$ 198	\$ 108	0,02
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,010	23.01.2024	1.200	1	0	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,500	24.01.2024	1.000	3	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	05.02.2024	76.000	509	1.732	0,28
BRC	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,800	20.12.2023	5.300	107	30	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	20.12.2023	15.800	319	300	0,05
CBK	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	27.12.2024	28.400	119	120	0,02
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,800	20.12.2023	5.200	107	29	0,00
DUB	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	20.12.2023	15.800	319	300	0,05
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	13.900	79	105	0,02
DUB	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	09.02.2024	24.700	179	568	0,09
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	20.02.2024	61.000	530	1.419	0,23
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,100	01.02.2024	30.000	68	255	0,04
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	16.12.2024	39.000	46	57	0,01
DUB	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,875	03.01.2024	1.400	38	12	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,625	03.01.2024	1.400	38	24	0,00
DUB	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,040	11.01.2024	11.100	106	15	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,040	11.01.2024	11.100	106	94	0,02
DUB	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,995	16.01.2024	10.400	101	13	0,00



Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,995 %	16.01.2024	10.400	\$ 101	\$ 97	0,02
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,016	23.01.2024	2.000	3	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	07.02.2024	77.500	554	1.776	0,29
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,953	21.02.2024	2.300	7	4	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	28.02.2024	35.500	288	837	0,13
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	04.03.2024	35.500	259	841	0,14
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	18.09.2023	85.600	188	105	0,02
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	20.000	107	151	0,02
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,000	26.10.2023	2.200	66	13	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	03.05.2024	14.800	322	126	0,02
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	03.05.2024	14.800	322	579	0,09
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,655	12.12.2023	21.200	462	83	0,01
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,405	12.12.2023	21.200	462	495	0,08
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	16.12.2024	14.600	61	60	0,01
JPM MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	14.06.2024	33.500	52	89	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	16.12.2024	16.800	28	39	0,01
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,433	27.02.2024	2.300	17	11	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,285	04.03.2024	8.500	160	156	0,03
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,985	04.03.2024	8.500	160	93	0,02
							\$ 6.592	\$ 10.736	1,73

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens	
JPM	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2053	\$ 116,000	06.07.2023	200.000	\$ 8	\$ 0	0,00	
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2053	115,000	07.08.2023	15.000	1	0	0,00	
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2053	116,000	07.08.2023	20.000	1	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2053	70,000	07.09.2023	10.700	0	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2053	72,000	07.08.2023	35.000	1	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.09.2053	72,000	07.09.2023	5.000	0	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2053	72,000	06.07.2023	100.000	4	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	72,000	07.08.2023	90.000	2	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2053	74,000	07.08.2023	13.000	1	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.07.2053	76,000	06.07.2023	75.000	3	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.08.2053	75,000	07.08.2023	24.000	1	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.08.2053	77,000	07.08.2023	30.000	1	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.09.2053	76,000	07.09.2023	5.000	0	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,500 % fällig am 01.08.2053	77,000	07.08.2023	15.000	1	0	0,00	
	SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.07.2053	98,766	06.07.2023	3.000	4	0	0,00
		Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.09.2053	97,898	07.09.2023	12.500	39	45	0,01
						\$ 67	\$ 45	0,01

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,750 %	18.09.2023	44.300	\$ (78)	\$ (24)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	6,000	18.09.2023	44.300	(66)	(8)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	5.600	(37)	(14)	0,00
CBK	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	5.600	(37)	(4)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,740	06.07.2023	1.500	(5)	(3)	0,00
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,600	01.02.2024	30.000	(33)	(157)	(0,03)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,750	18.09.2023	42.800	(75)	(23)	0,00
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	6,000	18.09.2023	42.800	(62)	(8)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,043	03.08.2023	14.800	(185)	(5)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,043	03.08.2023	14.800	(185)	(544)	(0,09)
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,045	07.09.2023	9.800	(39)	(39)	(0,01)
							\$ (802)	\$ (829)	(0,14)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	\$ 93,984	06.07.2023	4.000	\$ (10)	\$ (14)	0,00
JPM	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	95,281	06.07.2023	6.000	(22)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2053	94,172	07.08.2023	15.000	(173)	(139)	(0,02)
MSC	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	93,281	06.07.2023	5.000	(20)	(5)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	93,859	06.07.2023	3.500	(7)	(10)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	94,000	06.07.2023	3.500	(7)	(13)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	95,672	07.08.2023	10.000	(60)	(51)	(0,01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	95,875	07.08.2023	2.000	(12)	(12)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	97,672	07.08.2023	10.000	(55)	(18)	(0,01)
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	97,875	07.08.2023	2.000	(11)	(3)	0,00
						\$ (377)	\$ (266)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Mortgage Opportunities Fund (Fort.)

### DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	£ 498	\$ 618	\$ 0	\$ (15)	\$ (15)	0,00
CBK	07.2023	€ 16.338	\$ 17.532	0	(293)	(293)	(0,05)
	07.2023	\$ 496	£ 388	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023	€ 211	\$ 226	0	(5)	(5)	0,00
MYI	07.2023	95	103	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 24	£ 19	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	£ 64.660	\$ 80.576	0	(1.630)	(1.630)	(0,26)
				\$ 0	\$ (1.945)	\$ (1.945)	(0,31)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 5.840	CAD 7.946	\$ 165	\$ 0	\$ 165	0,03
BPS	07.2023	CAD 174	\$ 131	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	\$ 5.829	CAD 7.943	174	0	174	0,03
GLM	07.2023	34	46	1	0	1	0,00
MBC	07.2023	133	178	2	0	2	0,00
SCX	07.2023	5.856	7.953	154	0	154	0,02
				\$ 496	\$ 0	\$ 496	0,08

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF 896	\$ 1.002	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 1.217	CHF 1.101	13	0	13	0,00
	08.2023	1.002	893	0	0	0	0,00
CLY	07.2023	CHF 473	\$ 527	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	\$ 527	CHF 472	2	0	2	0,00
MBC	07.2023	CHF 18	\$ 20	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 273	CHF 245	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	CHF 11	\$ 12	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 51	CHF 45	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	CHF 40	\$ 45	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	\$ 912	CHF 820	4	0	4	0,00
UAG	07.2023	CHF 980	\$ 1.094	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 822	CHF 739	4	0	4	0,00
	08.2023	1.025	917	2	0	2	0,00
				\$ 26	\$ (4)	\$ 22	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 51.657	€ 48.065	\$ 783	\$ 0	\$ 783	0,12
BPS	07.2023	€ 48.723	\$ 53.383	226	0	226	0,04
	07.2023	\$ 52.395	€ 48.719	766	(8)	758	0,12
	08.2023	52.756	48.080	0	(229)	(229)	(0,04)
CBK	07.2023	€ 48.312	\$ 52.526	0	(184)	(184)	(0,03)
	07.2023	\$ 1.446	€ 1.324	3	(4)	(1)	0,00
	08.2023	52.348	48.081	181	0	181	0,03
JPM	07.2023	€ 48.081	\$ 52.500	43	0	43	0,01
	07.2023	\$ 51.241	€ 47.926	1.047	0	1.047	0,17
	08.2023	52.573	48.081	0	(45)	(45)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 932	\$ 998	0	(19)	(19)	0,00
	07.2023	\$ 705	€ 643	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 3.049	\$ (492)	\$ 2.557	0,41

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 196	\$ 248	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2023	\$ 13	£ 10	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	£ 14	\$ 17	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 4.634	£ 3.746	129	0	129	0,02
BRC	07.2023	£ 575	\$ 713	0	(17)	(17)	0,00
	07.2023	\$ 6	£ 5	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£ 404	\$ 511	0	(3)	(3)	0,00



Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
JPM	07.2023	\$ 19	£ 15	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	£ 3.578	\$ 4.524	0	(25)	(25)	0,00
	08.2023	\$ 4.525	£ 3.578	25	0	25	0,00
MBC	07.2023	4.654	3.759	125	0	125	0,02
MYI	07.2023	4.627	3.723	106	0	106	0,02
SCX	07.2023	892	717	20	0	20	0,00
TOR	07.2023	£ 3.599	\$ 4.574	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	\$ 4.575	£ 3.599	2	0	2	0,00
				\$ 407	\$ (48)	\$ 359	0,06
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 11.175	1,80

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMOGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHORDEN</b>			
Ginnie Mae, TBA			
2,000 % fallig am 01.08.2053	\$ 7.900	\$ (6.646)	(1,07)
2,500 % fallig am 01.08.2053	26.200	(22.708)	(3,66)
4,000 % fallig am 01.08.2053	4.800	(4.546)	(0,73)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fallig am 01.07.2038	29.800	(26.410)	(4,26)
2,000 % fallig am 01.07.2053	65.954	(53.802)	(8,67)
2,000 % fallig am 01.08.2053	149.796	(122.370)	(19,73)
2,500 % fallig am 01.07.2053	7.100	(6.022)	(0,97)
3,000 % fallig am 01.07.2038	500	(466)	(0,07)
3,000 % fallig am 01.08.2053	57.750	(50.908)	(8,21)
4,000 % fallig am 01.07.2038	3.700	(3.572)	(0,58)
4,000 % fallig am 01.08.2053	57.000	(53.542)	(8,63)
4,500 % fallig am 01.08.2053	16.050	(15.439)	(2,49)
5,000 % fallig am 01.08.2053	24.200	(23.718)	(3,82)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (390.149)	(62,89)
Summe Anlagen		\$ 1.052.284	169,63
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (431.948)	(69,63)
Nettovermogen		\$ 620.336	100,00

## ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Reines Kapitalwertpapier.

(c) Wertpapier per Emissionstermin.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 354.567 USD (31. Dezember 2022: 324.164 USD) und Barmittel in Hohem von 569 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurde zum 30. Juni 2023 gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte als Sicherheit verpfandet.

Barmittel in Hohem von null USD (31. Dezember 2022: 4.656 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Hohem von 8.177 USD (31. Dezember 2022: 4.327 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Barmittel in Hohem von 1.230 USD (31. Dezember 2022: 4.020 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit fur Finanzderivate verpfandet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.417.010	\$ 4.851	\$ 1.421.861
Investmentfonds	24	0	0	24
Pensionsgeschafte	0	4.008	0	4.008
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	16.540	0	16.540
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(390.149)	0	(390.149)
Summen	\$ 24	\$ 1.047.409	\$ 4.851	\$ 1.052.284

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Mortgage Opportunities Fund (Fort.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.723.820	\$ 1.179	\$ 1.724.999
Investmentfonds	23	0	0	23
Pensionsgeschäfte	0	17.318	0	17.318
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	26.778	0	26.778
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(518.212)	0	(518.212)
<b>Summen</b>	<b>\$ 23</b>	<b>\$ 1.249.704</b>	<b>\$ 1.179</b>	<b>\$ 1.250.906</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,180 %	20.06.2023	13.07.2023	\$ (6.759)	\$ (6.770)	(1,09)
CIB	5,180	15.06.2023	13.07.2023	(337.645)	(338.422)	(54,56)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (345.192)</b>	<b>(55,65)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 991	\$ (790)	\$ 201	\$ (3.187)	\$ 2.810	\$ (377)
BPS	2.959	(2.920)	39	3.438	(3.310)	128
BRC	417	(390)	27	500	(480)	20
CBK	1.961	(2.090)	(129)	11.235	(10.950)	285
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	11	0	11
DUB	3.868	(4.050)	(182)	6.229	(5.990)	239
GLM	934	(910)	24	1.201	(1.080)	121
JPM	965	50	1.015	(743)	730	(13)
MBC	101	0	101	2.699	(2.490)	209
MSC	(5)	0	(5)	(94)	0	(94)
MYC	388	(300)	88	2.285	(2.410)	(125)
MYI	106	(20)	86	(6)	0	(6)
SAL	(62)	0	(62)	(418)	480	62
SCX	178	0	178	1.971	(1.850)	121
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
UAG	(1.626)	1.180	(446)	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	42,02	25,41
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	187,19	174,84
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	2,90
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	0,65	2,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,06	0,54
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,80	(0,35)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,80	2,96
Leerverkaufte Wertpapiere	(62,89)	(61,03)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(55,65)	(37,27)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	0,12	0,10
US-Regierungsbehörden	165,12	121,51
US-Schatzobligationen	1,11	0,51
Non-Agency-MBS	32,31	37,20
Forderungsbesicherte Wertpapiere	29,78	35,71
Kurzfristige Instrumente	0,77	8,12
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	0,65	2,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,07	0,54
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,80	(0,35)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	1,73	3,42
Optionen auf Wertpapiere	0,01	0,00
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,14)	(1,08)
Optionen auf Wertpapiere	(0,04)	(0,20)
Devisenterminkontrakte	(0,31)	0,14
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,55	0,68
Leerverkaufte Wertpapiere	(62,89)	(61,03)
Sonstige Aktiva und Passiva	(69,63)	(47,31)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des StocksPLUS™ Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				<b>BANKEN UND FINANZEN</b>			
AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % fällig am 14.08.2024	\$ 1.700	\$ 1.634	0,09	Ginnie Mae 2,625 % fällig am 20.08.2024 - 20.07.2027	\$ 344	\$ 349	0,02	Citigroup Mortgage Loan Trust 4,418 % fällig am 25.08.2035 ^	\$ 59	\$ 48	0,00
American Honda Finance Corp. 5,000 % fällig am 23.05.2025	4.100	4.085	0,23	2,750 % fällig am 20.10.2029	7	7	0,00	6,980 % fällig am 25.05.2035	1	1	0,00
American Tower Corp. 1,450 % fällig am 15.09.2026	8.200	7.222	0,40	2,875 % fällig am 20.04.2026 - 20.04.2041	145	141	0,01	7,110 % fällig am 25.10.2035 ^	32	31	0,00
3,800 % fällig am 15.08.2026	1.305	1.192	0,07	3,000 % fällig am 20.05.2047	304	283	0,02	Countrywide Alternative Loan Trust 4,976 % fällig am 25.12.2035	652	549	0,03
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 4,675 % fällig am 15.06.2026	5.000	4.945	0,27	4,643 % fällig am 20.10.2065 - 20.02.2066	8	8	0,00	5,350 % fällig am 25.04.2047	1.749	1.647	0,09
Bank of Nova Scotia 3,050 % fällig am 31.10.2024	€ 5.000	5.391	0,30	4,770 % fällig am 20.01.2066	195	192	0,01	5,352 % fällig am 20.12.2046 ^	55	46	0,00
Barclays PLC 5,829 % fällig am 09.05.2027	\$ 3.900	3.849	0,21	4,939 % fällig am 20.03.2066	361	358	0,02	5,360 % fällig am 25.04.2047	1.393	1.132	0,06
Credit Agricole Home Loan SFH S.A. 0,125 % fällig am 16.12.2024	€ 1.100	1.137	0,06	5,431 % fällig am 20.06.2067	664	663	0,04	5,450 % fällig am 25.06.2035 ^	900	613	0,03
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	10.000	8.095	0,45	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.10.2036	28	29	0,00	5,470 % fällig am 25.02.2047	68	62	0,00
GA Global Funding Trust 6,380 % fällig am 11.04.2025	\$ 6.800	6.666	0,37	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.08.2053	32.400	32.241	1,79	5,570 % fällig am 25.07.2046	3.827	3.394	0,19
Nykredit Realkredit A/S 5,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 42.698	6.162	0,34	6,000 % fällig am 01.08.2053	23.700	23.906	1,33	5,750 % fällig am 25.04.2037 ^	594	501	0,03
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 3,602 % fällig am 16.02.2026	€ 5.000	5.387	0,30	6,500 % fällig am 01.07.2053	45.300	46.239	2,56	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 5,610 % fällig am 25.05.2035	3.081	2.609	0,14
Toronto-Dominion Bank 0,500 % fällig am 03.04.2024	3.000	3.194	0,18	US-SCHATZOBBLIGATIONEN				5,930 % fällig am 25.02.2035	3.221	2.780	0,15
4,701 % fällig am 05.06.2027	\$ 9.000	8.905	0,49	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e) 0,125 % fällig am 15.07.2024	32.190	31.228	1,73	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 0,098 % fällig am 25.06.2032	0	0	0,00
UniCredit SpA 3,375 % fällig am 31.01.2027	€ 6.200	6.675	0,37	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.09.2027	100	85	0,00	5,449 % fällig am 25.03.2032	1	1	0,00
Van Lanschot Kempen NV 3,500 % fällig am 31.05.2026	300	325	0,02	0,500 % fällig am 31.10.2027	1.200	1.025	0,06	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 3,581 % fällig am 27.12.2037	4.555	3.864	0,21
		74.864	4,15	0,625 % fällig am 30.11.2027	12.800	10.965	0,61	Credit Suisse Mortgage Capital Trust 3,850 % fällig am 25.09.2057	8.887	8.521	0,47
				0,625 % fällig am 31.12.2027	10.700	9.145	0,51	5,943 % fällig am 15.07.2032	567	541	0,03
				0,750 % fällig am 31.01.2028	3.100	2.660	0,15	CSAIL Commercial Mortgage Trust 3,504 % fällig am 15.06.2057	4.030	3.837	0,21
						55.108	3,06	DBWF Mortgage Trust 6,596 % fällig am 19.12.2030	1.400	1.374	0,08
								Dutch Property Finance BV 3,892 % fällig am 28.07.2058	€ 2.902	3.162	0,18
								3,942 % fällig am 28.04.2059	10.633	11.545	0,64
								4,492 % fällig am 28.04.2050	3.686	3.958	0,22
								4,992 % fällig am 28.04.2050	9.579	9.828	0,55
								GSR Mortgage Loan Trust 5,500 % fällig am 25.01.2034	\$ 1	1	0,00
								HarborView Mortgage Loan Trust 4,688 % fällig am 19.08.2036 ^	19	18	0,00
								5,597 % fällig am 19.05.2035	20	18	0,00
								Hilton Orlando Trust 6,493 % fällig am 15.12.2034	9.170	9.030	0,50
								Hops Hill PLC 0,000 % fällig am 21.12.2055	€ 3.400	4.306	0,24
								Impac CMB Trust 5,690 % fällig am 25.05.2035	\$ 3.525	3.257	0,18
								5,910 % fällig am 25.10.2033	0	0	0,00
								Independence Plaza Trust 3,911 % fällig am 10.07.2035	4.300	3.983	0,22
								JPMorgan Alternative Loan Trust 6,500 % fällig am 25.03.2036 ^	1.421	827	0,05
								JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 6,543 % fällig am 15.02.2035	6.201	6.006	0,33
								JPMorgan Mortgage Trust 3,951 % fällig am 25.04.2036 ^	637	562	0,03
								Jupiter Mortgage PLC 5,291 % fällig am 20.07.2060	€ 11.540	14.651	0,81
								Lehman XS Trust 5,510 % fällig am 25.11.2035	\$ 3.366	3.249	0,18
								5,510 % fällig am 25.07.2037 ^	9.219	8.470	0,47
								5,690 % fällig am 25.12.2035	4.689	4.185	0,23
								London Wall Mortgage Capital PLC 5,452 % fällig am 15.05.2051	€ 6.962	8.795	0,49
								5,502 % fällig am 15.05.2052	5.900	7.442	0,41
								Luminent Mortgage Trust 5,550 % fällig am 25.10.2046	\$ 151	135	0,01
								MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 4,776 % fällig am 25.12.2046	9.656	7.368	0,41
								Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 5,673 % fällig am 15.06.2030	4	4	0,00
								Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 4,015 % fällig am 25.12.2034	5	5	0,00
								5,570 % fällig am 25.02.2036	6	6	0,00
								5,610 % fällig am 25.04.2029	111	102	0,01
								5,650 % fällig am 25.11.2035	3	3	0,00
								6,164 % fällig am 25.12.2029	107	97	0,01
								Mortimer BTL PLC 5,614 % fällig am 23.06.2053	€ 465	584	0,03

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Nomura Resecuritization Trust 6,050 % fällig am 25.03.2037	\$ 0	\$ 0	0,00	Avoca CLO DAC 3,997 % fällig am 15.10.2032	€ 4.200	\$ 4.480	0,25	GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,790 % fällig am 25.12.2035	\$ 3.478	\$ 3.282	0,18
Pierpont BTL PLC 5,714 % fällig am 22.12.2053	£ 11.507	14.551	0,81	Bain Capital Euro CLO DAC 3,940 % fällig am 20.01.2032	696	743	0,04	Ginkgo Sales Finance 4,113 % fällig am 25.11.2049	€ 3.433	3.747	0,21
Polaris PLC 5,631 % fällig am 23.12.2058	1.402	1.774	0,10	Bavarian Sky S.A. 3,765 % fällig am 20.03.2030	823	899	0,05	Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd. 6,373 % fällig am 15.09.2037	\$ 946	934	0,05
Prime Mortgage Trust 5,550 % fällig am 25.02.2034	\$ 18	17	0,00	4,055 % fällig am 25.12.2036	301	329	0,02	GSAA Home Equity Trust 5,650 % fällig am 25.01.2036	998	372	0,02
Primrose Residential DAC 4,189 % fällig am 24.03.2061	€ 2.143	2.322	0,13	4,055 % fällig am 20.07.2029	4.806	5.249	0,29	GSAMP Trust 5,290 % fällig am 25.12.2036	1.007	545	0,03
Residential Accredited Loans, Inc. Trust 6,500 % fällig am 25.08.2036	\$ 963	777	0,04	5,470 % fällig am 25.08.2036	\$ 452	430	0,02	5,450 % fällig am 25.09.2036	2.782	1.013	0,06
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 4,149 % fällig am 25.09.2035 ^	438	283	0,02	5,490 % fällig am 25.12.2036	1.000	950	0,05	5,630 % fällig am 25.03.2046	587	567	0,03
Sequoia Mortgage Trust 5,757 % fällig am 20.12.2034	234	210	0,01	5,650 % fällig am 25.05.2037	2.125	1.996	0,11	6,050 % fällig am 25.11.2035 ^	1.550	1.451	0,08
Shamrock Residential DAC 4,289 % fällig am 24.01.2061	€ 19.606	21.166	1,17	Black Diamond CLO DAC 2,500 % fällig am 15.05.2032	4.000	3.764	0,21	Harvest CLO DAC 3,937 % fällig am 15.07.2031	€ 900	958	0,05
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 5,282 % fällig am 25.02.2034	\$ 9	9	0,00	4,060 % fällig am 20.01.2032	€ 837	900	0,05	4,250 % fällig am 26.06.2030	354	379	0,02
5,376 % fällig am 25.01.2035 ^	20	17	0,00	4,303 % fällig am 15.05.2032	22.300	23.805	1,32	Hill FL BV 4,050 % fällig am 18.05.2030	7.972	8.726	0,48
5,470 % fällig am 25.10.2035	2.006	1.836	0,10	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 3,827 % fällig am 15.07.2030	366	392	0,02	4,110 % fällig am 18.05.2031	7.400	8.091	0,45
Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,330 % fällig am 25.09.2047	617	560	0,03	Bumper FR 4,113 % fällig am 27.04.2032	13.430	14.687	0,81	Home Equity Asset Trust 4,279 % fällig am 25.10.2035	\$ 2.900	2.780	0,15
5,376 % fällig am 25.12.2035 ^	52	42	0,00	Bumper NL BV 4,613 % fällig am 24.06.2031	3.598	3.939	0,22	5,855 % fällig am 25.01.2036	1.012	956	0,05
5,646 % fällig am 19.07.2035	15	13	0,00	Cairn CLO DAC 3,842 % fällig am 30.04.2031	1.183	1.265	0,07	HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,930 % fällig am 25.01.2036	1.200	939	0,05
5,710 % fällig am 25.02.2036 ^	8	7	0,00	3,912 % fällig am 31.01.2030	426	458	0,03	JPMorgan Mortgage Acquisition Corp. 6,080 % fällig am 25.12.2035	1.339	1.282	0,07
Tharaldson Hotel Portfolio Trust 6,591 % fällig am 11.11.2034	3.159	3.110	0,17	3,957 % fällig am 15.10.2031	600	642	0,04	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 5,410 % fällig am 25.06.2037	168	167	0,01
Thornburg Mortgage Securities Trust 5,790 % fällig am 25.09.2043	335	317	0,02	Carlyle Euro CLO DAC 3,877 % fällig am 15.01.2031	796	851	0,05	5,430 % fällig am 25.03.2047	610	566	0,03
Towd Point Mortgage Funding PLC 6,546 % fällig am 20.02.2054	£ 225	286	0,02	4,213 % fällig am 15.08.2032	5.700	6.079	0,34	5,585 % fällig am 25.05.2036	532	499	0,03
Towd Point Mortgage Trust 3,750 % fällig am 25.10.2056	\$ 8.100	7.613	0,42	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 4,137 % fällig am 16.01.2033	7.400	7.825	0,43	Jubilee CLO DAC 3,777 % fällig am 15.04.2030	€ 400	426	0,02
Tower Bridge Funding PLC 5,399 % fällig am 21.07.2064	£ 7.994	10.159	0,56	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,073 % fällig am 15.11.2031	800	856	0,05	3,787 % fällig am 15.04.2030	1.000	1.069	0,06
Twin Bridges PLC 0,000 % fällig am 14.06.2055	1.000	1.267	0,07	Carrington Mortgage Loan Trust 6,140 % fällig am 25.06.2035	\$ 423	412	0,02	3,827 % fällig am 15.04.2031	1.200	1.278	0,07
5,635 % fällig am 01.12.2055	7.548	9.515	0,53	Chase Funding Trust 5,890 % fällig am 25.10.2032	2	2	0,00	4,326 % fällig am 15.12.2029	668	720	0,04
Verus Securitization Trust 1,829 % fällig am 25.10.2066	\$ 6.091	5.187	0,29	CIT Mortgage Loan Trust 6,500 % fällig am 25.10.2037	376	376	0,02	Koromo Italy SRL 4,213 % fällig am 26.02.2035	954	1.044	0,06
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,693 % fällig am 25.08.2046 ^	26	23	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 6,800 % fällig am 25.07.2037	518	516	0,03	Laurelin DAC 3,920 % fällig am 20.10.2031	1.100	1.178	0,07
3,800 % fällig am 25.10.2035	233	211	0,01	Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC 4,148 % fällig am 15.12.2029	€ 1.568	1.713	0,10	Long Beach Mortgage Loan Trust 5,590 % fällig am 25.02.2036	\$ 1.060	1.026	0,06
4,676 % fällig am 25.03.2047 ^	2.064	1.792	0,10	Compartment VCL 3,802 % fällig am 21.01.2029	2.691	2.939	0,16	5,710 % fällig am 25.10.2034	5	4	0,00
5,690 % fällig am 25.12.2045	6	6	0,00	3,842 % fällig am 21.04.2029	900	983	0,05	5,750 % fällig am 25.01.2036	353	322	0,02
5,730 % fällig am 25.10.2045	3	3	0,00	4,072 % fällig am 21.09.2026	269	294	0,02	LT Autorahouts DAC 4,040 % fällig am 15.04.2030	€ 9.400	10.263	0,57
6,070 % fällig am 25.10.2044	426	394	0,02	Countrywide Asset-Backed Certificates 5,550 % fällig am 25.08.2034	\$ 112	104	0,01	4,250 % fällig am 17.12.2032	11.869	13.020	0,72
6,130 % fällig am 25.10.2045	1.830	1.723	0,10	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 4,134 % fällig am 25.01.2037	120	119	0,01	Man GLG Euro CLO DAC 3,857 % fällig am 15.10.2030	513	549	0,03
6,310 % fällig am 25.11.2045	917	859	0,05	5,290 % fällig am 25.08.2037	167	165	0,01	4,047 % fällig am 15.01.2030	440	474	0,03
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 4,218 % fällig am 15.07.2046	479	477	0,03	5,430 % fällig am 25.02.2037	922	870	0,05	4,216 % fällig am 15.12.2031	999	1.070	0,06
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 4,709 % fällig am 25.04.2036	1.617	1.535	0,09	5,430 % fällig am 25.02.2037	922	870	0,05	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,280 % fällig am 25.10.2036	\$ 725	641	0,04
		273.547	15,16	5,430 % fällig am 25.03.2037	1.021	981	0,05	5,650 % fällig am 25.04.2036	1.739	1.606	0,09
				5,690 % fällig am 25.03.2036	583	503	0,03	6,005 % fällig am 25.03.2034	989	970	0,05
				6,155 % fällig am 25.10.2035	155	153	0,01	6,065 % fällig am 25.07.2034	1.033	1.030	0,06
				6,245 % fällig am 25.07.2035	78	77	0,00	6,065 % fällig am 25.09.2034	1.528	1.471	0,08
				Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 4,599 % fällig am 25.01.2032	2	2	0,00	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 5,470 % fällig am 25.04.2036	197	139	0,01
				Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 6,725 % fällig am 25.03.2046	1.500	1.377	0,08	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 5,330 % fällig am 25.12.2036	1.877	749	0,04
				CVC Cordatus Loan Fund DAC 4,156 % fällig am 15.09.2031	€ 900	961	0,05	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 5,780 % fällig am 25.02.2036	1.477	1.311	0,07
				Dryden Euro CLO DAC 4,183 % fällig am 15.05.2034	1.000	1.068	0,06	Oak Hill European Credit Partners Ltd. 4,100 % fällig am 22.07.2030	€ 134	146	0,01
				Ellington Loan Acquisition Trust 6,200 % fällig am 25.05.2037	\$ 1.786	1.679	0,09	Option One Mortgage Loan Trust 5,370 % fällig am 25.04.2037	\$ 2.047	1.460	0,08
				EquiFirst Mortgage Loan Trust 6,875 % fällig am 25.12.2034	449	426	0,02	Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates 5,885 % fällig am 25.11.2035	274	220	0,01
				FACT Master S.A. 4,055 % fällig am 20.07.2028	€ 1.656	1.811	0,10	OZLME DAC 4,618 % fällig am 27.07.2032	€ 1.440	1.518	0,08
				First Franklin Mortgage Loan Trust 5,630 % fällig am 25.05.2036	\$ 6.681	5.513	0,31	Palmer Square European Loan Funding DAC 4,727 % fällig am 15.11.2032	600	654	0,04
				Fremont Home Loan Trust 5,490 % fällig am 25.02.2037	3.955	1.358	0,08	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 6,470 % fällig am 25.01.2036 ^	\$ 1.000	910	0,05
				Gallatin CLO Ltd. 6,311 % fällig am 21.01.2028	222	222	0,01	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 6,020 % fällig am 25.02.2036	1.700	1.532	0,09

## Aufstellung des Wertpapierbestands des StocksPLUS™ Fund (Cont.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		
		MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS	
RAAC Trust	\$ 3.164	\$ 3.025	0,17	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust	\$ 1.490	\$ 1.372	0,08	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				
6,650 % fällig am 25.09.2047				5,420 % fällig am 25.03.2036	\$ 3.321	\$ 3.083	0,17	Federal Home Loan Bank	\$ 15.300	\$ 15.303	0,85	
Red & Black Auto Lease France				5,460 % fällig am 25.08.2046	1.642	1.147	0,06	5,120 % fällig am 17.11.2023				
4,093 % fällig am 27.06.2035	€ 1.000	1.091	0,06	5,470 % fällig am 25.10.2036	1.314	1.273	0,07	<b>U.S. TREASURY BILLS</b>				
Residential Asset Mortgage Products Trust				5,570 % fällig am 25.02.2037				5,156 % fällig am				
5,690 % fällig am 25.02.2036	\$ 1.200	1.131	0,06	Toro European CLO DAC	€ 5.100	5.415	0,30	03.08.2023 (c)(d)	40.000	39.824	2,21	
6,215 % fällig am 25.05.2035	2.000	1.872	0,10	4,133 % fällig am 15.02.2034				5,177 % fällig am				
Residential Asset Securities Corp. Trust				Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust	\$ 866	811	0,05	15.08.2023 (c)(d)	30.000	29.816	1,65	
5,430 % fällig am 25.07.2036	1.200	1.130	0,06	5,460 % fällig am 25.08.2036				5,242 % fällig am				
Revocar UG	€ 1.076	1.178	0,07	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust	393	391	0,02	20.07.2023 (c)(d)	80.000	79.811	4,42	
4,032 % fällig am 21.04.2036				5,645 % fällig am 25.05.2036				5,339 % fällig am				
Saxon Asset Securities Trust						272.528	15,11	31.08.2023 (c)(d)(g)	25.000	24.788	1,37	
6,050 % fällig am 26.12.2034	\$ 240	225	0,01							174.239	9,65	
SCF Rahoituspalvelut DAC				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe kurzfristige Instrumente			200.860	11,13
4,020 % fällig am 25.06.2033	€ 1.300	1.419	0,08	Korea Housing Finance Corp.	€ 5.000	5.100	0,28	Summe Übertragbare Wertpapiere			\$ 1.011.424	56,06
4,039 % fällig am 25.06.2032	1.501	1.639	0,09	0,010 % fällig am 05.02.2025	5.000	5.014	0,28					
Silver Arrow Athlon NL BV				0,010 % fällig am 07.07.2025	1.260	1.295	0,07	<b>AKTIEN</b>				
4,139 % fällig am 26.04.2031	13.315	14.552	0,81	0,723 % fällig am 22.03.2025				<b>INVESTMENTFONDS</b>				
Silver Arrow S.A.						11.409	0,63	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				
3,768 % fällig am 15.02.2030	6.984	7.627	0,42					PIMCO Select Funds plc - PIMCO				
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				US Dollar Short-Term Floating				
5,270 % fällig am 25.03.2037	\$ 4.819	2.700	0,15	<b>COMMERCIAL PAPER</b>				NAV Fund (f)	16.371.646	163.028	9,04	
5,650 % fällig am 25.06.2037	5.928	3.458	0,19	Ameren Corp.	\$ 8.550	8.523	0,47	Summe Investmentfonds			\$ 163.028	9,04
6,125 % fällig am 25.12.2035	104	102	0,01	5,400 % fällig am 21.07.2023								
Structured Asset Investment Loan Trust				Virginia Electric & Power Co.	2.800	2.795	0,16					
5,330 % fällig am 25.09.2036	6.786	4.275	0,24	5,330 % fällig am 13.07.2023								
5,770 % fällig am 25.01.2036	1.238	1.140	0,06			11.318	0,63					
5,915 % fällig am 25.08.2035	1.552	1.471	0,08									

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,100 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 37.100	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030	\$ (37.947)	\$ 37.100	\$ 37.116	2,06
	5,170	30.06.2023	03.07.2023	136.900	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.10.2051	(141.714)	136.900	136.959	7,58
BRC	5,130	30.06.2023	03.07.2023	36.600	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.08.2051	(37.494)	36.600	36.616	2,03
DEU	5,150	30.06.2023	03.07.2023	100	U.S. Treasury Bonds 2,750 % fällig am 15.08.2047	(104)	100	100	0,01
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	10.413	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(10.621)	10.413	10.413	0,58
GSC	5,160	30.06.2023	03.07.2023	130.000	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.04.2052	(134.655)	130.000	130.056	7,21
MFK	5,180	30.06.2023	03.07.2023	150.000	U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.02.2041	(153.649)	150.000	150.065	8,31
RVM	5,180	30.06.2023	03.07.2023	150.000	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 30.04.2030	(151.839)	150.000	150.065	8,31
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (668.023)	\$ 651.113	\$ 651.390	36,09

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2023	3.152	\$ 19.819	1,10
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	72	99	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	33	(97)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	91	(195)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	355	740	0,04
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	8	(16)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	6	7	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 20.357	1,13

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2023	\$ 6.300	\$ (62)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.500	(24)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	1.100	(10)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	700	5	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	3.100	(14)	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	800	(1)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.700	6	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	3.700	1	0,00
				\$ (99)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 4.500	\$ 21	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	304.500	1.468	0,08
				\$ 1.489	0,08

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750 %	15.06.2024	\$ 237.900	\$ 1.140	0,07
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	22.900	(223)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	28.900	252	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,875	07.02.2050	300	135	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.01.2050	900	416	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	20.03.2050	1.900	867	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	3.200	94	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	7.100	201	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	7.200	61	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	12.300	247	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	12.300	101	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	41.100	(802)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	29.300	(9)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	16.700	131	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,875	07.08.2023	300	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.07.2023	900	3	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.09.2023	1.900	8	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	€ 23.200	294	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,418	11.07.2052	\$ 5.700	153	0,01
					\$ 3.070	0,18
					\$ 4.460	0,25

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückgliederungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	677	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 6.071	10.01.2024	\$ 0	\$ 375	\$ 375	0,02
FAR	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	2.731	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	24.489	02.08.2023	0	1.512	1.512	0,08
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	167	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.498	15.11.2023	0	92	92	0,01
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	3.736	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	34.215	05.06.2024	0	1.386	1.386	0,08



## Aufstellung des Wertpapierbestands des StocksPLUS™ Fund (Cont.)

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
JPM	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	21.307	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 199.758	26.06.2024	\$ 0	\$ 3.687	\$ 3.687	0,20
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	16.775	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	157.269	18.10.2023	0	2.905	2.905	0,16
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	9.621	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	86.273	06.03.2024	0	5.327	5.327	0,29
RBC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	5.404	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	48.459	20.03.2024	0	2.992	2.992	0,17
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	24.342	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	218.279	19.07.2023	0	13.474	13.474	0,75
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	398	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.569	26.07.2023	0	220	220	0,01
UBS	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	6.655	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	62.392	18.10.2023	0	1.152	1.152	0,06
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	340	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.049	17.01.2024	0	188	188	0,01
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	5.593	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	49.360	24.01.2024	0	3.841	3.841	0,21
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	13.035	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	116.887	21.02.2024	0	7.220	7.220	0,41
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	340	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.049	15.05.2024	0	188	188	0,01
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	2.522	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	22.615	13.09.2023	0	1.397	1.397	0,08
							\$ 0	\$ 45.956	\$ 45.956	2,55

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	DKK 10.803	\$ 1.560	\$ 0	\$ (23)	\$ (23)	0,00
	07.2023	€ 6.093	6.590	0	(57)	(57)	0,00
	07.2023	\$ 2.881	DKK 19.592	0	(11)	(11)	0,00
BPS	08.2023	DKK 19.559	\$ 2.881	11	0	11	0,00
	09.2023	\$ 6	TWD 176	0	0	0	0,00
	07.2023	€ 1.430	\$ 1.558	0	(2)	(2)	0,00
BRC	07.2023	NZD 56	34	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 274.541	€ 250.565	0	(1.175)	(1.175)	(0,07)
	07.2023	€ 4.772	£ 3.750	0	(5)	(5)	0,00
CBK	08.2023	€ 249.045	\$ 273.261	1.183	0	1.183	0,07
	08.2023	\$ 3	TWD 88	0	0	0	0,00
	10.2023	32	ZAR 590	0	(1)	(1)	0,00
CLY	07.2023	£ 13.681	\$ 17.028	0	(366)	(366)	(0,02)
	07.2023	€ 842	909	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	£ 12.034	15.093	0	(206)	(206)	(0,01)
GLM	07.2023	\$ 24.791	€ 23.082	394	(3)	391	0,02
	07.2023	DKK 31.749	\$ 4.583	0	(69)	(69)	0,00
	10.2023	\$ 90	ZAR 1.695	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2023	€ 27.140	\$ 29.017	0	(592)	(592)	(0,03)
	07.2023	£ 817	1.033	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	\$ 1.033	£ 817	6	0	6	0,00
MBC	07.2023	CAD 149	\$ 110	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	£ 40.684	50.361	0	(1.362)	(1.362)	(0,08)
	07.2023	\$ 6.538	€ 6.067	83	(2)	81	0,00
MYI	07.2023	€ 436	\$ 475	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 2.561	DKK 17.472	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	DKK 17.443	\$ 2.561	1	0	1	0,00
RBC	08.2023	\$ 3	TWD 95	0	0	0	0,00
	08.2023	13	MXN 222	0	0	0	0,00
	07.2023	NZD 134	\$ 81	0	(1)	(1)	0,00
SOG	07.2023	€ 244.209	262.705	0	(3.728)	(3.728)	(0,21)
	07.2023	\$ 87	CAD 115	0	0	0	0,00
	07.2023	80.646	£ 63.466	41	0	41	0,00
TOR	07.2023	116	NZD 190	1	0	1	0,00
	08.2023	CAD 115	\$ 87	0	0	0	0,00
	08.2023	£ 63.466	80.664	0	(40)	(40)	0,00
				0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1.720	\$ (7.667)	\$ (5.947)	(0,33)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 16	\$ 17	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 54.107	€ 50.344	819	0	819	0,05
BPS	07.2023	€ 59.902	\$ 65.621	273	(6)	267	0,02

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	\$ 53.681	€ 49.929	\$ 792	\$ 0	\$ 792	0,04
	08.2023	\$ 58.825	€ 58.169	0	(276)	(276)	(0,02)
CBK	07.2023	€ 54.491	\$ 59.256	6	(199)	(193)	(0,01)
	07.2023	\$ 2.851	€ 2.654	45	0	45	0,00
	08.2023	\$ 57.140	€ 52.483	197	0	197	0,01
JPM	07.2023	€ 59.024	\$ 64.448	53	0	53	0,00
	08.2023	\$ 64.538	€ 59.024	0	(55)	(55)	0,00
MBC	07.2023	€ 1.272	\$ 1.364	0	(24)	(24)	0,00
	07.2023	\$ 454	€ 417	2	(1)	1	0,00
RYL	07.2023	\$ 23.285	€ 21.764	459	0	459	0,03
SOG	07.2023	\$ 53.292	€ 49.540	756	0	756	0,04
				\$ 3.402	\$ (561)	\$ 2.841	0,16

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 1	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 46	£ 37	1	0	1	0,00
CBK	07.2023	\$ 3	£ 2	0	(1)	(1)	0,00
CLY	07.2023	\$ 168	£ 133	1	0	1	0,00
MBC	07.2023	£ 2	\$ 2	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 39	£ 31	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	\$ 39	£ 31	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	\$ 39	£ 31	1	0	1	0,00
				\$ 5	\$ (1)	\$ 4	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	SGD 1	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 111	SGD 151	0	0	0	0,00
CLY	07.2023	\$ 3	SGD 4	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	\$ 92	SGD 124	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	SGD 3	\$ 3	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 102	SGD 138	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 42.854 2,38

Summe Anlagen

\$ 1.893.236 104,95

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (89.277) (4,95)

Nettovermögen

\$ 1.803.959 100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend)\*:

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 1.292 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von 2.200 USD (31. Dezember 2022: 40.550 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 58.286 USD (31. Dezember 2022: 45.395 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.011.308	\$ 116	\$ 1.011.424
Investmentfonds	163.028	0	0	163.028
Pensionsgeschäfte	0	651.113	0	651.113
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	19.925	47.746	0	67.671
Summen	\$ 182.953	\$ 1.710.167	\$ 116	\$ 1.893.236

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 711.694	\$ 0	\$ 711.694
Investmentfonds	92.742	0	0	92.742
Pensionsgeschäfte	0	156.445	0	156.445
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(14.139)	(3.519)	0	(17.658)
<b>Summen</b>	<b>\$ 78.603</b>	<b>\$ 864.620</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 943.223</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ (653)	\$ 580	\$ (73)
BOA	740	(580)	160	(428)	290	(138)
BPS	782	(850)	(68)	4	0	4
BRC	(366)	343	(23)	9	0	9
CBK	598	(560)	38	2.647	(2.506)	141
CLY	(68)	0	(68)	(53)	0	(53)
FAR	6.677	(3.480)	3.197	(1.148)	18.390	17.242
GLM	(1)	0	(1)	(184)	0	(184)
JPM	10.630	(6.960)	3.670	753	(700)	53
MBC	(1.306)	949	(357)	(1.953)	3.760	1.807
MYI	0	(10)	(10)	(224)	0	(224)
RBC	26.283	(20.470)	5.813	(1.063)	16.910	15.847
RYL	459	(490)	(31)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	2.420	(2.270)	150
SOG	(2.972)	2.200	(772)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	0	(970)	(970)	2	620	622
UBS	1.397	0	1.397	(35)	0	(35)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	39,76	33,61
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	16,30	35,70
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	1,24
Investmentfonds	9,04	9,19
Pensionsgeschäfte	36,09	15,52
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	1,13	(1,39)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,25	(0,37)
Freiverkehrsfinaanzderivate	2,38	0,01

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	4,99	6,99
US-Regierungsbehörden	5,98	0,59
US-Schatzobligationen	3,06	k. A.
Non-Agency-MBS	15,16	25,04
Forderungsbesicherte Wertpapiere	15,11	22,85
Staatsemissionen	0,63	k. A.
Kurzfristige Instrumente	11,13	15,08
Investmentfonds	9,04	9,19
Pensionsgeschäfte	36,09	15,52
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	1,13	(1,39)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,10)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,30)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,08	0,00
Zinsswaps	0,18	0,03
Freiverkehrsfinaanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	2,55	(0,24)
Devisenterminkontrakte	(0,33)	(0,30)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,16	0,55
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,95)	6,49
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	\$ 43	\$ 36	0,31	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 5,610 % fällig am 25.05.2035	80	68	0,59	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 5,360 % fällig am 25.10.2036	\$ 24	\$ 23	0,20
Goldman Sachs Group, Inc. 6,941 % fällig am 15.03.2028	100	102	0,88	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 5,590 % fällig am 25.11.2034	10	10	0,09	Jubilee CLO DAC 3,787 % fällig am 15.04.2030	€ 100	107	0,93
Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,750 % fällig am 09.03.2028	50	41	0,36	CSAIL Commercial Mortgage Trust 3,504 % fällig am 15.06.2057	100	95	0,82	Man GLG Euro CLO DAC 4,047 % fällig am 15.01.2030	44	47	0,41
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 700	77	0,67	Dutch Property Finance BV 4,492 % fällig am 28.04.2050	€ 46	50	0,43	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 6,005 % fällig am 25.03.2034	\$ 62	60	0,52
Wells Fargo & Co. 1,338 % fällig am 04.05.2025	€ 100	106	0,92	Frost CMBS DAC 4,533 % fällig am 20.11.2033	99	104	0,90	Mountain View CLO Ltd. 6,592 % fällig am 13.10.2027	196	196	1,70
		362	3,14	GSR Mortgage Loan Trust 3,657 % fällig am 25.11.2035	\$ 16	14	0,12	Oak Hill European Credit Partners DAC 3,930 % fällig am 20.01.2032	€ 93	99	0,86
				Mortgage Equity Conversion Asset Trust 5,720 % fällig am 25.02.2042	91	88	0,76	Palmer Square European Loan Funding DAC 4,727 % fällig am 15.11.2032	100	109	0,94
				Precise Mortgage Funding PLC 6,065 % fällig am 12.12.2055	£ 56	71	0,62	Pretium Mortgage Credit Partners LLC 2,240 % fällig am 27.09.2060	\$ 104	98	0,85
				Shamrock Residential DAC 4,289 % fällig am 24.01.2061	€ 83	89	0,77			1.949	16,88
				Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,646 % fällig am 19.07.2035	\$ 22	20	0,17	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
				5,770 % fällig am 25.09.2045	11	10	0,09	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
				Structured Asset Securities Corp. 5,430 % fällig am 25.01.2036	11	9	0,08	Federal Home Loan Bank 5,120 % fällig am 17.11.2023			
				5,500 % fällig am 25.03.2035	41	35	0,30	500 500 4,33			
						807	6,98	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>							
				Ares European CLO DAC 3,837 % fällig am 15.10.2030	€ 99	106	0,92	(0,206) % fällig am 18.07.2023			
				Armada Euro CLO DAC 3,897 % fällig am 15.07.2031	100	107	0,92	(a)(b) 20.000 138 1,19			
				Avoca CLO DAC 3,867 % fällig am 15.07.2030	73	78	0,67	(0,200) % fällig am 14.08.2023			
				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 5,470 % fällig am 25.08.2036	\$ 80	76	0,66	(a)(b) 20.000 139 1,20			
				6,400 % fällig am 25.08.2037	15	15	0,13	(0,197) % fällig am 31.07.2023			
				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 4,137 % fällig am 16.01.2033	€ 100	106	0,92	(a)(b) 23.000 159 1,38			
				Contego CLO DAC 3,851 % fällig am 23.01.2030	100	107	0,93	(0,188) % fällig am 18.07.2023			
				Fremont Home Loan Trust 5,765 % fällig am 25.11.2035	\$ 100	86	0,74	(a)(b) 10.000 69 0,60			
				Griffith Park CLO DAC 4,103 % fällig am 21.11.2031	€ 100	107	0,93	(0,186) % fällig am 07.08.2023			
				GSA Home Equity Trust 7,025 % fällig am 25.02.2035	\$ 100	96	0,83	(a)(b) 20.000 138 1,20			
				GSAMP Trust 5,290 % fällig am 25.12.2036	141	76	0,66	(0,178) % fällig am 31.07.2023			
				Home Equity Loan Trust 5,380 % fällig am 25.04.2037	69	67	0,58	(a)(b) 7.000 49 0,42			
				HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,930 % fällig am 25.01.2036	100	78	0,67	(0,176) % fällig am 14.08.2023			
								(a)(b) 10.000 69 0,60			
								(0,166) % fällig am 07.08.2023			
								(a)(b) 10.000 69 0,60			
								830 7,19			
								<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
								5,166 % fällig am 08.08.2023			
								(a)(b) \$ 1.000 995 8,63			
								Summe kurzfristige Instrumente 2.325 20,15			
								Summe Übertragbare Wertpapiere \$ 7.486 64,84			
								<b>AKTIEN</b>			
								<b>INVESTMENTFONDS</b>			
								<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
								PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d) 74.314 740 6,40			
								<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
								PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d) 3.800 377 3,27			
								Summe Investmentfonds \$ 1.117 9,67			

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,160 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 2.100	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025	\$ (2.145)	\$ 2.100	\$ 2.101	18,19
	5,170	30.06.2023	03.07.2023	1.800	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.10.2051	(1.863)	1.800	1.801	15,59
SSB	2,400	30.06.2023	03.07.2023	118	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	(120)	118	118	1,02
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (4.128)	\$ 4.018	\$ 4.020	34,80

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (Fort.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2023	5	\$ 30	0,26
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1	1	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	7	(15)	(0,13)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	8	17	0,15
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	13	(25)	(0,22)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1	0	0,00
				\$ 8	0,07
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				\$ 8	0,07

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000 %	20.06.2028	\$ 200	\$ 6	0,05
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	5.900	33	0,28
				\$ 39	0,33

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,407 %	21.07.2024	\$ 200	\$ (12)	(0,11)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	200	(21)	(0,17)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,740	15.02.2027	100	(12)	(0,10)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2025	350	(34)	(0,29)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2027	300	44	0,38
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	100	22	0,19
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	100	20	0,18
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,277	21.07.2031	200	38	0,31
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	200	21	0,19
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	600	3	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	700	21	0,18
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,500	18.12.2024	100	9	0,08
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	100	3	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	200	3	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	400	(16)	(0,13)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	200	3	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	100	1	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	21.07.2023	400	0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023	200	(3)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,740	15.08.2023	100	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.09.2023	50	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023	100	1	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.09.2023	100	1	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.09.2023	200	2	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.09.2023	100	1	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 90	(2)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	200	2	0,02
				\$ 93	0,81	
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>				\$ 132	1,14	

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BRC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	111	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 995	04.10.2023	\$ 0	\$ 62	\$ 62	0,53
CBK	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	170	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.524	10.01.2024	0	94	94	0,82
FAR	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	155	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.390	02.08.2023	0	86	86	0,74
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	85	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	762	27.09.2023	0	47	47	0,41
RBC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	569	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.102	21.02.2024	0	315	315	2,73
							\$ 0	\$ 604	\$ 604	5,23

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	DKK 141	\$ 20	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 38	DKK 255	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK 255	\$ 38	0	0	0	0,00
	08.2023	€ 10	\$ 11	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	¥ 30.000	232	25	0	25	0,22
	08.2023	£ 3	4	0	0	0	0,00
CBK	08.2023	\$ 16	£ 13	0	0	0	0,00
CLY	07.2023	DKK 413	\$ 60	0	(2)	(2)	(0,01)
JPM	08.2023	£ 32	40	0	0	0	0,00
MBC	08.2023	€ 1.323	1.460	13	0	13	0,11
MYI	07.2023	\$ 33	DKK 227	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK 227	\$ 33	0	0	0	0,00
RBC	07.2023	\$ 0	MXN 0	0	0	0	0,00
	08.2023	£ 6	\$ 8	0	0	0	0,00
	08.2023	MXN 0	0	0	0	0	0,00
SSB	07.2023	¥ 30.000	227	19	0	19	0,16
	08.2023	30.000	226	17	0	17	0,15
UAG	08.2023	£ 28	35	0	0	0	0,00
	08.2023	¥ 30.000	221	13	0	13	0,11
	08.2023	\$ 6	€ 6	0	0	0	0,00
				\$ 87	\$ (2)	\$ 85	0,74

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	\$ 8	£ 6	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
MBC	07.2023	£ 7	\$ 9	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 305	£ 246	9	0	9	0,07
MYI	07.2023	306	246	7	0	7	0,06
SCX	07.2023	311	249	6	0	6	0,06
				\$ 22	\$ 0	\$ 22	0,19

## Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 711 6,16

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2.500 % fällig am 01.07.2053	\$ 400	\$ (339)	(2,94)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (339)	(2,94)
Summe Anlagen		\$ 13.133	113,74
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (1.586)	(13,74)
Nettovermögen		\$ 11.547	100,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (Fort.)

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von 299 USD (31. Dezember 2022: 221 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 640 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

#### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 7.467	\$ 19	\$ 7.486
Investmentfonds	1.117	0	0	1.117
Pensionsgeschäfte	0	4.018	0	4.018
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	31	820	0	851
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(339)	0	(339)
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.148</b>	<b>\$ 11.966</b>	<b>\$ 19</b>	<b>\$ 13.133</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 7.750	\$ 0	\$ 7.750
Investmentfonds	528	376	0	904
Pensionsgeschäfte	0	1.374	0	1.374
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	9	(44)	0	(35)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(583)	0	(583)
<b>Summen</b>	<b>\$ 537</b>	<b>\$ 8.873</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 9.410</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ (43)	\$ 0	\$ (43)
BRC	87	(80)	7	(4)	80	76
CBK	94	0	94	7	0	7
CLY	(2)	0	(2)	(1)	0	(1)
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	(47)	0	(47)
FAR	133	0	133	(16)	280	264
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
MBC	22	0	22	(19)	0	(19)
MYI	7	0	7	k. A.	k. A.	k. A.
RBC	315	(300)	15	(17)	280	263
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	(26)	0	(26)
SCX	6	0	6	3	0	3
SSB	36	0	36	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	13	0	13	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.



**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	22,68	20,10
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	42,16	61,13
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	k. A.	0,10
Investmentfonds	9,67	9,49
Pensionsgeschäfte	34,80	14,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,07	(0,07)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,14	1,43
Freiverkehrsfinanzderivate	6,16	(1,72)
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,94)	(6,12)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

<b>Anlagen zum Marktwert</b>	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	3,56	8,52
US-Regierungsbehörden	15,61	7,38
US-Schatzobligationen	1,66	1,25
Non-Agency-MBS	6,98	9,36
Forderungsbesicherte Wertpapiere	16,88	20,52
Kurzfristige Instrumente	20,15	34,30
Investmentfonds	9,67	9,49
Pensionsgeschäfte	34,80	14,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,07	(0,07)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,33	0,46
Zinsswaps	0,81	0,97
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	5,23	(0,39)
Devisenterminkontrakte	0,74	(1,42)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,19	0,09
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,94)	(6,12)
Sonstige Aktiva und Passiva	(13,74)	1,24
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Strategic Income Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>Park Aerospace Holdings Ltd.</b>				3,750 % fällig am 01.07.2028			
				5,500 % fällig am 15.02.2024				\$ 1.102 \$ 988 0,21			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>Societe Generale S.A.</b>				3,750 % fällig am 15.08.2042 ^			
				6,446 % fällig am 10.01.2029				20 14 0,00			
Carnival Corp.				6,691 % fällig am 10.01.2034				4,000 % fällig am 01.12.2046 ^			
8,217 % fällig am 30.06.2025				1.700				1.704 0,37			
\$ 970 \$ 970 0,21				1.800				1.834 0,40			
Emerald TopCo, Inc.				Sunac China Holdings Ltd.				4,200 % fällig am 01.03.2029			
8,584 % fällig am 24.07.2026				200				30 0,01			
40 39 0,01				8,350 % fällig am 19.04.2023 ^				4,250 % fällig am 15.03.2046 ^			
Envision Healthcare Corp.				UBS Group AG				4,300 % fällig am 15.03.2045 ^			
16,070 % fällig am 29.04.2027				1.670				236 169 0,04			
16,695 % fällig am 28.04.2028 ^				3.458				145 110 0,02			
762 908 0,20				1.250				30 22 0,01			
1.906 1.405 0,30				250				2.011 1.582 0,34			
Intelsat Jackson Holdings S.A.				5,959 % fällig am 12.01.2034				Rio Oil Finance Trust			
9,443 % fällig am 01.02.2029				6,373 % fällig am 15.07.2026				8,200 % fällig am 06.04.2028			
987 984 0,21				6,442 % fällig am 11.08.2028				202 203 0,05			
Lealand Finance Co. BV				6,537 % fällig am 12.08.2033				Sprint LLC			
8,193 % fällig am 28.06.2024				Unique Pub Finance Co. PLC				7,625 % fällig am 01.03.2026			
26 21 0,01				5,659 % fällig am 30.06.2027				2.549 47 49 0,01			
Lealand Finance Co. BV (2,666 % bar oder 3,000 % PIK)				Voyager Aviation Holdings LLC				7,875 % fällig am 15.09.2023			
3,000 % - 6,193 % fällig am 30.06.2025 (b)				8,500 % fällig am 09.05.2026				2.549 49 0,01			
145 84 0,02				33				2.557 0,55			
Poseidon BidCo S.A.S								13.535 2,93			
8,848 % fällig am 14.07.2028								53.686 11,62			
€ 1.900 2.032 0,44											
<b>PUG LLC</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
8,525 % fällig am 12.02.2027				American Airlines Pass-Through Trust				Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022			
\$ 45 40 0,01				3,350 % fällig am 15.04.2031				0,000 % fällig am 01.11.2043			
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				29				457 231 0,05			
9,023 % fällig am 16.11.2025				Carvana Co.				Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010			
87 80 0,02				5,500 % fällig am 15.04.2027				6,630 % fällig am 01.02.2035			
SCUR-Alpha 1503 GmbH				2.120				28 29 0,01			
10,602 % fällig am 28.03.2030				10,250 % fällig am 01.05.2030				14 15 0,00			
998 946 0,21				Community Health Systems, Inc.				Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
SS&C European Holdings SARL				8,000 % fällig am 15.03.2026				6,125 % fällig am 01.07.2040 ^			
6,967 % fällig am 16.04.2025				682				200 75 0,02			
55 56 0,01				Energy Transfer LP				350 0,08			
SS&C Technologies, Inc.				4,950 % fällig am 15.05.2028				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
6,967 % fällig am 16.04.2025				25				<b>Fannie Mae</b>			
66 66 0,01				25				0,850 % fällig am 25.11.2049			
Syniverse Holdings, Inc.				Exela Intermedial LLC				(a)			
12,242 % fällig am 13.05.2027				11,500 % fällig am 15.07.2026				109 14 0,00			
100 92 0,02				57				2,500 % fällig am 25.07.2033			
U.S. Renal Care, Inc.				Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.				(a)			
10,192 % fällig am 26.06.2026				2,949 % fällig am 24.01.2024				42 4 0,00			
192 90 0,02				€ 500				Freddie Mac			
Windstream Services LLC				Intelsat Jackson Holdings S.A.				1,357 % fällig am 15.06.2042			
11,452 % fällig am 21.09.2027				6,500 % fällig am 15.03.2030				(a)			
20 19 0,00				3.988				40 4 0,00			
7.832 1,70				Market Bidco Finco PLC				Ginnie Mae, TBA			
				4,750 % fällig am 04.11.2027				3,500 % fällig am 01.08.2053			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				€ 800				3.600 3.327 0,72			
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				€ 24				4,000 % fällig am 01.08.2053			
Avolon Holdings Funding Ltd.				28 0,01				2.300 2.178 0,47			
2,528 % fällig am 18.11.2027				Mitchells & Butlers Finance PLC				4,500 % fällig am 01.08.2053			
1.580 1.334 0,29				6,013 % fällig am 15.12.2030				13.500 13.037 2,82			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				€ 700				5,000 % fällig am 01.07.2053			
6,750 % fällig am 02.03.2026				700				800 786 0,17			
€ 700 765 0,17				Petroleos de Venezuela S.A.				<b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>			
Banco de Credito del Peru S.A.				5,375 % fällig am 12.04.2027 ^				3,000 % fällig am 01.03.2050 -			
4,650 % fällig am 17.09.2024				707				01.05.2052			
PEN 1.100				762 30 0,01				1.437 1.269 0,28			
Banco Espirito Santo S.A.				6,000 % fällig am 16.05.2024 ^				3,500 % fällig am 01.04.2048 -			
2,625 % fällig am 08.05.2017 ^				642				01.02.2050			
€ 100 27 0,01				518 18 0,00				522 482 0,10			
Barclays PLC				9,750 % fällig am 17.05.2035 ^				4,000 % fällig am 01.08.2039 -			
7,437 % fällig am 02.11.2033				2.084				01.05.2047			
\$ 625 677 0,15				1.586 0,34				1.218 1.162 0,25			
Corestate Capital Holding S.A.				Roadster Finance DAC				<b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b>			
3,500 % fällig am 31.07.2023 ^				2,375 % fällig am 08.12.2032				3,000 % fällig am 01.07.2038 -			
€ 700 108 0,02				€ 100				01.08.2053			
Credit Suisse AG				Topaz Solar Farms LLC				22.400 19.900 4,31			
6,500 % fällig am 08.08.2023				4,875 % fällig am 30.09.2039				28.450 25.955 5,62			
(h)				5,750 % fällig am 30.09.2039				37.200 34.943 7,58			
\$ 1.915 1.908 0,41				€ 596				18.400 17.700 3,83			
Credit Suisse AG AT1 Claim ^				U.S. Renal Care, Inc.				7.300 7.158 1,55			
600 24 0,01				90				20.900 20.798 4,50			
Deutsche Bank AG				10,625 % fällig am 15.07.2027				25.400 25.620 5,55			
3,547 % fällig am 18.09.2031				United Airlines Pass-Through Trust				8.200 8.368 1,81			
4,892 % fällig am 18.05.2029				4,150 % fällig am 11.10.2025							
6,720 % fällig am 18.01.2029				5,875 % fällig am 15.04.2029							
EPR Properties				Valaris Ltd.							
4,750 % fällig am 15.12.2026				8,375 % fällig am 30.04.2030							
4,950 % fällig am 15.04.2028				11							
15 14 0,00				11							
24 21 0,00				Venture Global LNG, Inc.							
GLP Capital LP				8,125 % fällig am 01.06.2028							
5,250 % fällig am 01.06.2025				842							
5,300 % fällig am 15.01.2029				842							
186 177 0,04				842							
HSBC Holdings PLC				Windstream Escrow LLC							
3,973 % fällig am 22.05.2030				1.753							
1.700 1.528 0,33				7,750 % fällig am 15.08.2028							
Morgan Stanley											
0,000 % fällig am 02.04.2032 (j)											
700 437 0,09											
NatWest Group PLC				<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>			
4,445 % fällig am 08.05.2030				Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				U.S. Treasury Bonds			
4,892 % fällig am 18.05.2029				2,950 % fällig am 27.01.2029				2,875 % fällig am 15.11.2046			
5,076 % fällig am 27.01.2030				5.100				2,200 1.814 0,39			
1.400 1.337 0,29				3,188 0,69				4,800 4,051 0,88			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				Pacific Gas & Electric Co.				3,000 % fällig am 15.08.2048			
2,000 % fällig am 01.10.2047				2,950 % fällig am 01.03.2026 ^				20 17 0,00			
DKK 0 0 0,00				1.154				3,000 % fällig am 15.02.2049			
Nykredit Realkredit A/S				3,250 % fällig am 01.06.2031				3,500 % fällig am 15.02.2043			
2,000 % fällig am 01.10.2047				2.460				114 100 0,02			
0 0 0,00				324				3,375 % fällig am 15.05.2044			
				403				3,625 % fällig am 15.08.2043			
								20 18 0,00			
								3,625 % fällig am 15.02.2044			
								372 349 0,08			
								3,750 % fällig am 15.11.2043			
								280 263 0,06			
								160 153 0,03			
								U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)			
								0,125 % fällig am 15.07.2024			
								4,496 4,362 0,94			
								0,125 % fällig am 15.10.2024			
								3,618 3,490 0,76			
								88 84 0,02			
								0,125 % fällig am 15.01.2031			
								117 104 0,02			
								113 100 0,02			
								0,250 % fällig am 15.01.2025			
								1.056 1.013 0,22			



# Aufstellung des Wertpapierbestands des Strategic Income Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	
	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS													AKTIEN
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)	320.208	\$ 439	0,10	Absa Group Ltd.	30.054	\$ 267	0,06	Caterpillar, Inc. (c)	793	\$ 195	0,04	CITIC Ltd.	206.000	247	0,05	
Electronic Arts, Inc.	116	15	0,00	Aflac, Inc.	20.589	1.437	0,31	Eiffage S.A.	2.604	272	0,06	Fuji Electric Co. Ltd. (c)	4.400	193	0,04	
iHeartMedia, Inc. 'A' (c)	75.157	274	0,06	Ageas S.A.	4.843	196	0,04	GEA Group AG	5.191	217	0,05	General Dynamics Corp. (c)	775	167	0,04	
iHeartMedia, Inc. 'B' (c)	58.371	191	0,04	American Financial Group, Inc.	2.565	305	0,07	ITOCHU Corp. (c)	22.600	896	0,19	Mitsubishi Corp. (c)	16.800	811	0,18	
Intelsat Emergence S.A. (c)(j)	54.795	1.260	0,27	American International Group, Inc.	25.993	1.496	0,32	Mitsubishi Heavy Industries Ltd. (c)	4.900	228	0,05	Mitsui & Co. Ltd. (c)	15.900	601	0,13	
Nintendo Co. Ltd. (c)	19.700	897	0,20	Ameriprise Financial, Inc.	3.708	1.232	0,27	PACCAR, Inc.	18.514	1.549	0,33	Siemens AG	1.161	193	0,04	
Orange S.A. (c)	13.263	155	0,03	Assicurazioni Generali SpA AXA S.A.	35.912	730	0,16	SKF AB 'B'	9.354	163	0,03	Thales S.A.	3.724	558	0,12	
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1.657.600	443	0,10	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	213.660	1.641	0,35	United Rentals, Inc.	402	179	0,04	Vinci S.A.	7.520	874	0,19	
Verizon Communications, Inc. (c)	21.266	791	0,17	Banco de Chile	1.611.550	168	0,04	Volvo AB 'B'	14.608	302	0,07					
		4.623	1,00	Banco do Brasil S.A.	29.800	305	0,07			11.240	2,43					
				Bank Mandiri Persero Tbk PT	1.306.400	455	0,10	<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>								
<b>LUXUSGÜTER</b>				Cairo Mezz PLC (c)	59.349	8	0,00	Apple, Inc.	5.777	1.121	0,24	ASE Technology Holding Co. Ltd.	108.000	384	0,08	
Best Buy Co., Inc.	2.137	175	0,04	China Construction Bank Corp. 'H' (c)	3.407.000	2.206	0,48	Broadcom, Inc.	4.263	3.698	0,80	Cisco Systems, Inc. (c)	72.742	3.764	0,82	
Darden Restaurants, Inc. (c)	4.284	716	0,16	China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 'H'	93.400	243	0,05	Largan Precision Co. Ltd.	3.000	206	0,05	Lenovo Group Ltd. (c)	258.000	270	0,06	
eBay, Inc.	3.869	173	0,04	Erste Group Bank AG	12.183	427	0,09	Lite-On Technology Corp.	70.000	233	0,05	MediaTek, Inc.	54.000	1.195	0,26	
Garmin Ltd. (c)	4.118	429	0,09	Eurobank Ergasias Services and Holdings S.A. 'A' (c)	563.329	928	0,20	Microchip Technology, Inc.	8.832	791	0,17	Microsoft Corp. (c)	54	18	0,00	
Genting Singapore Ltd.	213.800	149	0,03	FirstRand Ltd.	178.976	650	0,14	NetApp, Inc. (c)	3.589	274	0,06	Novatek Microelectronics Corp. (c)	20.000	275	0,06	
Genuine Parts Co.	972	165	0,04	Hartford Financial Services Group, Inc.	11.068	797	0,17	NXP Semiconductors NV	2.973	609	0,13	Realtek Semiconductor Corp. (c)	16.000	199	0,04	
Honda Motor Co. Ltd. (c)	17.200	520	0,11	KeyCorp.	32.767	303	0,07	Tokyo Electron Ltd. (c)	1.200	173	0,04	Unimicron Technology Corp. (c)	28.000	159	0,03	
Industria de Diseno Textil S.A. (c)	38.650	1.499	0,32	Legal & General Group PLC	141.183	409	0,09	United Microelectronics Corp.	398.000	625	0,14					
Kia Corp.	9.351	630	0,14	Manulife Financial Corp.	25.880	490	0,11			13.994	3,03					
LKQ Corp.	9.357	545	0,12	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	19.559	234	0,05	<b>BAUSTOFFE</b>								
Mazda Motor Corp. (c)	19.100	184	0,04	Nedbank Group Ltd.	15.397	186	0,04	BHP Group Ltd.	116.278	3.493	0,76	CRH PLC	22.805	1.258	0,27	
Mercedes-Benz Group AG	3.378	272	0,06	PICC Property & Casualty Co. Ltd. 'H'	240.000	267	0,06	Evrax PLC	72.869	0	0,00	Fortescue Metals Group Ltd.	60.077	891	0,19	
Stellantis NV	79.702	1.401	0,30	PNC Financial Services Group, Inc.	1.137	143	0,03	Grupo Mexico S.A.B. de C.V. 'B'	37.400	180	0,04	Heidelberg Materials AG	5.131	422	0,09	
		6.858	1,49	Poste Italiane SpA (c)	17.544	190	0,04	Holcim AG	19.643	1.324	0,29	Impala Platinum Holdings Ltd.	16.830	112	0,02	
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>				Powzechny Zaklad Ubezpieczen S.A. (c)	21.425	208	0,04	LyondellBasell Industries NV 'A'	1.863	171	0,04	Rio Tinto Ltd.	10.965	839	0,18	
Altria Group, Inc.	63.281	2.867	0,62	Principal Financial Group, Inc.	8.608	653	0,14	Rio Tinto PLC	18.252	1.161	0,25	Sibanye Stillwater Ltd.	100.347	154	0,03	
Ambev S.A.	167.500	535	0,12	Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	1.057	184	0,04	Vale S.A.	50.400	671	0,15	Yara International ASA	4.157	147	0,03	
Arca Continental S.A.B. de C.V.	18.500	190	0,04	SpareBank 1 SR-Bank ASA	1.345	16	0,00			10.823	2,34					
British American Tobacco PLC (c)	4.804	160	0,03	State Street Corp.	2.463	180	0,04	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>								
Coca-Cola Co.	56.276	3.389	0,73	Stearns Holdings LLC 'B' (c)	147.250	0	0,00	Enagas S.A. (c)	8.800	173	0,04	Enel SpA (c)	118.558	799	0,17	
Coca-Cola HBC AG	5.493	164	0,03	Synchrony Financial	15.179	515	0,11	Engie S.A.	25.075	418	0,09	Iberdrola S.A. (c)	13.187	172	0,04	
Coles Group Ltd.	14.436	177	0,04	Voyager Aviation Holdings LLC (c)	16	0	0,00	Redeia Corp. S.A.	14.011	236	0,05	Snam SpA	71.450	373	0,08	
Japan Tobacco, Inc. (c)	39.300	859	0,19	<b>GESUNDHEITSWESSEN</b>			20.245	4,38								
Jeronimo Martins SGPS S.A.	9.748	268	0,06	AbbVie, Inc. (c)	16.632	2.241	0,49									
Kao Corp. (c)	4.300	156	0,03	Amgen, Inc.	9.218	2.047	0,44									
Kimberly-Clark Corp.	11.956	1.651	0,36	Astellas Pharma, Inc. (c)	23.900	355	0,08									
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (c)(j)	8.644	1.313	0,28	Chugai Pharmaceutical Co. Ltd. (c)	23.000	654	0,14									
Philip Morris International, Inc.	11.016	1.075	0,23	Gilead Sciences, Inc.	11.997	925	0,20									
President Chain Store Corp. (c)	20.000	182	0,04	GSK PLC	46.697	828	0,18									
Procter & Gamble Co.	17.237	2.616	0,57	Johnson & Johnson	25.471	4.216	0,91									
Suntory Beverage & Food Ltd. (c)	4.600	166	0,04	Merck & Co., Inc.	14.277	1.647	0,36									
Unilever PLC	30.120	1.570	0,34	Novartis AG	28.617	2.886	0,62									
		17.338	3,75	Pfizer, Inc. (c)	67.437	2.474	0,54									
				Roche Holding AG	8.659	2.646	0,57									
<b>ENERGIE</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>			20.919	4,53								
China Shenhua Energy Co. Ltd. 'H'	119.500	366	0,08	3M Co.	17.985	1.800	0,39									
Equinor ASA (c)	22.880	668	0,15	AP Moller - Maersk A/S 'A'	109	190	0,04									
Exxon Mobil Corp.	4.302	461	0,10	Astra International Tbk PT	724.300	329	0,07									
HF Sinclair Corp.	5.377	240	0,05	BAE Systems PLC	108.125	1.276	0,28									
Marathon Petroleum Corp.	15.139	1.765	0,38													
Petroleo Brasileiro S.A.	131.900	905	0,20													
Valero Energy Corp.	13.032	1.529	0,33													
		5.934	1,29													
<b>FINANZWERTE</b>																
3i Group PLC	34.465	855	0,18													

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA (c)	19.286	\$ 164	0,04	Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	93	\$ 22	0,01	Uniti Group, Inc.	1.773	\$ 8	0,00
		2.335	0,51			2.573	0,56	VICI Properties, Inc.	127.561	4.009	0,87
		114.309	24,75					WP Carey, Inc.	16.419	1.109	0,24
										25.108	5,44
<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>											
<b>RECHTE</b>				Apartment Income REIT Corp.	34.879	1.259	0,27	<b>PAR (000S)</b>			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025	11.842	71	0,01	Apple Hospitality REIT, Inc.	90.002	1.360	0,29	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
				Boston Properties, Inc.	16.967	977	0,21	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
				CareTrust REIT, Inc.	29.200	580	0,13	(54,758) % fällig am 18.09.2023 (d)(e) ARS 12.728 25 0,01			
				CBL & Associates Properties, Inc.	378	8	0,00	(28,578) % fällig am 18.10.2023 (d)(e) 160.664 318 0,07			
				Cousins Properties, Inc.	26.939	614	0,13	(12,549) % fällig am 23.11.2023 (d)(e) 150.893 304 0,06			
				Digital Realty Trust, Inc.	12.073	1.375	0,30				
				EPR Properties	25.499	1.193	0,26				
				Equity Residential	10.526	694	0,15	Summe kurzfristige Instrumente 647 0,14			
				Gaming and Leisure Properties, Inc.	37.448	1.815	0,39	Summe Übertragbare Wertpapiere \$ 597.009 129,25			
				Healthcare Realty Trust, Inc.	58.968	1.112	0,24	<b>AKTIEN</b>			
				Healthpeak Properties, Inc.	44.877	902	0,20	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
				Highwoods Properties, Inc.	30.875	738	0,16	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
				Kilroy Realty Corp.	23.258	700	0,15	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g) 2.337.401 23.276 5,04			
				Macerich Co.	51.482	580	0,13	Summe Investmentfonds \$ 23.276 5,04			
				National Storage Affiliates Trust	35.455	1.235	0,27				
				Park Hotels & Resorts, Inc.	100.691	1.291	0,28				
				Physicians Realty Trust	32.220	451	0,10				
				Simon Property Group, Inc.	17.922	2.070	0,45				
				Spirit Realty Capital, Inc.	26.095	1.028	0,22				

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäften zum Wert	Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 2.001	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (2.041)	\$ 2.001	\$ 2.001	0,43
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (2.041)	\$ 2.001	\$ 2.001	0,43

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**FUTURES**

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	15	\$ 100	0,02
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	7	31	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	8	26	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	10	58	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	9	33	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	13	83	0,02
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	7	28	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	9	27	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	10	51	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	6	21	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	103	43	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	42	58	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	12	(26)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	412	(712)	(0,16)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	11	(13)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	154	6	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	126	(247)	(0,05)
				\$ (433)	(0,09)

**VERKAUFSOPTIONEN****OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	6	\$ (3)	\$ (2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	6	(2)	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	2	(1)	0	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Strategic Income Fund (Fort.)

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	\$ 131,000	21.07.2023	2	\$ (1)	\$ 0	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	8	(13)	(1)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	9	(18)	(2)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	8	(15)	(2)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	13	(25)	(1)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	13	(27)	(2)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	8	(7)	0	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	8	(15)	(28)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	9	(18)	(33)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	8	(15)	(31)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	13	(26)	(52)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	13	(28)	(57)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	8	(7)	(38)	(0,01)
				\$ (221)	\$ (249)	(0,06)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ (682) (0,15)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 300	\$ 16	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-30 5-Year Index	1,000 %	20.12.2023	\$ 3.145	\$ 161	0,03
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000	20.06.2024	946	39	0,01
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	510	24	0,01
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	2.208	11	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	6.440	120	0,03
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	900	39	0,01
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	1.900	50	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	1.862	(83)	(0,02)
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	882	(4)	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	2.772	77	0,02
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	6.100	147	0,03
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	600	6	0,00
				\$ 587	0,13

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500 %	20.09.2033	£ 6.200	\$ 450	0,10
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	¥ 2.430.000	313	0,07
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,020	20.09.2028	2.950.000	318	0,07
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	160.000	0	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	410.000	27	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	220.000	50	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	40.000	11	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.07.2023	\$ 1.400	19	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	18.07.2023	1.100	15	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	02.08.2023	300	4	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	52.700	727	0,16
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	06.09.2023	2.300	32	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.09.2023	33.800	(472)	(0,10)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	50.200	(716)	(0,16)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	20.09.2023	10.900	(152)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	32.900	3.177	0,69
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	26.200	(2.550)	(0,55)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	15.12.2024	53.300	(3.044)	(0,66)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	13.442	(1.476)	(0,32)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	16.200	2.109	0,46
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,940	08.06.2026	2.000	185	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	15.700	(1.518)	(0,33)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	1.200	89	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	2.770	(322)	(0,07)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	1.766	308	0,07
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,235	12.05.2028	700	88	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	500	58	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	33.800	4.124	0,89



Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250 %	17.06.2027	\$ 12.000	\$ (1.715)	(0,37)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2028	3.900	(587)	(0,13)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	47.620	5.294	1,15
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	5.950	(641)	(0,14)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	4.300	(923)	(0,20)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	52.700	(863)	(0,19)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,350	20.01.2027	3.400	339	0,07
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	20.07.2031	800	140	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,370	19.07.2031	500	87	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	1.400	(146)	(0,03)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,405	07.09.2031	1.300	222	0,05
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	1.000	(95)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,443	18.01.2027	1.100	(111)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	2.400	227	0,05
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	1.200	205	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,491	21.01.2051	900	(310)	(0,07)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	7.130	(990)	(0,21)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	12.01.2029	578	74	0,02
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	05.10.2031	600	(99)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	600	(97)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	22.10.2031	400	(64)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,545	26.10.2031	400	(64)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,550	20.01.2027	15.100	(1.358)	(0,29)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,570	11.01.2027	800	(73)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	900	(79)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,590	09.02.2051	7.200	(2.366)	(0,51)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	6.600	242	0,05
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,625	16.01.2050	3.100	1.025	0,22
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,625	03.02.2050	3.900	1.290	0,28
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	06.03.2024	2.300	(55)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	9.600	(797)	(0,17)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	12.01.2029	2.100	(238)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,740	16.12.2026	1.100	105	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	26.000	850	0,18
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	1.209	58	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.878	102	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.840	(174)	(0,04)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	22.01.2050	7.600	2.377	0,51
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,768	02.02.2032	300	(46)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	700	222	0,05
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	2.200	(297)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,872	06.04.2032	1.100	(143)	(0,03)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,875	07.02.2050	400	115	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,895	18.10.2049	700	214	0,05
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,910	17.10.2049	700	211	0,05
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	1.100	(90)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	1.250	29	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	5.740	136	0,03
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	18.02.2032	900	(113)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	9.130	209	0,04
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.01.2050	1.400	380	0,08
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	6.500	(2.182)	(0,47)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	11.12.2049	7.100	1.562	0,34
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	12.03.2050	3.400	745	0,16
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	4.600	167	0,04
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	7.900	184	0,04
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	15.900	377	0,08
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,500	18.12.2024	6.000	534	0,12
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,500	20.12.2024	10.900	191	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,850	30.08.2027	1.000	(52)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,955	04.10.2027	1.000	(46)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	19.06.2024	41.600	2.177	0,47
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	19.06.2026	32.300	2.287	0,49
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	2.090	28	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	2.800	95	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	160	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	500	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	500	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	700	(30)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	200	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	500	(20)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	690	9	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	590	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	300	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	14.06.2033	1.000	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	600	(34)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	200	6	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	400	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	300	(4)	0,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Strategic Income Fund (Fort.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450 %	07.03.2033	\$ 600	\$ (6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	600	(10)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	900	(8)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.05.2033	29.660	(83)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	600	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	200	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	400	3	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	16.970	(42)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	13.12.2027	900	16	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	600	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,040	20.06.2024	2.000	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,060	20.06.2024	8.100	(60)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,140	22.06.2024	3.400	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	65.460	(279)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	37.050	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,100	22.05.2024	126.930	(140)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,400	06.06.2024	71.750	63	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	02.01.2025	BRL 1.300	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,160	02.01.2025	800	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,220	04.01.2027	1.500	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,245	04.01.2027	700	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,260	04.01.2027	800	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,350	02.01.2025	1.000	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,700	04.01.2027	400	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,715	04.01.2027	1.700	9	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	04.01.2027	4.000	25	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,000	02.01.2025	2.800	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,080	02.01.2025	4.700	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,140	02.01.2025	2.300	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,145	02.01.2025	2.300	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,160	02.01.2025	4.700	5	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.07.2023	\$ 1.400	(19)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	18.07.2023	1.100	(15)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	02.08.2023	300	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	52.700	(723)	(0,16)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	06.09.2023	2.300	(32)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.09.2023	33.800	480	0,10
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	50.200	721	0,16
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	20.09.2023	10.900	153	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023	26.200	(343)	(0,07)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	15.09.2023	53.300	(656)	(0,14)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.09.2023	13.442	(167)	(0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,940	08.09.2023	2.000	24	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.09.2023	1.766	21	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,235	12.08.2023	700	8	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.09.2023	500	6	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023	4.300	(48)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.09.2023	35.620	382	0,08
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,350	20.07.2023	3.400	23	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	20.07.2023	800	5	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,370	19.07.2023	500	3	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,405	07.09.2023	1.300	9	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,425	18.07.2023	1.000	(6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	16.07.2023	1.200	7	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	17.08.2023	2.400	15	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,491	21.07.2023	900	(5)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	05.07.2023	600	(6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	12.07.2023	578	3	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023	7.130	(74)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	15.07.2023	600	(6)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	22.07.2023	400	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	26.07.2023	400	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,550	20.07.2023	15.100	(85)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	11.07.2023	800	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	16.08.2023	900	(5)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,590	09.08.2023	7.200	(41)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	16.07.2023	3.100	16	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	03.08.2023	3.900	21	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	12.07.2023	2.100	(10)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	17.08.2023	9.600	(50)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	22.07.2023	7.600	35	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2023	700	4	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,875	07.08.2023	400	2	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,895	18.07.2023	700	6	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,910	17.07.2023	700	6	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.07.2023	1.400	5	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	18.08.2023	900	(3)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.09.2023	6.500	(60)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	11.09.2023	7.100	60	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	12.09.2023	3.400	10	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.09.2023	6.000	46	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.09.2023	73.900	477	0,10

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750 %	17.06.2026	AUD 460	\$ (18)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	18.640	(979)	(0,21)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024	1.600	(81)	(0,02)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025	19.492	(1.255)	(0,27)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024	650	(59)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	18.06.2024	400	(42)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	18.03.2030	€ 6.200	1.255	0,27
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	2.300	1.001	0,22
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	100	11	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	200	18	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	100	7	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024	200	10	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,453	29.12.2023	200	5	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	6.800	331	0,07
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	21.09.2032	11.880	(1.115)	(0,24)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	1.400	(22)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	2.900	(46)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	1.300	(22)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	1.400	(19)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	1.300	(19)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	1.300	(19)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	800	(18)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	3.700	(44)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,160	06.06.2025	MXN 9.300	(46)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,535	04.05.2027	18.500	(112)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,950	30.01.2026	12.300	5	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,980	26.08.2024	500	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,990	30.01.2026	15.000	5	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	10.03.2026	20.700	1	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,350	01.09.2023	3.300	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,490	08.09.2026	13.700	(9)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,620	18.02.2030	600	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,710	20.09.2029	500	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,150	11.06.2027	28.100	(49)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,165	06.09.2032	3.000	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,200	11.06.2027	2.900	(5)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,360	21.08.2037	3.100	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,370	11.10.2027	14.800	(30)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,380	04.11.2026	400	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,380	14.08.2037	700	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,480	18.06.2037	1.300	(3)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,495	14.01.2032	8.100	(15)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,498	15.01.2032	33.500	(64)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,603	14.04.2025	49.000	(116)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	15.04.2025	3.000	(7)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,670	05.03.2025	52.900	(111)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,710	07.03.2025	6.400	(14)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,715	07.03.2025	6.300	(13)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,800	28.12.2027	2.900	4	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,818	17.02.2027	11.400	(35)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,865	02.02.2027	11.900	(37)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,910	30.12.2027	600	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,984	10.12.2027	6.800	7	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,990	21.12.2027	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,005	21.12.2027	37.500	60	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,010	04.02.2027	5.200	(18)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,030	31.01.2028	4.600	4	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,050	31.01.2028	3.400	2	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,090	15.01.2027	13.000	(48)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,103	04.01.2038	5.600	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,120	15.01.2027	2.700	(10)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,410	31.03.2027	11.100	5	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,660	04.04.2024	38.500	43	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,675	03.04.2024	92.600	103	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,701	31.03.2032	19.500	(41)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,730	06.04.2027	16.500	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,732	30.03.2032	8.200	(18)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,750	05.04.2024	39.700	43	0,01
Zahlung	UKRPI	4,000	15.09.2031	£ 300	(57)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,020	15.10.2031	400	(73)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,055	15.09.2031	400	(75)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031	600	(101)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,140	15.10.2031	1.000	(168)	(0,04)
Zahlung	UKRPI	4,250	15.11.2031	900	(128)	(0,03)
Zahlung	UKRPI	4,400	15.10.2031	400	(59)	(0,01)
					<b>\$ 6.699</b>	<b>1,45</b>
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 7.302</b>	<b>1,58</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, (ii) oder er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Strategic Income Fund (Fort.)

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIONEN									
ZINSSWAPOPTIONEN									
Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	1.100	\$ (3)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	1.100	(3)	(15)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2023	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	300	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	100	0	(1)	0,00
BRC	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	200	0	0	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	200	0	(1)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	300	(2)	0	0,00
CBK	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	300	(2)	(6)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	1.000	(6)	0	0,00
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	1.000	(6)	(23)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,688	02.04.2024	600	(5)	(1)	0,00
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,688	02.04.2024	600	(5)	(11)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,781	05.04.2024	1.000	(8)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,781	05.04.2024	1.000	(8)	(18)	(0,01)
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,100	31.08.2023	800	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	31.08.2023	800	(6)	(8)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	700	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	700	(4)	(15)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	500	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	500	(3)	(10)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	500	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	500	(4)	(10)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	500	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	500	(4)	(9)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	500	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	500	(3)	(9)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	600	(4)	(12)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	600	(4)	(13)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	600	(4)	(12)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	600	(4)	(13)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	1.100	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	1.100	(4)	(14)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	1.100	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	1.100	(4)	(15)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	1.100	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	1.100	(3)	(14)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	1.200	(9)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	1.200	(9)	(22)	(0,01)
Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	600	(5)	(1)	0,00	
Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	600	(5)	(11)	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	300	(1)	(1)	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	300	(1)	(2)	0,00	
Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	200	(1)	0	0,00	
Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	200	(1)	(1)	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	200	(1)	0	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	200	(1)	0	0,00	
Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	300	(1)	0	0,00	
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	300	(1)	(1)	0,00	
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	600	(4)	(13)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	200	(1)	0	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300 %	10.07.2023	200	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	300	(1)	(1)	0,00
							\$ (212)	\$ (291)	(0,06)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	\$ 95,875	07.08.2023	500	\$ (3)	\$ (2)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	97,875	07.08.2023	500	(3)	(1)	0,00
					\$ (6)	\$ (3)	0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	\$ 400	\$ (29)	\$ 27	\$ (2)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(11)	7	(4)	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	200	(18)	9	(9)	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	300	(14)	8	(6)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	(62)	58	(4)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	(36)	28	(8)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	940	(110)	73	(37)	(0,01)
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	(9)	13	4	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	200	(2)	3	1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	2	0	2	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(4)	1	(3)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	700	(11)	17	6	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(10)	6	(4)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	(9)	14	5	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(4)	1	(3)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	100	(9)	5	(4)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	(7)	16	9	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	300	(5)	5	0	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(5)	5	0	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	(36)	28	(8)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	900	(101)	66	(35)	(0,01)
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(6)	7	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.000	(29)	37	8	0,00
JPM	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(3)	3	0	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	300	(2)	6	4	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	800	(44)	45	1	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	200	(7)	1	(6)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	200	(18)	9	(9)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	(5)	11	6	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.100	3	9	12	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(1)	5	4	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	1.700	(39)	37	(2)	0,00
					\$ (642)	\$ 562	\$ (80)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110 %	25.05.2046	\$ 311	\$ (73)	\$ 61	\$ (12)	0,00
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(7)	5	(2)	0,00
	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17.01.2047	225	(10)	10	0	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	25	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	1	0	0	0	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	16.000	(8)	(56)	(64)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	7.300	(38)	(13)	(51)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	1	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	8.700	(339)	337	(2)	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	298	(12)	11	(1)	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	(2)	(6)	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	200	(11)	11	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	596	(47)	46	(1)	0,00
MYC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	493	(115)	95	(20)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	(2)	(6)	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	1	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	6	0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	2.075	17	(25)	(8)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	1.200	6	(14)	(8)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	(1)	(2)	(3)	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Strategic Income Fund (Fort.)

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
UAG	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500 %	17.09.2058	\$ 15.400	\$ 15	\$ (44)	\$ (29)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	6	0	0,00
					\$ (643)	\$ 430	\$ (213)	(0,04)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 1.090	\$ 723	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07.2023	\$ 245	AUD 375	4	0	4	0,00
BOA	08.2023	724	1.090	2	0	2	0,00
	07.2023	KRW 122.877	\$ 94	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	MXN 14.546	790	0	(57)	(57)	(0,01)
	07.2023	\$ 1.369	AUD 2.099	29	0	29	0,01
BRC	08.2023	1.357	NZD 2.140	0	(46)	(46)	(0,01)
	09.2023	TWD 14.084	\$ 464	11	0	11	0,00
CBK	09.2023	\$ 762	KRW 965.543	0	(26)	(26)	(0,01)
	07.2023	AUD 865	\$ 572	0	(4)	(4)	0,00
CLY	07.2023	CHF 141	157	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW 18.299	14	0	0	0	0,00
DUB	07.2023	\$ 10.660	€ 9.729	0	(45)	(45)	(0,01)
	07.2023	436	£ 343	0	0	0	0,00
FAR	07.2023	6.065	¥ 842.591	0	(236)	(236)	(0,05)
	08.2023	CNH 2.308	\$ 334	16	0	16	0,00
GLM	08.2023	€ 9.571	10.502	45	0	45	0,01
	08.2023	KRW 1.222.113	932	3	0	3	0,00
JPM	08.2023	TWD 7.050	231	4	0	4	0,00
	08.2023	\$ 517	AUD 779	3	0	3	0,00
MEX	08.2023	157	CHF 140	0	0	0	0,00
	08.2023	9	CNY 62	0	(1)	(1)	0,00
NOR	08.2023	678	INR 55.704	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR 14.618	\$ 788	17	0	17	0,00
PER	09.2023	\$ 906	IDR 13.614.837	0	(2)	(2)	0,00
	10.2023	ZAR 36.636	\$ 1.968	50	0	50	0,01
RUS	12.2023	MXN 555	31	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW 124.146	95	1	0	1	0,00
SWE	08.2023	ZAR 15.914	857	19	(1)	18	0,00
	09.2023	IDR 24.061	2	0	0	0	0,00
TWN	07.2023	PEN 3.410	939	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 990	CLP 801.308	8	0	8	0,00
UKL	07.2023	918	PEN 3.410	23	0	23	0,01
	08.2023	TWD 7.339	\$ 240	5	0	5	0,00
USA	08.2023	\$ 1.041	CLP 851.403	13	0	13	0,00
	08.2023	710	NOK 7.408	0	(18)	(18)	0,00
VIE	08.2023	536	PEN 2.094	40	0	40	0,01
	09.2023	KRW 123.275	\$ 95	1	0	1	0,00
WAL	08.2023	\$ 802	NOK 8.403	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	PEN 3.410	\$ 932	0	(8)	(8)	0,00
YEM	07.2023	\$ 6.131	BRL 33.218	756	0	756	0,16
	07.2023	1.871	PEN 6.820	10	0	10	0,00
ZAF	10.2023	ZAR 3.684	\$ 202	9	0	9	0,00
	07.2023	\$ 2	CLP 1.229	0	0	0	0,00
ZAR	07.2023	BRL 33.323	\$ 6.901	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	KRW 48.362	37	0	0	0	0,00
ZIN	08.2023	583.955	444	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 1.047	INR 86.012	0	0	0	0,00
ZKR	08.2023	312	NOK 3.313	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	6.901	BRL 33.692	5	0	5	0,00
ZMX	10.2023	ZAR 6.536	\$ 348	6	0	6	0,00
	07.2023	£ 343	434	0	(2)	(2)	0,00
ZNY	07.2023	¥ 286.941	2.006	21	0	21	0,00
	07.2023	MXN 4.651	270	0	(1)	(1)	0,00
ZOR	08.2023	CNH 1.853	268	13	0	13	0,00
	08.2023	KRW 102.898	78	0	0	0	0,00
ZPK	08.2023	\$ 10	CNY 66	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	434	£ 343	2	0	2	0,00
ZRU	08.2023	2.006	¥ 285.722	0	(21)	(21)	0,00
	08.2023	115	NOK 1.222	0	(1)	(1)	0,00
ZSE	08.2023	167	ZAR 3.060	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	IDR 40.474	\$ 3	0	0	0	0,00
ZSI	09.2023	KRW 343.306	264	2	0	2	0,00
	09.2023	PEN 1.888	513	0	(5)	(5)	0,00
ZTH	09.2023	\$ 1	IDR 8.789	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	12.2023	\$ 713	INR 58.839	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
MBC	07.2023	£ 5.561	\$ 6.884	0	(187)	(187)	(0,04)
	08.2023	NZD 447	272	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	\$ 1.403	KRW 1.789.835	0	(39)	(39)	(0,01)
MYI	07.2023	IDR 122.234	\$ 8	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 292	€ 268	0	0	0	0,00
	07.2023	8	IDR 122.234	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD 14.254	\$ 469	11	0	11	0,00
	08.2023	\$ 113	ZAR 2.076	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	IDR 122.340	\$ 8	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW 663.661	511	5	0	5	0,00
	09.2023	\$ 496	IDR 7.402.494	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	1.572	KRW 2.011.485	0	(39)	(39)	(0,01)
RBC	07.2023	AUD 101	\$ 69	2	0	2	0,00
	07.2023	\$ 5.141	MXN 98.927	618	0	618	0,13
	08.2023	MXN 19.475	\$ 1.124	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2023	AUD 1.601	1.063	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	\$ 1.443	AUD 2.209	27	0	27	0,01
	07.2023	165	CHF 148	1	0	1	0,00
	08.2023	CNH 878	\$ 128	7	0	7	0,00
	08.2023	NZD 2.360	1.435	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	TWD 5.257	172	3	0	3	0,00
	08.2023	\$ 1.064	AUD 1.601	3	0	3	0,00
	08.2023	724	CNH 4.969	0	(38)	(38)	(0,01)
	08.2023	474	NZD 760	0	(9)	(9)	0,00
	09.2023	KRW 122.797	\$ 95	1	0	1	0,00
	09.2023	TWD 11.780	386	7	0	7	0,00
	09.2023	\$ 2.122	IDR 31.725.606	0	(14)	(14)	0,00
	09.2023	ZAR 9.141	\$ 521	41	0	41	0,01
SOG	07.2023	€ 9.729	10.466	0	(149)	(149)	(0,03)
	07.2023	\$ 1.620	AUD 2.476	28	0	28	0,01
SSB	07.2023	CLP 803.688	\$ 1.000	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW 91.511	70	0	0	0	0,00
	07.2023	PEN 3.410	935	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	\$ 1.000	CLP 806.009	0	0	0	0,00
	08.2023	934	PEN 3.410	5	0	5	0,00
	09.2023	2.916	BRL 14.782	115	0	115	0,03
	12.2023	73	INR 6.025	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	AUD 1.971	\$ 1.302	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	\$ 857	AUD 1.310	15	0	15	0,00
	07.2023	7.066	£ 5.561	4	0	4	0,00
	08.2023	£ 5.561	\$ 7.068	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	\$ 1.303	AUD 1.971	10	0	10	0,00
UAG	07.2023	AUD 3.141	\$ 2.097	11	(4)	7	0,00
	07.2023	\$ 196	AUD 300	3	0	3	0,00
	08.2023	2.099	3.141	4	(11)	(7)	0,00
	08.2023	ZAR 12.317	\$ 642	1	(8)	(7)	0,00
	09.2023	6.658	380	30	0	30	0,01
				\$ 2.071	\$ (1.052)	\$ 1.019	0,22

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschuttend II, Class T EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	07.2023	AUD 348	\$ 228	\$ 0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	\$ 509	AUD 767	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD 767	\$ 510	0	(2)	(2)	0,00
BOA	07.2023	437	284	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	DKK 536	77	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	€ 1.281	1.400	2	0	2	0,00
	07.2023	¥ 85.765	617	23	0	23	0,01
	07.2023	KRW 4.104	3	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK 2.048	186	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	SEK 192	18	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 3	BRL 15	0	0	0	0,00
	07.2023	143	DKK 974	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	130.129	€ 121.072	1.962	0	1.962	0,41
	08.2023	DKK 972	\$ 143	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	BRL 0	0	0	0	0	0,00
	07.2023	CHF 93	103	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	DKK 2	0	0	0	0	0,00
	07.2023	€ 120.359	131.874	563	(1)	562	0,12
	07.2023	¥ 928.272	6.681	259	0	259	0,06
	07.2023	TWD 73.345	2.395	40	0	40	0,01
	07.2023	\$ 363	AUD 549	2	0	2	0,00
	07.2023	7.673	CHF 6.862	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	401	CNY 2.900	0	(2)	(2)	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Strategic Income Fund (Fort.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2023	\$	128.372	€	119.415	\$	1.910	0,41
	07.2023		46	NOK	500		0	0,00
	08.2023	AUD	549	\$	364		(2)	0,00
	08.2023	CHF	6.843		7.673		3	0,00
	08.2023	CNY	2.895		401		1	0,00
	08.2023	NOK	499		46		0	0,00
	08.2023	\$	130.715	€	119.131		(566)	(0,12)
BRC	07.2023		941	KRW	1.241.307		2	0,00
	08.2023	KRW	1.239.746	\$	941		(2)	0,00
CBK	07.2023	CAD	2.202		1.616		(48)	(0,01)
	07.2023	€	115.521		125.490		(546)	(0,12)
	07.2023	MXN	7.597		422		(21)	0,00
	07.2023	NOK	182		16		(1)	0,00
	07.2023	\$	1.119	BRL	5.351		(10)	0,00
	07.2023		191	ILS	691		(4)	0,00
	07.2023		442	MXN	7.597		1	0,00
	07.2023		2.361	TWD	73.569		1	0,00
	08.2023	BRL	5.351	\$	1.113		9	0,00
	08.2023	ILS	691		191		4	0,00
	08.2023	MXN	7.597		440		(1)	0,00
	08.2023	TWD	73.570		2.361		0	0,00
	08.2023	\$	115.169	€	105.782		398	0,09
CLY	07.2023	DKK	1.576	\$	228		(3)	0,00
	07.2023	\$	193	CHF	173		1	0,00
	08.2023	CHF	173	\$	193		(1)	0,00
GLM	07.2023	BRL	5.367		1.072		(41)	(0,01)
	07.2023	MYR	1.764		393		15	0,00
	07.2023	\$	286	NOK	3.082		2	0,00
	08.2023	NOK	3.079	\$	286		(2)	0,00
JPM	07.2023	€	118.969		129.903		107	0,02
	07.2023	INR	15.846		191		(2)	0,00
	07.2023	\$	193	INR	15.854		0	0,00
	07.2023		2.415	¥	345.326		(25)	(0,01)
	07.2023		47	SGD	64		0	0,00
	08.2023	INR	15.868	\$	193		0	0,00
	08.2023	¥	343.859		2.415		26	0,01
	08.2023	SGD	64		47		0	0,00
	08.2023	\$	130.084	€	118.969		(11)	(0,02)
MBC	07.2023	CAD	1	\$	1		0	0,00
	07.2023	CNY	20		3		0	0,00
	07.2023	€	3.969		4.268		(63)	(0,01)
	07.2023	£	4.119		5.099		(138)	(0,03)
	07.2023	SGD	1.233		912		2	0,00
	07.2023	\$	615	£	494		12	0,00
MYI	07.2023	ILS	690	\$	185		(1)	0,00
	07.2023	SEK	9.623		896		6	0,00
	07.2023	\$	644	CHF	583		8	0,00
	07.2023		127	DKK	868		0	0,00
	07.2023		538	IDR	8.101.622		2	0,00
	07.2023		380	MYR	1.764		(2)	0,00
	07.2023		910	SEK	9.830		0	0,00
	07.2023		945	SGD	1.277		(2)	0,00
	07.2023	ZAR	5.401	\$	275		(11)	0,00
	08.2023	DKK	867		127		0	0,00
	08.2023	IDR	8.104.686		538		(1)	0,00
	08.2023	MYR	1.764		381		2	0,00
	08.2023	SEK	9.818		910		0	0,00
	08.2023	SGD	1.275		945		1	0,00
SCX	07.2023	CHF	7.227		8.044		(35)	(0,01)
	07.2023	\$	748	AUD	1.127		2	0,00
	07.2023		1	IDR	11.432		0	0,00
	08.2023	AUD	1.127	\$	749		(2)	0,00
SOG	07.2023		2.302		1.506		(26)	(0,01)
	07.2023	HKD	21.181		2.706		3	0,00
	07.2023	\$	128.459	€	119.415		1.822	0,39
	07.2023		289	ZAR	5.408		(3)	0,00
	08.2023	ZAR	5.423	\$	289		3	0,00
TOR	07.2023	AUD	1.218		797		(14)	0,00
	07.2023	\$	916	AUD	1.387		7	0,00
	07.2023		1.665	CAD	2.203		1	0,00
	07.2023		4.607	£	3.625		2	0,00
	07.2023		4.644	¥	668.664		(17)	0,00
	08.2023	AUD	1.387	\$	917		(7)	0,00
	08.2023	CAD	2.202		1.665		(1)	0,00
	08.2023	£	3.625		4.608		(2)	0,00
	08.2023	¥	665.829		4.644		17	0,00
UAG	07.2023	AUD	279		183		(3)	0,00
	07.2023	CHF	471		524		(2)	0,00
	07.2023	CNY	2.887		411		13	0,00
	07.2023	IDR	8.070.857		538		0	0,00
	07.2023	KRW	1.235.012		937		(1)	0,00
	07.2023	NOK	1.495		135		(4)	0,00
	07.2023	SGD	109		81		0	0,00



Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	\$ 500	AUD 756	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07.2023	189	CHF 169	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD 756	\$ 500	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	CHF 168	189	0	0	0	0,00
				\$ 7.246	\$ (1.752)	\$ 5.494	1,18

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	AUD 1	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	CNY 2	0	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK 1	0	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW 692	1	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK 2	0	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK 0	0	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 0	BRL 0	0	0	0	0,00
	07.2023	0	DKK 0	0	0	0	0,00
	07.2023	2	£ 1	0	0	0	0,00
	07.2023	1	SEK 6	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	08.2023	SEK 6	1	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	CHF 0	0	0	0	0	0,00
	07.2023	¥ 606	4	0	0	0	0,00
	07.2023	TWD 46	2	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 0	AUD 0	0	0	0	0,00
	07.2023	5	CHF 4	0	0	0	0,00
	07.2023	0	CNY 2	0	0	0	0,00
	07.2023	6	€ 6	0	0	0	0,00
	07.2023	83	£ 67	2	0	2	0,00
	07.2023	0	NOK 2	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF 4	5	0	0	0	0,00
	08.2023	CNY 2	0	0	0	0	0,00
	08.2023	€ 6	6	0	0	0	0,00
CBK	08.2023	NOK 2	0	0	0	0	0,00
	07.2023	CAD 1	1	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN 4	0	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK 0	0	0	0	0	0,00
	07.2023	TWD 5	0	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 1	BRL 3	0	0	0	0,00
	07.2023	0	MXN 8	0	0	0	0,00
	07.2023	2	TWD 51	0	0	0	0,00
	08.2023	BRL 3	\$ 1	0	0	0	0,00
	08.2023	MXN 8	0	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD 51	2	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	BRL 3	1	0	0	0	0,00
	07.2023	£ 69	87	0	0	0	0,00
	07.2023	INR 2	0	0	0	0	0,00
	07.2023	SGD 1	0	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 0	INR 2	0	0	0	0,00
	07.2023	2	¥ 226	0	0	0	0,00
	08.2023	INR 2	\$ 0	0	0	0	0,00
	08.2023	¥ 225	2	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 87	£ 69	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	ILS 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN 4	0	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK 6	1	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 0	DKK 0	0	0	0	0,00
	07.2023	83	£ 67	2	0	2	0,00
	07.2023	0	IDR 4.788	0	0	0	0,00
	07.2023	0	SGD 1	0	0	0	0,00
	07.2023	ZAR 5	\$ 0	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK 0	0	0	0	0	0,00
	08.2023	IDR 4.790	0	0	0	0	0,00
	08.2023	SGD 1	0	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	CAD 0	0	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	CHF 4	5	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR 4.763	0	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 1	AUD 1	0	0	0	0,00
	07.2023	81	£ 65	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD 1	\$ 1	0	0	0	0,00
SOG	07.2023	1	1	0	0	0	0,00
	07.2023	€ 6	6	0	0	0	0,00
	07.2023	HKD 12	2	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 0	ZAR 9	0	0	0	0,00
	07.2023	ZAR 4	\$ 0	0	0	0	0,00
	08.2023	9	0	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	AUD 1	0	0	0	0	0,00
	07.2023	£ 69	88	0	0	0	0,00
	07.2023	¥ 59	0	0	0	0	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Strategic Income Fund (Fort.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	07.2023	\$	1	AUD	1	\$	0	0,00
	07.2023		1	CAD	2		0	0,00
	07.2023		3	¥	438		0	0,00
	08.2023	AUD	1	\$	1		0	0,00
	08.2023	CAD	2		1		0	0,00
	08.2023	¥	436		3		0	0,00
	08.2023	\$	88	£	69		0	0,00
UAG	07.2023		0	AUD	1		0	0,00
	07.2023		0	CHF	0		0	0,00
	07.2023		0	ILS	0		0	0,00
	08.2023	AUD	1	\$	0		0	0,00
	08.2023	CHF	0		0		0	0,00
	08.2023	ILS	0		0		0	0,00
						\$	6	0,00
						\$	0	
						\$	6	0,00
						\$	5.932	1,28

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.08.2053	\$	10.600	(8,659)
5,500 % fällig am 01.07.2053 (i)		300	(299)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$	(8,958)
Summe Anlagen		\$	625.880
Sonstige Aktiva und Passiva		\$	(163.944)
Nettovermögen		\$	461.936

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (g) Mit dem Fonds verbunden.
- (h) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (i) Zum 30. Juni 2023 leerverkaufter Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,64 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Intelsat Emergence S.A.	19.06.2017 - 23.02.2022	\$ 5.147	\$ 1.260	0,27
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	11.02.2020	613	437	0,09
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	278	1.313	0,28
		\$ 6.038	\$ 3.010	0,64

Barmittel in Höhe von 10.060 USD (31. Dezember 2022: 10.994 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 935 USD (31. Dezember 2022: 376 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

**Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 84.562	\$ 505.390	\$ 7.057	\$ 597.009
Investmentfonds	23.276	0	0	23.276
Pensionsgeschäfte	0	2.001	0	2.001
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	101	12.483	(32)	12.552
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(8.958)	0	(8.958)
<b>Summen</b>	<b>\$ 107.939</b>	<b>\$ 510.916</b>	<b>\$ 7.025</b>	<b>\$ 625.880</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 88.708	\$ 512.322	\$ 9.530	\$ 610.560
Investmentfonds	29.661	0	0	29.661
Pensionsgeschäfte	0	781	0	781
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	840	15.599	0	16.439
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(13.092)	0	(13.092)
<b>Summen</b>	<b>\$ 119.209</b>	<b>\$ 515.610</b>	<b>\$ 9.530</b>	<b>\$ 644.349</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 1.849	\$ (1.360)	\$ 489	\$ (103)	\$ 0	\$ (103)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	(10)	0	(10)
BPS	2.046	(1.790)	256	12	0	12
BRC	(38)	0	(38)	(125)	0	(125)
CBK	(145)	260	115	3.416	(3.380)	36
CLY	(19)	0	(19)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	742	(660)	82	(14)	0	(14)
FAR	(40)	0	(40)	(25)	0	(25)
GLM	(209)	0	(209)	(221)	81	(140)
GST	(154)	261	107	(156)	191	35
HUS	9	0	9	17	0	17
JPM	k. A.	k. A.	k. A.	67	0	67
MBC	(412)	320	(92)	2.861	(2.480)	381
MEI	(7)	0	(7)	(4)	0	(4)
MYC	(35)	94	59	(63)	94	31
MYI	(27)	(40)	(67)	(71)	(96)	(167)
RBC	617	(520)	97	21	0	21
SAL	(51)	0	(51)	(26)	0	(26)
SCX	(18)	0	(18)	3.628	(3.470)	158
SOG	1.678	(1.250)	428	(53)	0	(53)
SSB	115	0	115	11	0	11
TOR	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	29	0	29	(41)	10	(31)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	72,54	59,01
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	56,63	59,05
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,08	2,47
Investmentfonds	5,04	5,86
Pensionsgeschäfte	0,43	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,15)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,58	1,34
Freiverkehrsfinanzderivate	1,28	1,80
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,94)	(2,58)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,70	1,83
Unternehmensanleihen und Wechsel	11,62	14,21
Kommunalanleihen und Wechsel	0,08	0,08
US-Regierungsbehörden	39,56	31,14
US-Schatzobligationen	18,21	14,89
Non-Agency-MBS	5,95	5,69
Forderungsbesicherte Wertpapiere	17,68	16,75
Staatsemissionen	3,54	4,32
Stammaktien	24,75	24,18
Bezugsrechte	0,01	0,02
Optionsscheine	0,01	0,01
Vorzugswertpapiere	0,56	0,42
Real Estate Investment Trusts	5,44	5,31
Kurzfristige Instrumente	0,14	1,68
Investmentfonds	5,04	5,86
Pensionsgeschäfte	0,43	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,09)	0,10
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,06)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,13	0,21
Zinsswaps	1,45	1,12
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,06)	(0,09)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	(0,05)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,04)	(0,02)
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,22	0,05
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,18	1,91
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,94)	(2,58)
Sonstige Aktiva und Passiva	(35,49)	(27,20)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				<b>BANKEN UND FINANZEN</b>			
AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % fällig am 14.08.2024	\$ 4.400	\$ 4.230	0,10	Digital Dutch Finco BV 0,625 % fällig am 15.07.2025	€ 4.600	\$ 4.565	0,11	MassMutual Global Funding 5,050 % fällig am 07.12.2027	\$ 7.100	\$ 7.095	0,16
AIB Group PLC 2,250 % fällig am 04.04.2028	€ 4.400	4.358	0,10	1,000 % fällig am 15.01.2032	1.000	772	0,02	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 1,412 % fällig am 17.07.2025	11.200	10.260	0,24
2,875 % fällig am 30.05.2031	€ 8.800	8.714	0,20	Digital Euro Finco LLC 2,500 % fällig am 16.01.2026	6.100	6.204	0,14	4,636 % fällig am 07.06.2031	€ 1.000	1.100	0,02
7,583 % fällig am 14.10.2026	\$ 2.400	2.439	0,06	Digital Realty Trust LP 3,600 % fällig am 01.07.2029	\$ 2.900	2.579	0,06	5,719 % fällig am 20.02.2026	\$ 6.600	6.568	0,15
alstria office REIT-AG 1,500 % fällig am 23.06.2026	€ 6.000	5.276	0,12	EQT AB 2,375 % fällig am 06.04.2028	€ 10.000	9.625	0,22	Mizuho Financial Group, Inc. 0,849 % fällig am 08.09.2024	AUD 17.100	16.927	0,39
Altarea S.C.A. 1,875 % fällig am 17.01.2028	8.500	7.501	0,17	2,875 % fällig am 06.04.2032	€ 7.400	6.445	0,15	3,752 % fällig am 19.07.2023	AUD 10.400	6.920	0,16
American Honda Finance Corp. 5,000 % fällig am 23.05.2025	\$ 800	797	0,02	2,875 % fällig am 06.04.2032	€ 7.400	6.445	0,15	5,414 % fällig am 13.09.2028	\$ 8.800	8.737	0,20
American Tower Corp. 5,250 % fällig am 15.07.2028	2.100	2.077	0,05	Equitable Financial Life Global Funding 5,450 % fällig am 03.03.2028	\$ 4.900	4.833	0,11	6,201 % fällig am 10.07.2024	8.600	8.600	0,20
Assicurazioni Generali SpA 2,429 % fällig am 14.07.2031	€ 1.800	1.633	0,04	Europäische Investitionsbank 0,750 % fällig am 15.11.2024	€ 9.700	11.528	0,27	Morgan Stanley 5,050 % fällig am 28.01.2027	6.000	5.952	0,14
Aviation Capital Group LLC 4,125 % fällig am 01.08.2025	\$ 9.080	8.486	0,20	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 4,400 % fällig am 23.08.2025	\$ 11.000	10.631	0,25	NatWest Group PLC 0,750 % fällig am 15.11.2025	€ 15.000	15.505	0,36
6,250 % fällig am 15.04.2028	100	100	0,00	5,700 % fällig am 14.03.2028	6.600	6.595	0,15	0,780 % fällig am 26.02.2030	€ 10.000	8.708	0,20
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028	€ 6.300	5.773	0,13	Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % fällig am 19.07.2024	€ 7.600	8.027	0,19	NE Property BV 1,875 % fällig am 09.10.2026	10.700	10.139	0,23
Bank of America Corp. 1,197 % fällig am 24.10.2026	\$ 15.000	13.503	0,31	2,748 % fällig am 14.06.2024	€ 4.600	5.597	0,13	3,375 % fällig am 14.07.2027 (h)	5.800	5.686	0,13
Bank of Ireland Group PLC 0,375 % fällig am 10.05.2027	€ 12.300	11.829	0,27	G City Europe Ltd. 4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 11.600	11.073	0,26	New Immo Holding S.A. 2,750 % fällig am 26.11.2026 (h)	8.800	8.610	0,20
Bank of Montreal 5,203 % fällig am 01.02.2028	\$ 5.400	5.401	0,12	Gaci First Investment Co. 5,125 % fällig am 14.02.2053	\$ 9.600	8.652	0,20	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 3,875 % fällig am 21.09.2023	\$ 3.500	3.481	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 6,210 % fällig am 20.07.2023	3.300	3.301	0,08	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	€ 7.100	5.839	0,13	Nomura Holdings, Inc. 2,172 % fällig am 14.07.2028	800	676	0,02
Barclays PLC 1,700 % fällig am 03.11.2026	£ 5.400	6.033	0,14	GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2030	\$ 2.600	2.256	0,05	2,679 % fällig am 16.07.2030	7.300	5.979	0,14
BGC Partners, Inc. 3,750 % fällig am 01.10.2024	1.195	1.129	0,03	5,300 % fällig am 15.01.2029	2.000	1.906	0,04	5,709 % fällig am 09.01.2026	8.300	8.230	0,19
8,000 % fällig am 25.05.2028	4.200	4.062	0,09	Goodman HK Finance 4,375 % fällig am 19.06.2024	5.045	4.954	0,11	5,842 % fällig am 18.01.2028	7.500	7.521	0,17
BNP Paribas S.A. 2,219 % fällig am 09.06.2026	10.500	9.716	0,22	Goodman U.S. Finance Four LLC 4,500 % fällig am 15.10.2037	6.900	5.764	0,13	6,181 % fällig am 18.01.2033	4.100	4.234	0,10
CaixaBank S.A. 0,750 % fällig am 26.05.2028	€ 2.100	1.971	0,05	GSPA Monetization Trust 6,422 % fällig am 09.10.2029	9.954	9.523	0,22	NTT Finance Corp. 4,239 % fällig am 25.07.2025	2.700	2.628	0,06
Castellum AB 0,750 % fällig am 04.09.2026 (h)	9.700	8.718	0,20	Host Hotels & Resorts LP 4,500 % fällig am 01.02.2026	7.800	7.567	0,17	OneMain Finance Corp. 6,875 % fällig am 15.03.2025	800	793	0,02
2,125 % fällig am 20.11.2023	4.500	4.836	0,11	HSBC Holdings PLC 7,390 % fällig am 03.11.2028	6.300	6.655	0,15	Piper Sandler Cos. 5,200 % fällig am 15.10.2023	8.500	8.479	0,20
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % fällig am 27.01.2028	13.300	11.478	0,26	HSBC USA, Inc. 5,625 % fällig am 17.03.2025	8.100	8.069	0,19	Prologis International Funding S.A. 1,625 % fällig am 17.06.2032	€ 1.000	834	0,02
0,900 % fällig am 12.10.2029	7.600	6.071	0,14	Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,835 % fällig am 13.12.2027	3.300	3.083	0,07	Reliance Standard Life Global Funding 3,850 % fällig am 19.09.2023	\$ 6.950	6.908	0,16
Citigroup, Inc. 1,250 % fällig am 06.07.2026	5.000	5.106	0,12	ING Groep NV 1,125 % fällig am 07.12.2028	€ 9.100	9.083	0,21	Royal Bank of Canada 4,900 % fällig am 12.01.2028	4.700	4.640	0,11
3,070 % fällig am 24.02.2028	\$ 7.400	6.814	0,16	7,320 % fällig am 23.05.2026	€ 4.200	4.371	0,10	Sagax AB 1,125 % fällig am 30.01.2027	€ 11.700	10.773	0,25
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	€ 15.000	11.962	0,28	International Development Association 0,750 % fällig am 21.09.2028	€ 11.000	11.138	0,26	Samhallsbygggnadsbolaget i Norden AB 1,000 % fällig am 12.08.2027 (h)	7.350	5.220	0,12
Clarion Funding PLC 1,250 % fällig am 13.11.2032	€ 2.400	2.072	0,05	1,750 % fällig am 05.05.2037	€ 11.100	10.238	0,24	1,125 % fällig am 04.09.2026 (h)	5.000	3.838	0,09
Cooperative Rabobank UA 4,655 % fällig am 22.08.2028	\$ 10.500	10.058	0,23	Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % fällig am 16.03.2028	10.200	9.497	0,22	Santander UK Group Holdings PLC 2,421 % fällig am 17.01.2029	€ 800	828	0,02
Corebridge Global Funding 5,750 % fällig am 02.07.2026 (b)	2.500	2.493	0,06	Jackson National Life Global Funding 6,242 % fällig am 28.06.2024	\$ 6.600	6.609	0,15	SBB Treasury Oyj 1,125 % fällig am 26.11.2029	€ 1.000	641	0,01
CPI Property Group S.A. 1,750 % fällig am 14.01.2030	€ 6.100	4.039	0,09	JPMorgan Chase & Co. 4,851 % fällig am 25.07.2028	9.700	9.576	0,22	Societe Generale S.A. 1,488 % fällig am 14.12.2026	\$ 14.100	12.416	0,29
2,750 % fällig am 12.05.2026	€ 27.100	24.066	0,56	KBC Group NV 0,250 % fällig am 01.03.2027	€ 3.000	2.931	0,07	4,677 % fällig am 15.06.2027	6.700	6.461	0,15
2,750 % fällig am 22.01.2028	€ 400	341	0,01	0,375 % fällig am 16.06.2027	3.200	3.119	0,07	6,446 % fällig am 10.01.2029	700	702	0,02
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	€ 1.400	1.362	0,03	Kojamo Oyj 0,875 % fällig am 28.05.2029	500	387	0,01	Standard Chartered PLC 0,800 % fällig am 17.11.2029	€ 3.600	3.212	0,07
0,875 % fällig am 20.01.2026	10.200	9.502	0,22	1,875 % fällig am 27.05.2027	2.700	2.449	0,06	1,456 % fällig am 14.01.2027	\$ 15.800	14.018	0,32
1,500 % fällig am 27.09.2031	4.700	3.579	0,08	Kookmin Bank 4,500 % fällig am 01.02.2029 (g)	\$ 7.400	6.951	0,16	7,776 % fällig am 16.11.2025	€ 1.700	1.740	0,04
Deutsche Bank AG 1,000 % fällig am 19.11.2025	600	618	0,01	LeasePlan Corp. NV 0,250 % fällig am 23.02.2026	€ 15.000	14.678	0,34	Starwood Property Trust, Inc. 3,750 % fällig am 31.12.2024	1.200	1.126	0,03
1,625 % fällig am 20.01.2027	7.400	7.180	0,17	Lendlease Finance Ltd. 3,400 % fällig am 27.10.2027	AUD 24.900	14.552	0,34	4,375 % fällig am 15.01.2027	800	690	0,02
1,750 % fällig am 19.11.2030	14.200	12.260	0,28	3,700 % fällig am 31.03.2031	4.800	2.496	0,06	Stifel Financial Corp. 4,000 % fällig am 15.05.2030	12.900	11.025	0,25
1,875 % fällig am 23.02.2028	4.000	3.867	0,09	Lloyds Banking Group PLC 4,375 % fällig am 22.03.2028	\$ 1.200	1.139	0,03	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,520 % fällig am 13.01.2028	5.200	5.225	0,12
2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 9.000	10.650	0,25	Logicor Financing SARL 1,625 % fällig am 15.07.2027	€ 1.100	998	0,02	Tesco Property Finance PLC 5,744 % fällig am 13.04.2040	€ 4.236	4.999	0,12
3,961 % fällig am 26.11.2025	\$ 6.800	6.487	0,15	2,000 % fällig am 17.01.2034	11.600	8.420	0,19	Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€ 5.600	6.101	0,14
				2,250 % fällig am 13.05.2025	2.000	2.031	0,05	Toyota Motor Credit Corp. 5,810 % fällig am 11.12.2023	\$ 5.500	5.507	0,13
				3,250 % fällig am 13.11.2028	12.600	11.770	0,27	TP ICAP Finance PLC 7,875 % fällig am 17.04.2030	€ 9.800	11.820	0,27
								UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (g)	\$ 21.200	20.876	0,48
								UBS Group AG 3,750 % fällig am 26.03.2025	3.070	2.940	0,07

# Aufstellung des Wertpapierbestands des Total Return Bond Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
3,869 % fällig am 12.01.2029	\$ 12.000			Global Payments, Inc.	\$ 7.300	\$ 7.119	0,16	Venture Global LNG, Inc.	\$ 3.450	\$ 3.508	0,08
5,125 % fällig am 29.07.2026				4,950 % fällig am 15.08.2027				8,125 % fällig am 01.06.2028		3.450	0,08
(e)(g)	1.300	1.135	0,03	Gray Oak Pipeline LLC	12.600	11.272	0,26	8,375 % fällig am 01.06.2031	3.000	2.905	0,07
5,711 % fällig am 12.01.2027	6.500	6.439	0,15	3,450 % fällig am 15.10.2027				Volkswagen Group of America Finance LLC		449.364	10,39
6,442 % fällig am 11.08.2028	5.650	5.676	0,13	HCA, Inc.				4,750 % fällig am 13.11.2028			
6,537 % fällig am 12.08.2033	13.000	13.325	0,31	3,125 % fällig am 15.03.2027	9.200	8.454	0,20				
7,000 % fällig am 30.09.2027	8.800	11.027	0,25	5,200 % fällig am 01.06.2028	500	496	0,01				
UniCredit SpA				5,500 % fällig am 01.06.2033	900	899	0,02				
2,200 % fällig am 22.07.2027	€ 5.450	5.495	0,13	Hyundai Capital America				<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 26.900	27.062	0,63	1,000 % fällig am 17.09.2024	9.350	8.797	0,20	Avangrid, Inc.	2.615	2.386	0,06
Volkswagen Financial Services NV				5,500 % fällig am 30.03.2026	6.500	6.445	0,15	3,800 % fällig am 01.06.2029			
1,125 % fällig am 18.09.2023	€ 11.600	14.601	0,34	Imperial Brands Finance PLC	12.000	11.598	0,27	Constellation Energy Generation LLC	6.100	6.151	0,14
1,875 % fällig am 03.12.2024	3.800	4.518	0,10	3,125 % fällig am 26.07.2024	5.000	5.013	0,12	5,600 % fällig am 01.03.2028			
Vonovia SE				6,125 % fällig am 27.07.2027				DTE Energy Co.	2.600	2.383	0,05
1,375 % fällig am 28.01.2026	€ 9.900	9.865	0,23	Informa PLC	€ 15.300	15.928	0,37	1,050 % fällig am 01.06.2025			
2,375 % fällig am 25.03.2032	2.100	1.869	0,04	2,125 % fällig am 06.10.2025				Duke Energy Progress LLC	100	100	0,00
Wells Fargo & Co.				Intel Corp.	\$ 6.900	6.946	0,16	3,375 % fällig am 01.09.2023			
4,808 % fällig am 25.07.2028	\$ 9.600	9.392	0,22	5,125 % fällig am 10.02.2030				Edison International	8.060	7.794	0,18
Workspace Group PLC				International Business Machines Corp.	5.000	4.889	0,11	3,550 % fällig am 15.11.2024			
2,250 % fällig am 11.03.2028	€ 7.600	7.085	0,16	4,000 % fällig am 27.07.2025				EDP Finance BV	12.700	10.873	0,25
Yorkshire Building Society				International Flavors & Fragrances, Inc.	7.400	5.870	0,14	1,710 % fällig am 24.01.2028			
3,511 % fällig am 11.10.2030	2.400	2.501	0,06	2,300 % fällig am 01.11.2030				Electricite de France S.A.	€ 3.100	3.349	0,08
		985.529	22,78	JSW Hydro Energy Ltd.	2.268	1.916	0,04	4,250 % fällig am 25.01.2032			
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				4,125 % fällig am 18.05.2031				Enel Finance International NV			
Amdocs Ltd.				Lendlease Europe Finance PLC	€ 2.983	2.483	0,06	0,375 % fällig am 28.05.2029	3.400	3.027	0,07
2,538 % fällig am 15.06.2030	\$ 5.800	4.846	0,11	3,500 % fällig am 02.12.2033			0,875 % fällig am 28.09.2034	9.800	7.517	0,17	
Amgen, Inc.				Marks & Spencer PLC	100	115	0,00	1,125 % fällig am 17.10.2034	11.000	8.676	0,20
5,150 % fällig am 02.03.2028	4.400	4.399	0,10	3,750 % fällig am 15.12.2026			2,875 % fällig am 11.04.2029	€ 10.000	10.564	0,24	
5,650 % fällig am 02.03.2053	5.000	5.067	0,12	Mercedes-Benz Finance North America LLC	\$ 9.300	9.186	0,21	Exelon Corp.	\$ 5.360	5.339	0,12
Babcock International Group PLC				4,800 % fällig am 30.03.2028				5,150 % fällig am 15.03.2028			
1,375 % fällig am 13.09.2027	€ 8.300	8.023	0,19	Motorola Solutions, Inc.	12.400	10.024	0,23	Florida Power & Light Co.	6.500	6.555	0,15
Bacardi Ltd.				2,300 % fällig am 15.11.2030				5,050 % fällig am 01.04.2028			
4,450 % fällig am 15.05.2025	\$ 13.000	12.658	0,29	Mundys SpA	€ 26.700	24.908	0,58	Ipalco Enterprises, Inc.	5.500	5.320	0,12
Bayer U.S. Finance LLC				1,875 % fällig am 12.02.2028				National Grid PLC			
6,562 % fällig am 15.12.2023	8.000	7.992	0,18	NetApp, Inc.	\$ 2.954	2.746	0,06	5,602 % fällig am 12.06.2028	3.100	3.115	0,07
Boardwalk Pipelines LP				1,875 % fällig am 22.06.2025	\$ 3.517	2.958	0,07	5,809 % fällig am 12.06.2033	3.300	3.360	0,08
3,400 % fällig am 15.02.2031	7.700	6.633	0,15	2,700 % fällig am 22.06.2030				NextEra Energy Capital Holdings, Inc.			
Boeing Co.				Nissan Motor Co. Ltd.	2.500	2.276	0,05	2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD 2.000	1.202	0,03
2,750 % fällig am 01.02.2026	6.400	5.963	0,14	4,345 % fällig am 17.09.2027	15.600	13.696	0,32	4,900 % fällig am 28.02.2028	\$ 8.000	7.928	0,18
3,450 % fällig am 01.11.2028	4.200	3.808	0,09	4,810 % fällig am 17.09.2030				6,051 % fällig am 01.03.2025	6.400	6.427	0,15
Broadcom, Inc.				NXP BV	9.900	9.514	0,22	7,677 % fällig am 15.06.2027	791	695	0,02
4,150 % fällig am 15.11.2030	2.173	2.000	0,05	3,875 % fällig am 18.06.2026				Oncor Electric Delivery Co. LLC			
4,300 % fällig am 15.11.2032	4.800	4.405	0,10	OCI NV	2.000	1.956	0,05	4,300 % fällig am 15.05.2028	5.000	4.868	0,11
Canadian Pacific Railway Co.				6,700 % fällig am 16.03.2033				Pacific Gas & Electric Co.			
3,125 % fällig am 01.06.2026	7.050	6.601	0,15	Oracle Corp.	4.400	4.283	0,10	2,100 % fällig am 01.08.2027	3.200	2.736	0,06
Centene Corp.				4,500 % fällig am 06.05.2028	4.400	4.254	0,10	3,150 % fällig am 01.01.2026	12.500	11.605	0,27
4,625 % fällig am 15.12.2029	5.000	4.607	0,11	4,650 % fällig am 06.05.2030				3,300 % fällig am 15.03.2027			
CenterPoint Energy Resources Corp.				Pearson Funding PLC	€ 4.500	4.859	0,11	^	2.800	2.544	0,06
5,250 % fällig am 01.03.2028	6.100	6.102	0,14	3,750 % fällig am 04.06.2030				3,300 % fällig am 01.12.2027			
Chanel Ceres PLC				Rexel S.A.	€ 14.200	13.622	0,32	^	4.800	4.212	0,10
0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 10.400	10.115	0,23	2,125 % fällig am 15.12.2028				^	5.700	5.517	0,13
Charter Communications Operating LLC				Royalty Pharma PLC	\$ 3.000	2.707	0,06	^	3.600	3.410	0,08
4,908 % fällig am 23.07.2025	\$ 17.900	17.559	0,41	1,200 % fällig am 02.09.2025				4,250 % fällig am 01.08.2023	1.300	1.299	0,03
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC				Sealed Air Corp.	4.447	3.872	0,09	4,650 % fällig am 01.08.2028	2.400	2.221	0,05
5,125 % fällig am 30.06.2027	8.700	8.559	0,20	1,573 % fällig am 15.10.2026				4,750 % fällig am 15.02.2044			
Choice Hotels International, Inc.				SEB S.A.	€ 5.000	5.160	0,12	^	1.700	1.321	0,03
3,700 % fällig am 01.12.2029	1.500	1.295	0,03	1,375 % fällig am 16.06.2025				5,450 % fällig am 15.06.2027	4.000	3.893	0,09
CVS Health Corp.				Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 2.200	1.989	0,05	6,400 % fällig am 15.06.2033	8.700	8.658	0,20
5,000 % fällig am 30.01.2029	6.000	5.945	0,14	1,200 % fällig am 11.03.2026				San Diego Gas & Electric Co.			
Delta Air Lines Pass-Through Trust				Southwest Airlines Co.	4.400	4.355	0,10	3,600 % fällig am 01.09.2023	100	100	0,00
2,000 % fällig am 10.12.2029	3.036	2.676	0,06	5,250 % fällig am 04.05.2025				Southwest Gas Corp.			
eBay, Inc.				Sprint Spectrum Co. LLC	1.280	1.263	0,03	5,450 % fällig am 23.03.2028	5.900	5.887	0,14
5,900 % fällig am 22.11.2025	7.700	7.786	0,18	4,738 % fällig am 20.09.2029				Sprint LLC			
Emory University				T-Mobile USA, Inc.	5.600	5.487	0,13	7,875 % fällig am 15.09.2023	3.400	3.411	0,08
2,143 % fällig am 01.09.2030	10.400	8.744	0,20	4,800 % fällig am 15.07.2028				TDC Net A/S			
Enbridge, Inc.				Thames Water Utilities Finance PLC	€ 2.100	1.828	0,04	5,056 % fällig am 31.05.2028	€ 5.100	5.470	0,13
5,700 % fällig am 08.03.2033	7.700	7.809	0,18	0,875 % fällig am 31.01.2028				VTR Comunicaciones SpA	\$ 798	417	0,01
Energy Transfer LP				Tornator Oyj	5.600	5.514	0,13	5,125 % fällig am 15.01.2028			
4,500 % fällig am 15.04.2024	5.300	5.240	0,12	1,250 % fällig am 14.10.2026				WEC Energy Group, Inc.	5.000	4.274	0,10
Entergy Louisiana LLC				United Airlines Pass-Through Trust	\$ 3.121	2.755	0,06	1,375 % fällig am 15.10.2027			
2,350 % fällig am 15.06.2032	14.000	11.244	0,26	2,875 % fällig am 07.04.2030	4.000	4.072	0,09				
Equifax, Inc.				5,800 % fällig am 15.07.2037							
5,100 % fällig am 15.12.2027	7.800	7.719	0,18	Utah Acquisition Sub, Inc.	6.500	6.176	0,14				
Expedia Group, Inc.				3,950 % fällig am 15.06.2026							
3,800 % fällig am 15.02.2028	3.790	3.548	0,08	Venture Global Calcasieu Pass LLC	10.500	10.425	0,24				
				6,250 % fällig am 15.01.2030							
								Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		1.609.497	37,20
								<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								JobsOhio Beverage System Revenue Notes, Series 2023	5.350	5.289	0,12
								4,433 % fällig am 01.01.2033			
								Texas Natural Gas Securitization Finance Corp. Revenue Bonds, Series 2023			
								5,102 % fällig am 01.04.2035	6.400	6.430	0,15
								Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020			
								3,301 % fällig am 01.06.2033	7.125	5.882	0,14





# Aufstellung des Wertpapierbestands des Total Return Bond Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Mortgage Equity Conversion Asset Trust				5,790 % fällig am 25.01.2045	\$ 1.603	\$	0,04
3,810 % fällig am 25.11.2034	\$ 373	\$	0,01	5,790 % fällig am 25.05.2042	\$ 3.756	\$ 3.513	0,08	Warwick Finance Residential Mortgages PLC			0,04
3,833 % fällig am 20.10.2035	1.420	1.366	0,03	MortgageIT Trust				0,000 % fällig am 21.12.2049 (c)	£ 0	£	1,651
3,864 % fällig am 20.02.2035	92	92	0,00	5,710 % fällig am 25.10.2035	650	635	0,01	5,865 % fällig am 21.12.2049	9.369		11,855
4,125 % fällig am 19.07.2031	0	0	0,00	NAAC Reperforming Loan REMIC Trust				6,564 % fällig am 21.12.2049	2.030		2,556
5,550 % fällig am 25.04.2046	809	758	0,02	7,000 % fällig am 25.10.2034 ^	447	398	0,01	7,064 % fällig am 21.12.2049	1.015		1,271
5,910 % fällig am 20.02.2036 ^	50	42	0,00	7,500 % fällig am 25.03.2034 ^	578	507	0,01	7,564 % fällig am 21.12.2049	580		724
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	250	124	0,00	NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				8,064 % fällig am 21.12.2049	580		712
6,000 % fällig am 25.01.2034 ^	15	12	0,00	6,500 % fällig am 25.02.2035 ^	1.898	1.701	0,04	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
5,490 % fällig am 25.06.2035	118	108	0,00	New Residential Mortgage Loan Trust				5,500 % fällig am 25.05.2035 ^	\$ 540	\$	426
6,500 % fällig am 25.11.2034 ^	24	22	0,00	3,500 % fällig am 25.12.2057	5.717	5.363	0,12	6,000 % fällig am 25.11.2035 ^	470		383
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
4,311 % fällig am 25.06.2033	3	3	0,00	6,220 % fällig am 25.02.2035	416	409	0,01	3,770 % fällig am 25.02.2031	1		1
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				Paragon Mortgages PLC	€ 573	605	0,01				390.686
6,000 % fällig am 25.11.2035 ^	2.322	673	0,02	3,563 % fällig am 15.11.2038	€	573	0,01				9,03
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				Precise Mortgage Funding PLC	£ 0	1.993	0,05	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
3,397 % fällig am 26.04.2038	733	708	0,02	0,000 % fällig am 12.12.2055 (c)	£	0	1,993	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			87
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				Prime Mortgage Trust	\$ 65	60	0,00	5,270 % fällig am 25.10.2036	229		1,594
5,750 % fällig am 25.04.2036 ^	762	424	0,01	5,550 % fällig am 25.02.2034	\$	65	0,00	5,470 % fällig am 25.08.2036 ^	6.265		0,04
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	1.869	1.101	0,03	Primrose Residential DAC	€ 12.699	13.760	0,32	Ameriqueq Mortgage Securities Trust			50
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	562	222	0,01	4,189 % fällig am 24.03.2061	€	12.699	0,32	5,735 % fällig am 25.03.2036	50		50
CSAIL Commercial Mortgage Trust				Residential Accredited Loans, Inc. Trust	\$ 2.429	1.715	0,04	Ameriqueq Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
3,458 % fällig am 15.11.2050	4.600	4.150	0,10	5,550 % fällig am 25.05.2037 ^	\$	2.429	0,04	5,855 % fällig am 25.01.2036	1.139		1,133
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 25.04.2036	2.576	2.073	0,05	6,080 % fällig am 25.05.2035	3.517		3,452
5,480 % fällig am 25.05.2037 ^	2.519	2.137	0,05	Residential Asset Securitization Trust				6,170 % fällig am 25.10.2034	1.135		1,119
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	2.511	906	0,02	6,260 % fällig am 25.03.2035	4.705		4,582
5,235 % fällig am 19.07.2044	10	9	0,00	6,500 % fällig am 25.09.2036 ^	706	253	0,01	Armada Euro CLO DAC			
Eurohome UK Mortgages PLC	£ 1.732	2.116	0,05	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				3,897 % fällig am 15.07.2031	€ 11.995	€	12.802
5,137 % fällig am 15.06.2044	£	1.732	0,05	5,398 % fällig am 25.02.2036 ^	122	100	0,00	Asset-Backed Funding Certificates Trust			90
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				Resloc UK PLC	£ 3.635	4.451	0,10	5,850 % fällig am 25.06.2034	\$ 92	\$	90
5,376 % fällig am 25.10.2034	\$ 81	78	0,00	Ripon Mortgages PLC	£ 3.635	4.451	0,10	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			2.148
6,000 % fällig am 25.06.2037	1.139	446	0,01	5,491 % fällig am 28.08.2056	13.463	17.055	0,39	3,688 % fällig am 25.12.2036	2.231		2,148
GS Mortgage Securities Corp. Trust				RMAC Securities PLC				Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
6,110 % fällig am 15.07.2025	3.810	3.756	0,09	5,414 % fällig am 12.06.2044	768	919	0,02	6,410 % fällig am 16.01.2030	11.252		11,198
GSR Mortgage Loan Trust				Stratton Mortgage Funding PLC	15.165	19.282	0,45	Avoca CLO DAC			
3,935 % fällig am 25.01.2036 ^	1.286	1.259	0,03	5,391 % fällig am 20.07.2060	15.165	19.282	0,45	3,867 % fällig am 15.07.2030	€ 11.476	€	12,315
4,070 % fällig am 25.09.2035	1.513	1.432	0,03	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				3,997 % fällig am 15.10.2032	5.200		5,546
4,234 % fällig am 25.06.2034	53	50	0,00	3,392 % fällig am 25.02.2036 ^	\$ 1.013	921	0,02	Barings CLO Ltd.			
4,485 % fällig am 25.06.2034	23	20	0,00	5,133 % fällig am 25.04.2034	1.330	1.310	0,03	6,210 % fällig am 15.04.2031	\$ 13.100	\$	12,937
5,500 % fällig am 25.01.2037 ^	10	19	0,00	5,227 % fällig am 25.09.2034	227	213	0,00	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			119
HarborView Mortgage Loan Trust				Structured Asset Mortgage Investments Trust				4,807 % fällig am 25.05.2035	119		1,101
5,417 % fällig am 19.03.2037	3.172	2.853	0,07	5,370 % fällig am 25.09.2047	10.478	8.742	0,20	4,842 % fällig am 25.12.2035	1.114		1,114
5,597 % fällig am 19.05.2035	159	146	0,00	5,626 % fällig am 19.04.2035	264	239	0,01	6,350 % fällig am 25.01.2045	124		122
IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust				5,646 % fällig am 19.07.2035	184	176	0,00	Black Diamond CLO DAC			
3,544 % fällig am 25.01.2032	0	0	0,00	5,710 % fällig am 25.02.2036 ^	432	364	0,01	4,303 % fällig am 15.05.2032	€ 12.000	€	12,809
IndyMac Mortgage Loan Trust				5,726 % fällig am 19.05.2034	165	150	0,00	Blackrock European CLO DAC			
5,630 % fällig am 25.06.2037	1.008	902	0,02	5,806 % fällig am 19.09.2032	18	18	0,00	3,797 % fällig am 15.10.2031	13.000		13,858
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust				6,000 % fällig am 25.05.2047	7.411	6.074	0,14	BlueMountain CLO Ltd.			
3,358 % fällig am 15.11.2048	9.403	9.028	0,21	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				6,453 % fällig am 22.10.2030	\$ 962	\$	957
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust				7,500 % fällig am 25.10.2036 ^	648	390	0,01	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC			
2,994 % fällig am 15.12.2049	8.260	7.757	0,18	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				3,827 % fällig am 15.07.2030	€ 1.797	€	1,925
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				6,639 % fällig am 25.06.2033	2	2	0,00	BNPP AM Euro CLO DAC			
6,403 % fällig am 15.06.2035	10.951	10.173	0,23	Thornburg Mortgage Securities Trust				4,031 % fällig am 22.07.2032	12.000		12,793
JP Morgan Mortgage Trust				3,114 % fällig am 25.09.2037	2.622	2.547	0,06	Bosphorus CLO DAC			
4,186 % fällig am 25.07.2035	123	115	0,00	7,151 % fällig am 25.06.2047 ^	1.954	1.653	0,04	4,346 % fällig am 15.12.2030	240		258
5,750 % fällig am 25.01.2036 ^	336	166	0,00	Towd Point Mortgage Funding PLC				Bridgepoint CLO DAC			
Landmark Mortgage Securities PLC	£ 6.712	8.258	0,19	5,635 % fällig am 20.10.2051	£ 10.086	12.841	0,30	4,387 % fällig am 15.01.2034	1.000		1,076
4,865 % fällig am 17.04.2044	£	6.712	0,19	5,841 % fällig am 20.07.2045	18.688	23.769	0,55	Cairn CLO DAC			
Lehman XS Trust				Tower Bridge Funding PLC				3,842 % fällig am 30.04.2031	12.813		13,699
5,510 % fällig am 25.12.2036	\$ 3.911	3.793	0,09	5,527 % fällig am 20.11.2063	5.687	7.192	0,17	4,212 % fällig am 20.10.2028	107		116
5,550 % fällig am 25.03.2047	10.696	9.156	0,21	Trinity Square PLC				Carlyle Euro CLO DAC			
London Wall Mortgage Capital PLC				5,316 % fällig am 15.07.2059	10.514	13.348	0,31	3,953 % fällig am 15.08.2030	8.829		9,417
5,502 % fällig am 15.05.2052	£ 1.357	1.712	0,04	Tudor Rose Mortgages				Carrington Mortgage Loan Trust			
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				5,509 % fällig am 20.06.2048	523	661	0,02	6,140 % fällig am 25.06.2035	\$ 847	\$	825
3,857 % fällig am 25.01.2036	\$ 9	8	0,00	Twin Bridges PLC				CIFC Funding Ltd.			
4,560 % fällig am 21.11.2034	1.693	1.601	0,04	6,115 % fällig am 12.12.2054	2.904	3.699	0,09	6,440 % fällig am 16.11.2030	1.320		1,315
MASTR Reperforming Loan Trust				Uropa Securities PLC				CIT Mortgage Loan Trust			
7,000 % fällig am 25.05.2035	533	385	0,01	4,729 % fällig am 10.10.2040	526	653	0,02	6,500 % fällig am 25.10.2037	759		758
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Citigroup Mortgage Loan Trust			
4,159 % fällig am 25.02.2035	691	652	0,02	3,307 % fällig am 25.01.2037 ^	\$ 3.873	3.404	0,08	5,470 % fällig am 25.09.2036	4.533		3,312
4,391 % fällig am 25.06.2035	293	277	0,01	3,715 % fällig am 25.09.2036 ^	1.023	908	0,02	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
5,650 % fällig am 25.11.2035	220	207	0,00	3,753 % fällig am 25.02.2037 ^	645	590	0,01	5,400 % fällig am 25.03.2037	1.839		1,517
MetLife Securitization Trust				5,690 % fällig am 25.07.2045	319	303	0,01	Commonbond Student Loan Trust			
3,750 % fällig am 25.03.2057	6.326	5.928	0,14	5,730 % fällig am 25.10.2045	3.107	2.935	0,07	6,000 % fällig am 25.05.2041	546		537
				5,770 % fällig am 25.01.2045	131	129	0,00				

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				5,450 % fällig am 25.07.2036	\$ 7.716	2.960	0,07	Japan Finance Organization for Municipalities			
5,290 % fällig am 25.06.2047 ^	\$ 1.677	1.495	0,03	5,470 % fällig am 25.09.2036	7.694	3.443	0,08	0,010 % fällig am 02.02.2028	€ 9.900	9.195	0,21
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^	1.148	1.152	0,03	5,855 % fällig am 25.01.2035	1.476	1.391	0,03	Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap			
5,380 % fällig am 25.07.2037 ^	1.000	834	0,02	New Century Home Equity Loan Trust				0,875 % fällig am 21.03.2046	10.000	6.363	0,15
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				5,510 % fällig am 25.05.2036	47	46	0,00	Paraguay Government International Bond			
6,005 % fällig am 25.08.2034	190	189	0,00	5,870 % fällig am 25.10.2035	3.668	3.505	0,08	4,950 % fällig am 28.04.2031	\$ 2.300	2.215	0,05
6,050 % fällig am 25.10.2034	844	814	0,02	OZLM Ltd.				Peru Government International Bond			
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				6,340 % fällig am 17.04.2031	10.246	10.105	0,23	6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN 25.000	6.998	0,16
5,448 % fällig am 25.05.2046	1.716	1.454	0,03	6,549 % fällig am 30.10.2030	8.671	8.639	0,20	Poland Government International Bond			
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				Palmer Square European Loan Funding DAC				5,500 % fällig am 04.04.2053	\$ 4.000	4.036	0,09
5,270 % fällig am 25.11.2036	116	55	0,00	3,897 % fällig am 15.10.2031	€ 10.977	11.737	0,27	Province of Ontario			
CVC Cordatus Loan Fund DAC				Palmerston Park CLO DAC				1,850 % fällig am 01.02.2027	CAD 7.000	4.878	0,11
4,156 % fällig am 15.09.2031	€ 12.997	13.876	0,32	3,825 % fällig am 18.04.2030	5.565	5.993	0,14	Romania Government International Bond			
FBR Securitization Trust				Purple Finance CLO DAC				3,000 % fällig am 27.02.2027	\$ 12.000	10.892	0,25
5,855 % fällig am 25.11.2035	\$ 4.533	4.413	0,10	4,061 % fällig am 25.01.2031	731	790	0,02	United Kingdom Gilt			
First Franklin Mortgage Loan Trust				Renaissance Home Equity Loan Trust				0,875 % fällig am 31.07.2033	£ 1.300	1.185	0,03
5,260 % fällig am 25.12.2037	4.022	3.773	0,09	6,350 % fällig am 25.11.2034	\$ 153	126	0,00				
5,825 % fällig am 25.03.2034	365	350	0,01	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust							
6,080 % fällig am 25.07.2034	82	81	0,00	5,390 % fällig am 25.11.2036	5.865	1.708	0,04				
6,425 % fällig am 25.07.2034	586	570	0,01	5,430 % fällig am 25.05.2036	440	237	0,01				
GE-WMC Mortgage Securities Trust				Starwood Commercial Mortgage Trust							
5,230 % fällig am 25.08.2036	34	14	0,00	6,296 % fällig am 15.07.2038	7.449	7.386	0,17	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
Griffith Park CLO DAC				Structured Asset Investment Loan Trust				<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
4,103 % fällig am 21.11.2031	€ 12.000	12.845	0,30	5,530 % fällig am 25.03.2036	529	512	0,01	AT+T, Inc.			
GSAMP Trust				5,915 % fällig am 25.08.2035	480	455	0,01	5,700 % fällig am 19.03.2024	\$ 11.000	10.530	0,24
5,290 % fällig am 25.12.2036	\$ 12.064	6.527	0,15	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				National Grid Holdings Ltd.			
5,390 % fällig am 25.01.2037	416	243	0,01	5,305 % fällig am 25.09.2036	7.194	4.524	0,10	5,450 % fällig am 13.07.2023	5.150	5.140	0,12
Harvest CLO DAC				Venture CLO Ltd.				VW Credit, Inc.			
4,027 % fällig am 15.01.2032	€ 13.700	14.626	0,34	6,350 % fällig am 20.01.2029	16.485	16.370	0,38	5,400 % fällig am 25.07.2023	9.150	9.116	0,21
Home Equity Asset Trust				WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				Walgreens Boots Alliance			
5,750 % fällig am 25.07.2036	\$ 4.678	4.246	0,10	5,510 % fällig am 25.04.2037	4.948	1.888	0,04	6,000 % fällig am 06.07.2023	1.800	1.798	0,04
6,185 % fällig am 25.08.2035	133	129	0,00	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				Summe kurzfristige Instrumente			
HSI Asset Securitization Corp. Trust				6,150 % fällig am 25.10.2034	1.054	1.035	0,02	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 5.534.034	127,92	
5,690 % fällig am 25.12.2035	1.475	1.456	0,03			368.778	8,52				
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>AKTIEN</b>			
5,585 % fällig am 25.05.2036	3.873	3.632	0,08	Action Logement Services				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Jubilee CLO DAC				0,500 % fällig am 30.10.2034	€ 7.600	6.038	0,14	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
3,787 % fällig am 15.04.2030	€ 20.000	21.382	0,49	Airport Authority Hong Kong				PIMCO Funds: Global Investors			
LCM LP				4,750 % fällig am 12.01.2028	\$ 1.300	1.297	0,03	Series plc - US Short-Term			
6,290 % fällig am 20.10.2027	\$ 803	804	0,02	4,875 % fällig am 12.01.2030	5.000	5.085	0,12	Fund (f)	9.560.426	95.987	2,22
Madison Park Euro Funding DAC				Canada Government International Bond				PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
3,927 % fällig am 15.01.2032	€ 12.300	13.138	0,30	2,250 % fällig am 01.12.2029	CAD 38.600	27.268	0,63	US Dollar Short-Term Floating			
Man GLG Euro CLO DAC				Development Bank of Japan, Inc.				NAV Fund (f)	16.473.452	164.042	3,79
4,216 % fällig am 15.12.2031	11.089	11.879	0,27	0,010 % fällig am 15.10.2024	€ 6.600	6.840	0,16	Summe Investmentfonds	\$ 260.029	6,01	
Massachusetts Educational Financing Authority				0,875 % fällig am 10.10.2025	4.300	4.386	0,10				
6,205 % fällig am 25.04.2038	\$ 5	5	0,00	Europäische Union							
Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust				0,000 % fällig am 04.10.2028	(c)	1.559	0,04				
6,400 % fällig am 25.10.2037	9.380	7.761	0,18	Hungary Government International Bond							
MF1 LLC				1,750 % fällig am 05.06.2035	10.000	7.665	0,18				
7,226 % fällig am 19.06.2037	11.300	11.268	0,26	Israel Government International Bond							
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				3,800 % fällig am 13.05.2060	\$ 1.000	762	0,02				
5,330 % fällig am 25.05.2037	544	474	0,01	4,125 % fällig am 17.01.2048	1.000	858	0,02				
5,350 % fällig am 25.09.2036	952	357	0,01								
5,380 % fällig am 25.11.2036	941	519	0,01								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 1.321	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (1.347)	\$ 1.321	\$ 1.321	0,03
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.347)	\$ 1.321	\$ 1.321	0,03

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend<sup>1</sup>, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	1.506	\$ 2.774	0,06
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	582	(638)	(0,01)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Total Return Bond Fund (Fort.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1.393	\$ 1.823	0,04
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	107	(223)	(0,01)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	676	746	0,02
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	137	(446)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	976	(2.332)	(0,05)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.624	(3.028)	(0,07)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	667	(647)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	1.455	1.491	0,03
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	175	111	0,00
				<b>\$ (369)</b>	<b>(0,01)</b>

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	103	\$ (45)	\$ (39)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	103	(36)	(5)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	30	(12)	(4)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	30	(15)	(6)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	70	(57)	(3)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	70	(65)	(331)	(0,01)
				<b>\$ (230)</b>	<b>\$ (388)</b>	<b>(0,01)</b>
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					<b>\$ (757)</b>	<b>(0,02)</b>

#### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2023	\$ 7.300	\$ (72)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	12.400	56	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2023	€ 3.900	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	\$ 4.600	115	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2027	4.600	231	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	8.300	430	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	4.700	38	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	5.500	129	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 14.500	2.511	0,06
Ryder System, Inc.	1,000	20.12.2023	\$ 1.500	29	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	6.700	23	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	500	8	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	6.200	11	0,00
				<b>\$ 3.509</b>	<b>0,08</b>

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 9.408	\$ 252	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	(5,000 )	20.06.2026	5.292	255	0,01
CDX.HY-38 5-Year Index	(5,000 )	20.06.2027	97.118	(6.436)	(0,16)
				<b>\$ (5.929)</b>	<b>(0,14)</b>

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 4.100	\$ 34	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,900 %	15.03.2052	£ 8.400	\$ 4.562	0,10
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053	5.400	488	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	24.300	1.764	0,04
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,062	18.09.2026	¥ 3.550.000	(217)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,063	19.09.2026	7.000	0	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,064 %	19.09.2026	¥ 877.000	\$ (55)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,380	18.06.2028	5.170.000	(117)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	4.651.000	1.091	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,662	19.04.2042	260.000	86	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,705	31.10.2038	1.180.000	128	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,750	20.03.2038	436.000	(6)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,750	20.12.2038	1.947.000	222	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,785	12.11.2038	600.000	54	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	22.10.2038	400.000	29	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	4.070.000	1.685	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	\$ 14.800	(2.144)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	65.900	5.006	0,11
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	45.000	(6.309)	(0,15)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,943	21.04.2032	14.800	(1.817)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,150	15.06.2027	88.100	(5.975)	(0,14)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,680	11.07.2032	31.600	(2.138)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,690	11.07.2032	31.600	(2.104)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	6.800	(293)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	14.12.2052	9.570	408	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,156	10.03.2033	77.900	(50)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	5.100	(121)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	7.100	(176)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	6.100	(103)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	4.100	(61)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	4.800	(68)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	4.800	(62)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	6.300	(78)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	9.400	(102)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	8.600	(144)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	3.300	(46)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	101.600	356	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	8.900	(74)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	CAD 227.500	115	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	NZD 39.100	(457)	(0,01)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	115.900	(863)	(0,02)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,250	21.12.2027	3.300	(44)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 4.000	(179)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	25.000	(2.655)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	21.000	(1.969)	(0,05)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,580	24.05.2024	239.500	(5.682)	(0,13)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	7.400	(164)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	132.600	1.152	0,03
					\$ (17.127)	(0,39)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					\$ (19.513)	(0,45)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückertungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückertungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	124.000	\$ 992	\$ 1.798	0,04
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	11.09.2023	116.900	877	1.692	0,04
							\$ 1.869	\$ 3.490	0,08

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Total Return Bond Fund (Fort.)

### VERKAUFSOPTIONEN

### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250 %	12.09.2023	124.000	\$ (620)	\$ (1.229)	(0,03)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,750	12.09.2023	124.000	(372)	(702)	(0,02)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	01.12.2023	68.600	(213)	(7)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	68.600	(213)	(928)	(0,02)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2023	4.700	(18)	(22)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	4.700	(18)	(14)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	3.200	(21)	(8)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	3.200	(21)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	1.800	(13)	(8)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	1.800	(13)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	2.200	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	2.200	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	1.800	(12)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	1.800	(12)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	1.800	(6)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	1.800	(6)	(9)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.200	(5)	(4)	0,00
FAR	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.200	(5)	(8)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,233	11.09.2023	116.900	(550)	(1.175)	(0,03)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,715	11.09.2023	116.900	(328)	(693)	(0,01)
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	1.900	(13)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	1.900	(13)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	1.800	(6)	(4)	0,00
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	1.800	(6)	(9)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.200	(5)	(4)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.200	(5)	(8)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	2.300	(8)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	2.300	(8)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	5.000	(17)	(6)	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	5.000	(17)	(21)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,715	11.09.2023	116.700	(327)	(692)	(0,02)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	2.200	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	2.200	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	2.200	(8)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	2.200	(8)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	2.200	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	2.200	(7)	(9)	0,00
							\$ (2.929)	\$ (5.582)	(0,13)

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.06.2027	\$ 1.600	\$ (77)	\$ 28	\$ (49)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	400	(36)	18	(18)	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.325	(108)	60	(48)	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	700	(25)	4	(21)	0,00
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.000	(112)	20	(92)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.300	(116)	58	(58)	0,00
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.275	(104)	57	(47)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(15)	3	(12)	0,00
MYC	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(5)	5	0	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	2.900	(104)	16	(88)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	3.400	(302)	153	(149)	(0,01)
					\$ (1.004)	\$ 422	\$ (582)	(0,01)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### DEVISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 2.441	\$ 1.620	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	07.2023	\$ 299	AUD 457	5	0	5	0,00
	08.2023	1.621	2.441	5	0	5	0,00
BOA	07.2023	CAD 45.106	\$ 33.150	0	(938)	(938)	(0,02)
	07.2023	€ 3.182	3.477	6	0	6	0,00
	07.2023	NZD 916	556	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	\$ 2.400	AUD 3.676	47	0	47	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
	07.2023	\$	7.584	€	7.049	\$	107	0,00	
	07.2023		668	PEN	2.448	\$	7	0,00	
	08.2023	¥	627.100	\$	4.391		24	0,00	
	09.2023	HKD	18.102		2.317		3	0,00	
	09.2023	TWD	110.762		3.649		85	0,00	
	09.2023	\$	9.930	IDR	148.646.905		0	(57)	0,00
	09.2023		8.593	INR	710.712		46	0,00	
BPS	07.2023	AUD	1.745	\$	1.156		0	(6)	0,00
	07.2023	CHF	96		106		0	(1)	0,00
	07.2023	CZK	2.815		131		2	0,00	
	07.2023	€	3.892		4.243		0	(3)	0,00
	07.2023	\$	102	CHF	92		0	0,00	
	07.2023		2.085	€	1.917		7	0,00	
	08.2023	CHF	91	\$	102		0	0,00	
	08.2023	TWD	55.440		1.816		35	0,00	
	08.2023	\$	1.157	AUD	1.745		6	0,00	
	09.2023	THB	48		1		0	0,00	
	09.2023	\$	289	PEN	1.056		1	0,00	
	12.2023		142	INR	11.717		0	0,00	
BRC	08.2023		992	¥	131.337		0	(78)	0,00
	09.2023		91	ILS	324		0	(3)	0,00
	09.2023		211	PEN	772		1	0,00	
	12.2023		1.531	INR	126.372		0	(1)	0,00
BSH	07.2023		2.252	PEN	8.291		34	0,00	
CBK	07.2023	CZK	2.484	\$	115		1	0,00	
	07.2023	£	300		381		0	0,00	
	07.2023		1.035	AUD	1.587		21	0,00	
	07.2023		18.265	CLP	14.781.571		142	0,00	
	07.2023		17.692	€	16.407		218	(9)	0,01
	07.2023		1.293	£	1.012		0	(6)	0,00
	07.2023		3.100	PEN	11.352		29	0,00	
	08.2023	CNH	296	\$	42		2	0,00	
	08.2023	TWD	57.719		1.891		37	0,00	
	08.2023	\$	442	PEN	1.728		33	0,00	
DUB	07.2023		8.852	£	7.100		174	0,00	
	09.2023		100	PEN	367		1	0,00	
FAR	07.2023		29	CLP	22.678		0	0,00	
GLM	07.2023	PEN	8.298	\$	2.267		0	(21)	0,00
	07.2023	\$	896	PEN	3.271		5	0,00	
	09.2023		4.073		14.937		23	0,00	
	09.2023		12.262	TWD	373.193		0	(255)	(0,01)
JPM	07.2023	€	13.846	\$	14.893		0	(302)	(0,01)
	07.2023	\$	2.308	AUD	3.531		42	0,00	
	07.2023		761.149	€	697.087		0	(627)	(0,01)
	08.2023	€	697.087	\$	762.214		651	0,00	
	08.2023	\$	162	¥	21.584		0	(12)	0,00
	09.2023	IDR	240.583	\$	16		0	0,00	
	09.2023	INR	4.664		57		0	0,00	
	09.2023	PEN	77.395		21.020		0	(204)	0,00
	09.2023	\$	4.133	IDR	62.180.258		0	(2)	0,00
	09.2023		88	ILS	311		0	(4)	0,00
	09.2023		14	PEN	50		0	0,00	
	09.2023		8.110	THB	278.124		0	(207)	0,00
	12.2023		9.131	INR	753.530		0	(3)	0,00
MBC	07.2023	€	5.136	\$	5.493		0	(110)	0,00
	07.2023	£	255.628		316.433		0	(8.562)	(0,20)
MYI	07.2023	\$	9.850	€	9.131		112	0,00	
	07.2023	£	35	\$	44		0	0,00	
	07.2023	IDR	39.185.115		2.620		7	0,00	
	07.2023	\$	5	CHF	4		0	0,00	
	07.2023		607	€	557		0	0,00	
	07.2023		1.574	£	1.264		33	0,00	
	07.2023		2.608	IDR	39.185.115		6	0,00	
	08.2023	TWD	59.657	\$	1.967		51	0,00	
	08.2023	\$	14.152	¥	1.880.695		0	(1.057)	(0,02)
	08.2023		31	TWD	960		0	(1)	0,00
	09.2023	INR	1.007	\$	12		0	0,00	
	09.2023	\$	2.620	IDR	39.219.177		0	(15)	0,00
	09.2023		3.703	THB	126.775		0	(100)	0,00
RBC	08.2023	MXN	2.245	\$	130		0	0,00	
SCX	07.2023	AUD	3.585		2.380		0	(7)	0,00
	07.2023	NZD	2.385		1.448		0	(13)	0,00
	07.2023	\$	3.257	AUD	4.984		61	0,00	
	07.2023		1.048	£	834		12	0,00	
	08.2023	CNH	204	\$	30		2	0,00	
	08.2023		2.382	AUD	3.585		6	0,00	
	09.2023	IDR	238.245.988	\$	16.023		197	0,00	
	09.2023	INR	2.917		35		0	0,00	
	09.2023	TWD	92.552		3.036		58	0,00	
	09.2023	\$	1.553	PEN	5.720		16	0,00	
	09.2023		8.335	THB	287.811		0	(156)	0,00
SOG	07.2023	€	705.535	\$	758.972		0	(10.768)	(0,25)
	07.2023	\$	1.974	AUD	3.017		34	0,00	



## Aufstellung des Wertpapierbestands des Total Return Bond Fund (Fort.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SSB	08.2023	CLP 14.774.113	\$ 18.222	\$ 0	\$ (131)	\$ (131)	0,00
TOR	07.2023	AUD 4.412	\$ 2.914	0	(23)	(23)	0,00
	07.2023	\$ 1.044	AUD 1.597	19	0	19	0,00
	07.2023	34.091	CAD 45.109	24	(25)	(1)	0,00
	07.2023	312.404	£ 245.852	160	0	160	0,00
	07.2023	2.010	NZD 3.301	12	0	12	0,00
	08.2023	CAD 45.091	\$ 34.091	24	(23)	1	0,00
	08.2023	£ 245.852	312.472	0	(154)	(154)	0,00
	08.2023	NZD 3.301	2.010	0	(12)	(12)	0,00
	08.2023	\$ 2.916	AUD 4.412	23	0	23	0,00
	08.2023	6.532	¥ 866.175	0	(501)	(501)	(0,01)
UAG	07.2023	AUD 7.031	\$ 4.695	25	(10)	15	0,00
	07.2023	\$ 239	AUD 365	4	0	4	0,00
	08.2023	4.699	7.031	9	(24)	(15)	0,00
	09.2023	SGD 22.211	\$ 16.619	160	0	160	0,00
	09.2023	\$ 75	ILS 269	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	8.133	INR 672.355	40	0	40	0,00
				\$ 2.895	\$ (24.443)	\$ (21.548)	(0,50)

### ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CAD 363	\$ 271	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	07.2023	\$ 2.556	CAD 3.479	72	0	72	0,01
CBK	07.2023	161	219	5	0	5	0,00
JPM	07.2023	2.542	3.449	64	0	64	0,00
MBC	07.2023	CAD 689	\$ 518	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	\$ 58	CAD 78	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	CAD 60	\$ 45	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	\$ 2.557	CAD 3.473	67	0	67	0,00
TOR	07.2023	CAD 5.678	\$ 4.285	2	(7)	(5)	0,00
	08.2023	\$ 4.285	CAD 5.675	8	(2)	6	0,00
				\$ 219	\$ (15)	\$ 204	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF 5.627	\$ 6.291	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07.2023	\$ 8.407	CHF 7.605	93	0	93	0,00
	08.2023	6.291	5.611	0	(2)	(2)	0,00
CLY	07.2023	CHF 2.974	\$ 3.311	0	(13)	(13)	0,00
	08.2023	\$ 3.311	CHF 2.965	13	0	13	0,00
JPM	07.2023	107	97	1	0	1	0,00
MBC	07.2023	CHF 72	\$ 81	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 373	CHF 336	2	0	2	0,00
MYI	07.2023	CHF 188	\$ 208	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	\$ 109	CHF 99	1	0	1	0,00
RYL	07.2023	CHF 9	\$ 10	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	\$ 5.878	CHF 5.282	26	0	26	0,00
UAG	07.2023	CHF 5.827	\$ 6.501	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	\$ 5.297	CHF 4.759	23	0	23	0,00
	08.2023	6.501	5.811	13	0	13	0,00
				\$ 174	\$ (30)	\$ 144	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 1.393	\$ 1.520	\$ 2	\$ (3)	\$ (1)	0,00
	07.2023	\$ 404.146	€ 376.053	6.127	0	6.127	0,14
BPS	07.2023	€ 381.416	\$ 417.909	1.786	(2)	1.784	0,04
	07.2023	\$ 404.314	€ 376.103	6.014	0	6.014	0,14
	08.2023	416.017	379.148	0	(1.798)	(1.798)	(0,04)
CBK	07.2023	€ 409.338	\$ 444.652	2	(1.937)	(1.935)	(0,04)
	07.2023	\$ 10.133	€ 9.339	56	0	56	0,00
	08.2023	413.798	380.073	1.429	0	1.429	0,03
JPM	07.2023	€ 380.073	\$ 415.001	342	0	342	0,01
	07.2023	\$ 31.065	€ 29.056	634	0	634	0,01
	08.2023	415.582	380.073	0	(354)	(354)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 7.352	\$ 7.895	0	(126)	(126)	0,00
	07.2023	\$ 14.430	€ 13.489	287	(1)	286	0,01
SOG	07.2023	404.589	376.103	5.740	0	5.740	0,13
				\$ 22.419	\$ (4.221)	\$ 18.198	0,42



Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$ 50	£ 40	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2023	10.762	8.698	298	(1)	297	0,01
BRC	07.2023	£ 181	\$ 226	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	\$ 173	£ 137	1	0	1	0,00
CBK	07.2023	£ 21	\$ 26	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 646	£ 511	4	(1)	3	0,00
JPM	07.2023	£ 8.727	\$ 11.034	0	(61)	(61)	(0,01)
	08.2023	\$ 11.037	£ 8.727	61	0	61	0,00
MBC	07.2023	£ 10	\$ 13	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 10.716	£ 8.656	289	0	289	0,01
MYI	07.2023	10.591	8.521	243	0	243	0,01
TOR	07.2023	£ 8.730	\$ 11.094	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	\$ 11.096	£ 8.730	5	0	5	0,00
				\$ 901	\$ (74)	\$ 827	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	\$ 9.164	SGD 12.400	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
GLM	07.2023	SGD 1.009	\$ 751	5	0	5	0,00
	07.2023	\$ 386	SGD 520	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07.2023	SGD 12.126	\$ 8.961	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 1.543	SGD 2.088	0	0	0	0,00
	08.2023	8.961	12.114	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	SGD 26	\$ 20	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 8.327	SGD 11.250	0	(14)	(14)	0,00
MYI	07.2023	SGD 11.725	\$ 8.678	14	0	14	0,00
	08.2023	\$ 8.678	SGD 11.715	0	(13)	(13)	0,00
UAG	07.2023	SGD 228	\$ 169	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 9.030	SGD 12.215	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 21	\$ (36)	\$ (15)	0,00
						\$ (4.864)	(0,11)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

#### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.08.2053	\$ 32.300	(26.386)	(0,61)
2,500 % fällig am 01.08.2053	49.700	(42.214)	(0,98)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (68.600)	(1,59)
Summe Anlagen		\$ 5.701.650	131,79
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (1.375.281)	(31,79)
Nettovermögen		\$ 4.326.369	100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 9.570 USD (31. Dezember 2022: 1.858 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(i) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 7.928 USD (31. Dezember 2022: 25.953 USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 320 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 76.292 USD (31. Dezember 2022: 94.783 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

## Aufstellung des Wertpapierbestands des Total Return Bond Fund (Fort.)

Barmittel in Höhe von 12.000 USD (31. Dezember 2022: 13.885 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.532.045	\$ 1.989	\$ 5.534.034
Investmentfonds	260.029	0	0	260.029
Pensionsgeschäfte	0	1.321	0	1.321
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	4.036	(29.170)	0	(25.134)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(68.600)	0	(68.600)
<b>Summen</b>	<b>\$ 264.065</b>	<b>\$ 5.435.596</b>	<b>\$ 1.989</b>	<b>\$ 5.701.650</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 4.765.456	\$ 5.405	\$ 4.770.861
Investmentfonds	292.421	0	0	292.421
Pensionsgeschäfte	0	170.895	0	170.895
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	39.217	(35.072)	0	4.145
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(68.457)	0	(68.457)
<b>Summen</b>	<b>\$ 331.638</b>	<b>\$ 4.832.822</b>	<b>\$ 5.405</b>	<b>\$ 5.169.865</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,000 %	21.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (2.919)	\$ (3.185)	(0,07)
	1,000	13.06.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(3.006)	(3.284)	(0,08)
	2,000	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(449)	(491)	(0,01)
	2,850	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(1.232)	(1.349)	(0,03)
MYI	1,500	10.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(1.004)	(1.098)	(0,03)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (9.407)</b>	<b>(0,22)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

### Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	5,080 %	28.06.2023	05.07.2023	\$ (7.978)	\$ (7.982)	(0,18)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (7.982)</b>	<b>(0,18)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 5 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 5	\$ (10)	\$ (5)	\$ (27)	\$ 0	\$ (27)
BOA	4.394	(2.980)	1.414	(167)	280	113
BPS	6.362	(5.480)	882	1.927	(1.740)	187
BRC	(160)	0	(160)	(182)	20	(162)
BSH	34	0	34	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	5	0	5	8.777	(8.710)	67
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
DUB	175	0	175	374	(270)	104
FAR	(176)	0	(176)	1	0	1
GLM	(270)	0	(270)	(710)	600	(110)
GST	(150)	260	110	(273)	260	(13)
JPM	(69)	0	(69)	(176)	0	(176)
MBC	(8.125)	5.980	(2.145)	6.728	(6.220)	508

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement <sup>(1)</sup>
MYC	\$ (946)	\$ 790	\$ (156)	\$ (550)	\$ 470	\$ (80)
MYI	(833)	960	127	(406)	270	(136)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(68)	0	(68)
SCX	269	(290)	(21)	(11.948)	11.385	(563)
SOG	(4.994)	3.690	(1.304)	(34)	0	(34)
SSB	(131)	50	(81)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(476)	270	(206)	(2)	600	598
UAG	222	(210)	12	62	0	62

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	59,27	66,92
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	68,65	47,33
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,68
Investmentfonds	6,01	7,05
Pensionsgeschäfte	0,03	4,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	0,86
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,45)	(0,84)
Freiverkehrsinanzderivate	(0,11)	0,08
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,59)	(1,65)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,22)	(0,04)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,18)	(1,85)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	37,20	36,37
Kommunalanleihen und Wechsel	0,53	0,28
US-Regierungsbehörden	50,62	37,34
US-Schatzobligationen	18,92	17,09
Non-Agency-MBS	9,03	9,41
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,52	9,66
Staatsemissionen	2,49	2,46
Kurzfristige Instrumente	0,61	2,32
Investmentfonds	6,01	7,05
Pensionsgeschäfte	0,03	4,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	0,87
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,08	0,07
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,14)	(0,12)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	(0,39)	(0,79)
Freiverkehrsinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,08	0,07
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,13)	(0,11)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,03)
Devisenterminkontrakte	(0,50)	(0,57)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,45	0,72
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,59)	(1,65)
Sonstige Aktiva und Passiva	(31,79)	(24,55)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
JPMorgan Chase & Co.				JPMorgan Chase & Co.				Energy Transfer LP			
0,969 % fällig am 23.06.2025				3,797 % fällig am 23.07.2024	\$ 1.000	\$ 709	0,31	3,900 % fällig am 15.05.2024	\$ 2.000	\$ 1.967	0,65
								4,500 % fällig am 15.04.2024	1.500	1.483	0,49
				Lloyds Banking Group PLC	1.000	998	0,33	Eni SpA	4.000	3.983	1,32
				4,050 % fällig am 16.08.2023				4,000 % fällig am 12.09.2023			
				Mitsubishi HC Capital, Inc.	2.800	2.786	0,92	HCA, Inc.	3.100	3.081	1,02
				3,960 % fällig am 19.09.2023				5,000 % fällig am 15.03.2024			
				Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	2.000	1.978	0,65	Hyundai Capital America	2.000	1.948	0,64
				0,848 % fällig am 15.09.2024				0,800 % fällig am 08.01.2024			
				3,837 % fällig am 17.04.2026	500	481	0,16	Nissan Motor Co. Ltd.	2.200	2.185	0,72
				4,788 % fällig am 18.07.2025	500	493	0,16	3,043 % fällig am 15.09.2023			
				6,128 % fällig am 26.07.2023	1.000	1.000	0,33	NXP BV	3.800	3.774	1,25
				Mizuho Financial Group, Inc.	2.700	2.673	0,88	4,875 % fällig am 01.03.2024			
				0,849 % fällig am 08.09.2024	1.100	1.100	0,36	Penske Truck Leasing Co. LP	3.000	2.961	0,98
				6,201 % fällig am 10.07.2024				3,900 % fällig am 01.02.2024			
				Morgan Stanley	2.500	2.498	0,83	Siemens Financieringsmaatschappij NV	1.527	1.529	0,51
				5,519 % fällig am 25.01.2024				5,520 % fällig am 11.03.2024			
				MUFJ Bank Ltd.	1.500	999	0,33	SK Broadband Co. Ltd.	1.000	998	0,33
				4,883 % fällig am 21.12.2023 (e)				3,875 % fällig am 13.08.2023			
				National Australia Bank Ltd.	4.000	2.666	0,88	Starbucks Corp.	1.707	1.707	0,56
				5,247 % fällig am 26.09.2023				5,509 % fällig am 14.02.2024			
				National Bank of Canada	\$ 3.500	3.493	1,16	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.	333	331	0,11
				5,579 % fällig am 06.08.2024			4,400 % fällig am 26.11.2023				
				Nationwide Building Society	600	582	0,19	Thermo Fisher Scientific, Inc.	3.800	3.800	1,26
				0,550 % fällig am 22.01.2024			5,562 % fällig am 18.10.2024				
				Nissan Motor Acceptance Co. LLC	400	384	0,13	Tyson Foods, Inc.	1.000	996	0,33
				1,050 % fällig am 08.03.2024			3,900 % fällig am 28.09.2023				
				3,875 % fällig am 21.09.2023	500	497	0,16	Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	1.000	987	0,33
				6,153 % fällig am 08.03.2024	700	695	0,23	4,400 % fällig am 15.03.2024			
				Nomura Holdings, Inc.	3.800	3.599	1,189				
				2,648 % fällig am 16.01.2025							
				Nordea Bank Abp	1.000	1.001	0,33				
				6,403 % fällig am 30.08.2023							
				Pacific Life Global Funding	1.200	1.182	0,39	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
				5,710 % fällig am 04.06.2026				<b>British Telecommunications PLC</b>			
				Santander UK Group Holdings PLC	1.500	1.489	0,49	4,500 % fällig am 04.12.2023	2.700	2.685	0,89
				4,796 % fällig am 15.11.2024				Chugoku Electric Power Co., Inc.	1.000	958	0,32
				Societe Generale S.A.	2.661	2.649	0,88	2,401 % fällig am 27.08.2024			
				4,250 % fällig am 14.09.2023				Enel Finance International NV	1.000	963	0,32
				Standard Chartered PLC	200	198	0,07	2,650 % fällig am 10.09.2024			
				6,021 % fällig am 23.11.2025				NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	300	294	0,10
				Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	2.564	2.567	0,85	2,940 % fällig am 21.03.2024	300	294	0,10
				6,060 % fällig am 16.10.2023				5,481 % fällig am 03.11.2023	2.000	2.000	0,66
				Toronto-Dominion Bank	200	200	0,07	6,112 % fällig am 21.03.2024	500	500	0,17
				6,000 % fällig am 08.03.2024				Pacific Gas & Electric Co.	600	590	0,19
				Toyota Motor Credit Corp.	4.200	4.200	1,39	1,700 % fällig am 15.11.2023	800	799	0,26
				5,569 % fällig am 10.01.2025				4,250 % fällig am 01.08.2023			
				UBS AG	1.200	1.196	0,40	Transpower New Zealand Ltd.	AUD 6.000	4.001	1,32
				5,540 % fällig am 09.08.2024			5,750 % fällig am 28.08.2023				
							Verizon Communications, Inc.	\$ 1.500	1.513	0,50	
							6,421 % fällig am 15.05.2025				
							100,835	33,35			
				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd.	AUD 500	331	0,11
				AstraZeneca PLC	400	400	0,13	4,416 % fällig am 23.08.2024			
				5,995 % fällig am 17.08.2023				Vodafone Group PLC	\$ 500	501	0,17
				Ausgrid Finance Pty. Ltd.	AUD 1.000	652	0,22	6,250 % fällig am 16.01.2024			
				3,750 % fällig am 30.10.2024							
				Baxter International, Inc.	\$ 3.500	3.493	1,15				
				5,351 % fällig am 01.12.2023				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		15.135	5,01
				Bayer U.S. Finance LLC	1.000	991	0,33				
				3,875 % fällig am 15.12.2023				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
				6,562 % fällig am 15.12.2023	2.800	2.797	0,92	<b>Federal Home Loan Bank</b>			
				Boeing Co.	1.900	1.850	0,61	5,360 % fällig am 10.05.2024	4.000	3.993	1,32
				1,433 % fällig am 04.02.2024				Ginnie Mae	500	509	0,17
				Broadcom Corp.	499	493	0,16	5,099 % fällig am 20.09.2066	488	485	0,16
				3,625 % fällig am 15.01.2024				5,924 % fällig am 20.08.2066			
				Charter Communications Operating LLC	1.000	991	0,33	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA	2.150	2.140	0,71
				4,500 % fällig am 01.02.2024			5,500 % fällig am 01.07.2053				
				6,949 % fällig am 01.02.2024	1.700	1.707	0,56				
				Cigna Group	1.400	1.400	0,46				
				6,150 % fällig am 15.07.2023				<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
				CNH Industrial NV	1.606	1.604	0,53	<b>DBWF Mortgage Trust</b>			
				4,500 % fällig am 15.08.2023				6,276 % fällig am 19.12.2030	500	493	0,16
				Daimler Truck Finance North America LLC	1.500	1.469	0,49	Dilosk RMBS DAC	€ 303	331	0,11
				1,125 % fällig am 14.12.2023				4,133 % fällig am 20.02.2060			
				5,691 % fällig am 14.12.2023	1.565	1.566	0,52	Sage AR Funding PLC	£ 200	248	0,08
								5,969 % fällig am 17.11.2030			

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
5,635 % fällig am 20.10.2031	£ 174	\$ 221	0,07	CPPIB Capital, Inc.	\$ 3.000	\$ 3.048	1,01	DBS Bank Ltd.			
Towd Point Mortgage Trust				6,342 % fällig am 04.04.2025				4,467 % fällig am			
4,604 % fällig am 25.02.2057	\$ 79	79	0,03	Export-Import Bank of Korea	5.700	3.798	1,25	22.11.2023 (e)	AUD 7.000	\$ 4.660	1,54
Trinity Square PLC				4,628 % fällig am 30.10.2023	AUD			<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
5,316 % fällig am 15.07.2059	£ 127	162	0,06	Israel Government International Bond	100	27	0,01	(0,206) % fällig am			
Tudor Rose Mortgages				3,750 % fällig am 31.03.2024	ILS			18.07.2023 (a)(b)	¥ 81.000	560	0,19
5,509 % fällig am 20.06.2048	261	331	0,11	Korea Expressway Corp.	2.500	1.653	0,55	(0,188) % fällig am	439.000	3.038	1,00
		1.865	0,62	0,928 % fällig am 02.09.2023	AUD			(0,186) % fällig am	985.000	6.816	2,25
				Korea National Oil Corp.	800	800	0,26	(0,166) % fällig am	375.000	2.595	0,86
				6,135 % fällig am 16.07.2023	\$			07.08.2023 (a)(b)			
						9.326	3,08				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
Carlyle Euro CLO DAC				<b>COMMERCIAL PAPER</b>				Summe kurzfristige Instrumente		39.097	12,93
4,213 % fällig am 15.08.2032	€ 300	320	0,11	Dominion Resources, Inc.	1.200	1.194	0,40	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 237.254	78,47	
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				5,430 % fällig am 31.07.2023	1.500	1.494	0,49				
6,400 % fällig am 15.07.2031	\$ 5.996	5.939	1,96	5,450 % fällig am 26.07.2023				<b>AKTIEN</b>			
CBAM Ltd.				Enbridge, Inc.	2.800	2.794	0,93	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
6,370 % fällig am 20.10.2029	490	487	0,16	5,470 % fällig am 14.07.2023				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
EFV Volunteer LLC				Global Payments, Inc.	300	299	0,10	PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
6,105 % fällig am 25.10.2035	69	69	0,02	5,930 % fällig am 26.07.2023	2.400	2.394	0,79	US Dollar Short-Term			
Elevation CLO Ltd.				5,950 % fällig am 14.07.2023				Floating NAV Fund (c)	1.919.787	19.117	6,32
6,478 % fällig am 15.10.2029	587	587	0,19	Humana, Inc.	2.700	2.687	0,89	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
Euro-Galaxy CLO DAC				5,500 % fällig am 01.08.2031				PIMCO ETFs plc - PIMCO			
3,831 % fällig am 24.04.2034	€ 250	265	0,09	Keurig Dr Pepper, Inc.	300	300	0,10	US Dollar Short			
Greenwood Park CLO Ltd.				5,250 % fällig am 05.07.2023				Maturity UCITS ETF (c)	109.710	10.898	3,61
6,270 % fällig am 15.04.2031	\$ 1.600	1.577	0,52	Targa Resources Corp.	1.100	1.097	0,36	Summe Investmentfonds	\$ 30.015	9,93	
Harvest CLO DAC				5,950 % fällig am 20.07.2023							
4,250 % fällig am 26.06.2030	€ 222	237	0,08	Thomson Reuters Corp.	2.800	2.793	0,92				
Madison Park Funding Ltd.				5,470 % fällig am 18.07.2023	800	798	0,26				
6,010 % fällig am 15.04.2029	\$ 190	188	0,06	5,500 % fällig am 18.07.2023							
Magnetite Ltd.				Trane Technologies Fing Ltd.	3.000	2.989	0,99				
6,382 % fällig am 18.10.2031	2.400	2.385	0,79	5,550 % fällig am 24.07.2023							
Oak Hill European Credit Partners DAC				VW Credit, Inc.	2.600	2.589	0,86				
3,940 % fällig am 20.10.2031	€ 300	319	0,11	5,430 % fällig am 27.07.2023							
SLM Private Credit Student Loan Trust						21.428	7,09				
5,842 % fällig am 15.06.2039	\$ 372	353	0,12								
		12.726	4,21								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,160 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 2.500	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025	\$ (2.553)	\$ 2.500	\$ 2.501	0,83
SSB	2,400	30.06.2023	03.07.2023	2.083	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	(2.125)	2.083	2.083	0,69
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						\$ (4.678)	\$ 4.583	\$ 4.584	1,52

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor June Futures	Short	06.2024	162	\$ 110	0,04
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	313	553	0,18
3-Month SONIA Index June Futures	Short	09.2024	120	474	0,16
3-Month SONIA Index March Futures	Short	06.2024	20	108	0,04
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	486	188	0,06
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	82	34	0,01
BIST 30 Index August Futures	Long	08.2023	425	56	0,02
CAC 40 Index July Futures	Long	07.2023	18	22	0,01
DAX Index September Futures	Long	09.2023	4	5	0,00
E-mini NASDAQ 100 Index September Futures	Long	09.2023	22	224	0,07
E-Mini Russell 2000 Index September Futures	Long	09.2023	12	5	0,00
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2023	9	31	0,01
Euro STOXX Bank September Futures	Long	09.2023	810	165	0,05
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	37	26	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	253	106	0,03
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	14	11	0,00
FTSE 100 Index September Futures	Long	09.2023	12	(12)	0,00
FTSE China A50 Index July Futures	Short	07.2023	796	(53)	(0,02)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
FTSE Taiwan Index July Futures	Long	07.2023	213	(89)	(0,03)
FTSE/JSE Index September Futures	Long	09.2023	103	(33)	(0,01)
FTSE/MIB Index September Futures	Long	09.2023	15	72	0,02
IBEX 35 Index July Futures	Long	07.2023	23	70	0,02
MSCI Singapore Index July Futures	Short	07.2023	122	15	0,01
Nikkei 225 Index September Futures	Long	09.2023	38	150	0,05
OMXS30 Index July Futures	Long	07.2023	264	(36)	(0,01)
S&P CNX Nifty Index July Futures	Long	07.2023	383	354	0,12
S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures	Long	09.2023	1	3	0,00
SPI 200 Index September Futures	Long	09.2023	38	35	0,01
Topix Index September Futures	Long	09.2023	69	356	0,12
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	55	(45)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	125	128	0,04
Volatility S&P 500 Index July Futures	Short	07.2023	269	425	0,14
VSTOXX Mini July Futures	Short	07.2023	835	136	0,04
WIG20 Index September Futures	Long	09.2023	689	21	0,01
				<b>\$ 3.615</b>	<b>1,19</b>

### Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

**\$ 3.615 1,19**

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	\$ 45.800	\$ 223	0,07
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	6.200	83	0,03
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000	20.06.2028	€ 5.700	20	0,01
				<b>\$ 326</b>	<b>0,11</b>

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 6.100	\$ 100	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	36.300	556	0,18
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	24.900	311	0,10
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	15.03.2028	INR 2.855.400	(222)	(0,07)
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	15.03.2028	1.213.800	105	0,03
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	¥ 80.000	(19)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850	20.09.2033	6.760.000	(118)	(0,04)
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,200	20.09.2053	1.660.000	(44)	(0,01)
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	15.03.2028	SGD 35.700	264	0,09
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	15.03.2028	16.800	97	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	20.09.2028	\$ 4.900	55	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	20.09.2033	4.000	11	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	20.09.2053	2.400	(23)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,338	02.01.2025	BRL 14.100	(182)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,580	02.01.2025	10.300	(205)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,770	02.01.2025	3.300	(71)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,840	02.01.2025	11.400	(244)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,877	02.01.2025	3.000	(61)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,620	02.01.2025	5.500	108	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,630	02.01.2025	4.900	96	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,840	02.01.2025	16.800	384	0,13
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,010	02.01.2025	7.900	173	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,328	02.01.2025	20.000	398	0,13
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,715	02.01.2025	7.800	(150)	(0,05)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,733	02.01.2025	8.200	148	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,180	02.01.2025	14.600	246	0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,550	02.01.2025	700	(11)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,730	02.01.2025	21.700	305	0,10
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,985	02.01.2025	10.900	138	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,525	02.01.2025	13.300	132	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,630	02.01.2025	4.500	40	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,295	04.01.2027	6.000	(34)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,445	04.01.2027	20.100	(56)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,480	02.01.2029	28.400	(34)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,813	02.01.2025	10.500	(40)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,043	04.01.2027	10.400	(12)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,070	04.01.2027	8.900	10	0,00

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,080 %	02.01.2029	BRL	15.500	\$ 47	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,106	02.01.2029		26.900	130	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,180	04.01.2027		17.900	32	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,240	04.01.2027		24.300	86	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,310	02.01.2029		22.800	137	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,350	04.01.2027		63.000	237	0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,360	02.01.2029		24.000	151	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,426	04.01.2027		7.500	30	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,451	04.01.2027		37.800	(177)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,505	04.01.2027		25.100	283	0,09
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,595	04.01.2027		28.200	(155)	(0,05)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,620	04.01.2027		36.700	(256)	(0,08)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,660	02.01.2029		500	(4)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,665	04.01.2027		9.100	(44)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,837	02.01.2029		63.300	570	0,19
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,890	02.01.2025		66.400	152	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,918	04.01.2027		28.000	189	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI		11,940	02.01.2029		17.600	169	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI		11,945	04.01.2027		21.800	(146)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,058	02.01.2029		89.700	924	0,31
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,080	04.01.2027		12.200	94	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,140	04.01.2027		6.000	(47)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,190	02.01.2029		19.900	220	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,195	04.01.2027		25.200	(230)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,260	04.01.2027		27.200	257	0,09
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,455	04.01.2027		7.900	(76)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,455	02.01.2029		16.600	202	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,560	02.01.2029		36.400	480	0,16
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,640	02.01.2029		34.000	463	0,15
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,718	04.01.2027		35.400	(395)	(0,13)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		12,740	04.01.2027		45.700	(534)	(0,18)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		12,770	04.01.2027		11.000	126	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,030	04.01.2027		35.600	(475)	(0,16)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,080	04.01.2027		47.200	(634)	(0,21)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,165	04.01.2027		27.200	(325)	(0,11)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		13,190	04.01.2027		34.700	(485)	(0,16)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		13,280	04.01.2027		9.600	137	0,05
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,000	20.09.2028	CAD	18.500	92	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,000	20.09.2033		30.100	(73)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,250	20.09.2053		8.500	105	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS		3,750	20.09.2025		67.800	320	0,11
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,250	21.12.2027	CNY	61.900	73	0,02
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,645	16.12.2025		8.600	8	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,750	15.03.2028		123.500	(186)	(0,06)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		3,000	15.03.2028		373.000	553	0,18
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		3,034	13.01.2026	COP	2.305.800	(79)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		3,220	11.12.2025		1.542.400	20	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		3,295	09.10.2025		1.638.900	(29)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		3,400	28.08.2025		1.571.400	24	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		3,850	24.04.2025		2.558.800	(51)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		3,940	05.03.2026		4.713.300	126	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,110	23.03.2026		6.908.300	173	0,06
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,240	16.04.2026		4.566.900	129	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,350	27.03.2025		625.600	12	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,360	30.03.2025		836.600	16	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,490	30.04.2026		3.271.600	(86)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,660	11.06.2026		1.410.500	32	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,880	07.05.2026		3.283.600	(76)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		5,150	13.03.2025		121.800	3	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		5,980	14.10.2026		4.816.400	(87)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		6,190	05.11.2026		9.002.000	137	0,05
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		6,360	19.11.2026		5.335.800	(71)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		6,410	08.11.2026		5.252.200	91	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		6,950	04.02.2027		6.498.500	61	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,730	28.06.2028		15.146.400	12	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		7,900	08.04.2027		4.251.300	(10)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,106	15.06.2028		22.329.600	102	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,494	27.05.2027		5.817.600	(24)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,588	11.04.2028		27.727.300	192	0,06
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,700	10.04.2028		5.318.200	42	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,750	27.03.2028		21.497.700	220	0,07
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,830	28.04.2028		19.856.000	(231)	(0,08)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,850	06.05.2027		6.000.000	(38)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,970	05.08.2027		8.528.200	71	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,970	08.02.2028		9.288.600	98	0,03
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,990	08.02.2028		22.636.600	243	0,08
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		8,992	08.02.2028		23.240.200	250	0,08
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,020	24.03.2028		33.052.700	418	0,14
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,040	08.02.2028		4.678.200	52	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,140	07.02.2028		41.500.400	503	0,17
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		9,160	20.05.2027		8.106.600	(75)	(0,02)



# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,050 %	09.09.2027	COP	8.150.200	\$ (154)	(0,05)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,210	18.11.2027		3.214.900	67	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,240	24.02.2028		72.000.000	(1.647)	(0,54)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,275	18.11.2027		6.380.400	137	0,05
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,390	30.09.2027		10.319.800	(228)	(0,08)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,420	21.11.2027		6.380.400	146	0,05
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,430	21.11.2027		6.563.400	150	0,05
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,443	21.11.2027		19.784.200	456	0,15
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,478	29.09.2027		10.549.600	(241)	(0,08)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,800	31.10.2027		32.387.900	(1.063)	(0,35)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,810	14.10.2027		5.776.200	(145)	(0,05)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,920	18.10.2027		2.950.700	(77)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,940	18.10.2027		5.920.600	(156)	(0,05)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,424	21.10.2027		13.833.600	425	0,14
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,450	21.10.2027		4.011.800	124	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,800	24.10.2027		33.238.700	(1.068)	(0,35)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,850	24.10.2027		1.323.300	46	0,02
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,500	17.03.2026	HKD	26.700	(61)	(0,02)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,508	17.03.2026		4.700	(11)	0,00
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,550	16.12.2025		4.700	(11)	0,00
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,560	17.03.2026		3.200	(7)	0,00
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,565	16.12.2025		7.800	(17)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,568	17.03.2026		6.300	14	0,00
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,583	16.12.2025		7.900	(17)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,607	17.03.2026		9.400	22	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,608	17.03.2026		7.900	18	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,618	16.09.2025		7.800	(16)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,670	17.03.2026		12.600	29	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,680	16.12.2025		3.200	(7)	0,00
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,698	16.12.2025		3.100	7	0,00
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,700	16.09.2025		11.100	22	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,750	15.09.2026		39.600	88	0,03
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,790	16.09.2025		4.700	(10)	0,00
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,867	17.03.2026		31.700	74	0,02
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,883	15.09.2026		7.800	(20)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,000	17.03.2026		11.100	26	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,000	16.06.2026		43.400	(109)	(0,04)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,085	16.09.2025		11.200	23	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,100	16.06.2026		12.700	32	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,120	17.06.2025		3.200	6	0,00
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,250	15.12.2026		48.800	149	0,05
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,340	18.03.2025		8.000	(12)	0,00
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,500	16.03.2027		48.910	(157)	(0,05)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,600	17.06.2025		5.900	(11)	0,00
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,715	18.03.2025		10.800	(17)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,750	16.03.2027		9.800	29	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	2,000	16.03.2027		11.500	35	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	2,750	16.03.2027		18.400	(59)	(0,02)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	3,000	15.06.2027		5.000	(16)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,000	21.09.2027		10.400	29	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,250	21.09.2027		46.600	166	0,05
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	3,250	15.03.2028		287.300	(1.198)	(0,40)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,500	21.09.2027		27.940	96	0,03
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,750	21.09.2027		40.600	149	0,05
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,750	15.03.2028		229.200	126	0,04
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	4,000	21.12.2027		88.700	31	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	4,500	21.12.2027		150.900	(64)	(0,02)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,520	26.07.2026	ILS	24.300	(658)	(0,22)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,601	05.07.2026		2.800	77	0,03
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,628	25.06.2026		5.600	(140)	(0,05)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,692	13.09.2026		48.400	1.203	0,40
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,728	04.06.2026		4.100	(106)	(0,04)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,730	21.05.2026		3.500	88	0,03
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,750	10.12.2026		34.100	(899)	(0,30)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,900	07.10.2026		9.000	(227)	(0,08)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,905	25.11.2026		8.100	(217)	(0,07)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,965	14.01.2027		10.600	283	0,09
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,040	28.10.2026		10.400	(257)	(0,08)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,049	12.11.2026		12.000	282	0,09
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,105	21.01.2027		16.900	425	0,14
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,178	04.02.2027		13.800	335	0,11
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,183	06.05.2027		7.500	116	0,04
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,390	27.05.2027		11.400	159	0,05
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,666	18.07.2027		7.500	17	0,01
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,670	15.07.2027		34.800	(91)	(0,03)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,825	10.06.2027		10.900	(105)	(0,03)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,210	17.06.2027		1.900	21	0,01
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,260	18.11.2027		38.400	(68)	(0,02)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,290	16.11.2027		25.363	(23)	(0,01)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,530	03.04.2028		69.500	(196)	(0,06)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,590	31.03.2028		24.500	23	0,01

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung		3-Month ILS-TELBOR	3,590 %	18.05.2028	ILS	23.700	\$ 45	0,01
Erhalt		3-Month ILS-TELBOR	3,619	05.01.2028		27.400	(13)	0,00
Erhalt		3-Month ILS-TELBOR	3,650	02.01.2028		18.900	(17)	(0,01)
Erhalt		3-Month ILS-TELBOR	3,670	30.12.2027		19.000	(80)	(0,03)
Erhalt		3-Month ILS-TELBOR	3,720	21.10.2027		72.900	(271)	(0,09)
Erhalt		3-Month ILS-TELBOR	3,980	23.02.2028		8.600	(45)	(0,01)
Erhalt		3-Month ILS-TELBOR	4,030	24.02.2028		54.700	(455)	(0,15)
Zahlung		3-Month ILS-TELBOR	4,130	03.03.2028		30.000	91	0,03
Erhalt		3-Month KRW-KORIBOR	3,000	21.06.2028	KRW	25.301.100		0,04
Zahlung		3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2028		37.768.000	(630)	(0,21)
Zahlung		3-Month KRW-KORIBOR	3,500	15.03.2028		10.054.900	(140)	(0,05)
Erhalt		3-Month KRW-KORIBOR	3,500	15.03.2028		32.096.900	343	0,11
Erhalt		3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	15.03.2028	THB	397.700	142	0,05
Zahlung		3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028		382.200	(103)	(0,03)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	4,900	12.11.2025	ZAR	3.400	(15)	(0,01)
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	4,938	18.09.2025		7.000	32	0,01
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	5,120	02.09.2025		500	2	0,00
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	5,330	13.05.2025		8.300	(42)	(0,01)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	5,375	27.05.2025		7.800	(40)	(0,01)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	5,601	09.06.2026		31.050	(124)	(0,04)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	5,680	08.06.2026		41.150	(167)	(0,06)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	5,739	28.07.2026		72.100	(292)	(0,10)
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	5,780	03.03.2026		36.600	125	0,04
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	5,860	23.06.2026		75.600	273	0,09
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	5,950	17.03.2026		1.200	4	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	5,980	22.09.2026		43.900	164	0,05
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	6,023	01.07.2026		28.100	98	0,03
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	6,200	22.04.2025		7.800	(51)	(0,02)
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	6,231	29.09.2026		55.400	185	0,06
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	6,300	23.12.2026		30.900	(108)	(0,04)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	6,320	23.04.2025		5.600	(38)	(0,01)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	6,400	30.12.2026		33.600	(112)	(0,04)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	6,540	04.01.2027		37.100	(120)	(0,04)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	6,540	23.02.2027		64.600	(213)	(0,07)
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	6,670	12.01.2027		73.700	225	0,07
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	6,690	04.11.2026		2.000	6	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	6,835	28.08.2024		100	1	0,00
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	6,855	03.11.2026		22.830	(58)	(0,02)
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	7,049	09.03.2027		70.000	173	0,06
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	7,489	18.05.2027		112.100	128	0,04
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	7,600	19.06.2024		7.100	56	0,02
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	7,705	10.01.2028		504.000	(962)	(0,32)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	7,710	06.05.2027		22.200	(1)	0,00
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	7,730	09.01.2028		119.300	(212)	(0,07)
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	7,740	17.08.2027		63.300	(24)	(0,01)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	7,750	20.03.2024		9.180	(70)	(0,02)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	7,800	19.12.2023		3.100	(22)	(0,01)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	7,900	06.01.2028		119.300	(169)	(0,06)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	8,055	14.11.2027		8.400	(2)	0,00
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	8,064	27.07.2027		21.200	(46)	(0,02)
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,120	13.03.2028		99.500	37	0,01
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,205	17.02.2028		241.300	202	0,07
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,430	23.02.2028		152.700	59	0,02
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,465	23.02.2028		240.400	75	0,02
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,500	17.10.2027		12.000	(1)	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,510	25.04.2028		262.000	69	0,02
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	8,560	25.04.2028		72.800	3	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	8,950	11.05.2028		67.000	(88)	(0,03)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	9,185	12.06.2028		87.400	(10)	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	9,350	18.05.2028		56.800	(55)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	20.09.2025	AUD	102.900	167	0,06
Zahlung <sup>(3)</sup>		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033		23.400	(66)	(0,02)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	3,570	09.07.2026	CLP	1.279.600	(157)	(0,05)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	3,728	20.08.2026		2.239.800	236	0,08
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,133	23.06.2028		3.579.500	(23)	(0,01)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,158	15.06.2028		7.959.600	(65)	(0,02)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,220	19.11.2026		2.363.300	(60)	(0,02)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,230	14.06.2028		1.732.400	(4)	0,00
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,237	14.06.2028		2.356.600	(10)	0,00
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,261	17.11.2027		3.774.600	(56)	(0,02)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,280	17.11.2027		3.854.600	(53)	(0,02)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,290	13.06.2028		1.707.900	1	0,00
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,293	21.03.2028		4.537.600	(97)	(0,03)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,300	17.11.2027		940.100	(10)	0,00
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,300	22.03.2028		5.848.400	(122)	(0,04)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,358	18.11.2027		2.390.300	(19)	(0,01)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,420	28.10.2026		1.284.200	34	0,01
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,420	18.11.2027		7.201.400	(47)	(0,02)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,458	20.03.2028		7.549.300	(95)	(0,03)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,530	18.11.2027		2.406.700	2	0,00
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,620	22.10.2026		1.673.000	26	0,01

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,650 %	03.02.2028		CLP	5.748.800	\$ 70	0,02
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,650	01.06.2028			2.946.200	(45)	(0,01)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,699	01.06.2028			4.644.000	(84)	(0,03)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,780	31.05.2028			1.398.200	(31)	(0,01)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,798	31.05.2028			5.567.800	(129)	(0,04)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	5,830	25.04.2028			5.063.700	58	0,02
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	5,975	18.01.2027			1.912.300	28	0,01
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	6,000	16.02.2028			5.590.200	(58)	(0,02)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	6,207	31.05.2027			1.836.600	49	0,02
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	6,210	27.03.2026			10.738.200	(112)	(0,04)
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	6,230	27.05.2027			1.675.600	44	0,01
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	6,370	03.03.2028			4.119.100	(142)	(0,05)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	6,380	03.03.2028			4.366.200	(153)	(0,05)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	6,385	07.03.2028			6.138.400	(222)	(0,07)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	6,490	06.03.2028			8.848.600	(369)	(0,12)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	6,885	13.05.2027			1.642.400	(85)	(0,03)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	21.10.2027			5.870.000	(409)	(0,14)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	7,161	17.06.2027			2.386.300	(174)	(0,06)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	7,174	17.06.2027			1.432.400	(109)	(0,04)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	7,420	09.09.2027			2.595.500	(206)	(0,07)
Erhalt		6-Month CLP-CHILIBOR	7,900	30.09.2027			2.317.200	(250)	(0,08)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	0,421	15.05.2025		CZK	900	(3)	0,00
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	0,590	26.03.2025			10.900	(46)	(0,01)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	0,637	24.07.2025			7.700	(38)	(0,01)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	0,665	22.09.2025			5.100	(24)	(0,01)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	0,690	04.05.2025			4.100	(17)	(0,01)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	0,710	30.03.2025			100	0	0,00
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	0,776	20.08.2025			7.900	(39)	(0,01)
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	1,100	31.12.2025			57.000	256	0,08
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	1,124	13.03.2025			12.000	(58)	(0,02)
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	1,570	09.03.2026			59.800	298	0,10
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	1,580	19.03.2026			51.600	237	0,08
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	1,715	23.07.2026			100.200	(494)	(0,16)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	1,775	04.06.2026			57.900	(256)	(0,09)
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	1,934	02.07.2026			95.200	450	0,15
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	1,972	07.07.2026			55.500	266	0,09
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	2,015	10.08.2026			132.200	536	0,18
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	3,340	06.01.2032			171.700	(114)	(0,04)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	3,770	11.02.2027			72.000	(159)	(0,05)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,195	21.03.2033			125.300	(28)	(0,01)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,220	21.03.2033			67.600	(7)	0,00
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	4,300	18.03.2027			80.900	94	0,03
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,420	22.03.2028			172.600	(103)	(0,03)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,420	05.05.2032			9.700	(10)	0,00
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,420	01.06.2033			89.100	(25)	(0,01)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,440	12.12.2027			253.100	166	0,06
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	4,455	01.06.2033			90.400	(96)	(0,03)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,510	22.03.2028			151.800	(62)	(0,02)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,560	09.12.2027			156.700	140	0,05
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,630	21.03.2028			151.800	(26)	(0,01)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,640	07.12.2027			156.700	163	0,05
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,680	08.12.2027			156.700	178	0,06
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,695	04.05.2028			116.300	18	0,01
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	4,735	04.05.2028			95.500	23	0,01
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	5,070	20.04.2028			101.000	(86)	(0,03)
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	5,090	20.04.2028			121.900	(109)	(0,04)
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	5,103	16.11.2027			240.300	456	0,15
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	5,140	11.07.2027			58.000	85	0,03
Zahlung		6-Month CZK-PRIBOR	5,175	11.07.2027			82.400	83	0,03
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	5,175	23.02.2028			48.100	(39)	(0,01)
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	5,185	24.05.2027			64.000	(38)	(0,01)
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	5,215	24.02.2028			249.500	(242)	(0,08)
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	5,264	02.03.2028			224.100	(288)	(0,10)
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	5,285	20.05.2027			83.300	(62)	(0,02)
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	5,538	02.09.2027			52.400	(131)	(0,04)
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	5,640	10.06.2027			3.400	(5)	0,00
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	5,740	03.10.2027			121.600	(372)	(0,12)
Erhalt		6-Month CZK-PRIBOR	5,788	20.10.2027			538.000	(1.910)	(0,63)
Zahlung <sup>(3)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053		€	300	(1)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033			19.300	(32)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025			104.700	651	0,22
Erhalt		6-Month HUF-BBR	1,085	14.08.2025		HUF	186.300	112	0,04
Zahlung		6-Month HUF-BBR	1,115	08.01.2026			1.131.600	(790)	(0,26)
Erhalt		6-Month HUF-BBR	1,220	15.01.2026			559.700	392	0,13
Erhalt		6-Month HUF-BBR	1,230	15.01.2026			872.700	612	0,20
Zahlung		6-Month HUF-BBR	1,920	16.04.2026			426.000	(255)	(0,08)
Erhalt		6-Month HUF-BBR	1,958	19.03.2026			1.746.000	1.055	0,35
Erhalt		6-Month HUF-BBR	1,980	09.03.2026			646.300	400	0,13
Erhalt		6-Month HUF-BBR	2,499	05.07.2026			78.800	49	0,02
Erhalt		6-Month HUF-BBR	2,558	06.08.2026			1.156.900	676	0,22
Zahlung		6-Month HUF-BBR	5,060	18.02.2027			885.100	(363)	(0,12)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variablem Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month HUF-BBR		5,500 %	04.03.2027	HUF	627.800	\$ 226	0,07
Erhalt	6-Month HUF-BBR		6,100	11.03.2027		498.000	148	0,05
Zahlung	6-Month HUF-BBR		7,480	03.06.2027		700.700	19	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR		7,640	13.05.2027		721.400	72	0,02
Zahlung	6-Month HUF-BBR		8,320	20.01.2028		729.300	(41)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		8,500	25.01.2028		5.485.200	(38)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		8,550	24.01.2028		1.174.900	(30)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		8,650	19.01.2028		731.300	(13)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR		8,740	28.04.2028		4.915.800	130	0,04
Zahlung	6-Month HUF-BBR		8,800	27.04.2028		1.126.200	78	0,03
Erhalt	6-Month HUF-BBR		9,490	11.04.2028		2.501.700	(344)	(0,11)
Erhalt	6-Month HUF-BBR		9,500	11.04.2028		1.025.500	(142)	(0,05)
Erhalt	6-Month HUF-BBR		9,510	11.04.2028		1.038.900	(184)	(0,06)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		9,625	15.08.2027		695.900	234	0,08
Zahlung	6-Month HUF-BBR		9,750	22.11.2027		283.976	83	0,03
Zahlung	6-Month HUF-BBR		9,800	16.11.2027		2.235.924	655	0,22
Erhalt	6-Month HUF-BBR		9,900	16.12.2027		162.500	(54)	(0,02)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		10,000	18.11.2027		319.400	102	0,03
Erhalt	6-Month HUF-BBR		10,050	15.12.2027		164.000	(57)	(0,02)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		10,070	18.07.2027		428.900	109	0,04
Zahlung	6-Month HUF-BBR		10,100	15.07.2027		488.900	125	0,04
Erhalt	6-Month HUF-BBR		10,340	15.12.2027		334.200	(128)	(0,04)
Erhalt	6-Month HUF-BBR		11,140	23.12.2027		2.021.500	(932)	(0,31)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		11,350	11.11.2027		289.300	111	0,04
Erhalt	6-Month HUF-BBR		11,524	12.09.2027		2.052.600	(899)	(0,30)
Erhalt	6-Month HUF-BBR		11,650	09.09.2027		359.200	(170)	(0,06)
Erhalt	6-Month HUF-BBR		12,500	19.10.2027		4.079.400	(2.513)	(0,83)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,481	11.08.2025	PLN	3.400	(99)	(0,03)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,560	17.04.2025		1.900	(48)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,580	11.01.2026		8.500	(291)	(0,10)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,585	22.09.2025		6.000	(172)	(0,06)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,635	08.05.2025		1.100	(28)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		0,730	05.02.2026		6.500	217	0,07
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		0,890	12.02.2026		20.900	674	0,22
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		1,188	19.03.2026		17.800	493	0,16
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		1,229	09.03.2026		7.000	206	0,07
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		1,405	10.08.2026		27.100	767	0,25
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		1,450	05.07.2026		5.300	(165)	(0,05)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		1,465	07.06.2026		2.400	63	0,02
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		2,185	08.10.2026		8.300	(181)	(0,06)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		2,983	08.11.2026		20.100	276	0,09
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		3,525	24.12.2026		3.300	(29)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		3,600	27.12.2026		3.300	(26)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		3,739	03.01.2027		1.000	(15)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		3,934	04.03.2027		19.200	(95)	(0,03)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,219	04.02.2027		10.200	112	0,04
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		4,830	18.03.2027		2.000	8	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		4,930	29.06.2028		24.400	(16)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		5,179	01.04.2027		7.900	6	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		5,300	12.01.2028		23.800	11	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		5,430	16.03.2028		6.700	12	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		5,460	16.08.2027		1.300	(25)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		5,490	12.12.2027		19.700	211	0,07
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		5,525	12.12.2027		6.500	72	0,02
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		5,540	01.06.2028		26.600	(1)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		5,670	09.12.2027		19.500	247	0,08
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		5,750	08.12.2027		16.300	221	0,07
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		5,800	07.12.2027		32.600	457	0,15
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		5,830	08.12.2027		32.600	470	0,16
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,160	23.02.2028		42.600	(449)	(0,15)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		6,310	18.11.2027		14.800	286	0,09
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,348	09.09.2027		14.800	(277)	(0,09)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		6,365	17.11.2027		15.600	310	0,10
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		6,455	16.11.2027		23.630	493	0,16
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		6,650	29.09.2027		33.200	(899)	(0,30)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		7,223	29.06.2027		23.200	319	0,11
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		7,726	24.10.2027		87.700	(2.886)	(0,95)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		7,761	21.10.2027		7.052	239	0,08
Erhalt	6-Month TWD-TAIBOR		1,250	15.03.2028	TWD	861.000	3	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE		4,775	26.06.2025	MXN	4.900	27	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIE		4,800	05.02.2026		65.500	336	0,11
Zahlung	28-Day MXN-TIE		5,080	09.10.2025		14.500	(91)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		5,095	30.10.2025		23.500	(149)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		5,120	06.05.2025		15.800	(95)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		5,443	17.04.2025		5.700	(35)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE		5,550	12.03.2026		32.800	171	0,06
Zahlung	28-Day MXN-TIE		6,050	04.06.2026		22.600	(104)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIE		6,095	20.03.2026		51.800	231	0,08
Zahlung	28-Day MXN-TIE		6,210	28.03.2025		4.300	(29)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		6,230	07.04.2025		16.700	(118)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIE		6,255	21.05.2026		23.500	98	0,03

## Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,460 %	18.06.2026	MXN	43.000	\$ 159	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,625	11.09.2026		21.100	78	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,635	11.09.2026		21.100	77	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,740	17.09.2026		28.500	98	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,109	03.12.2026		102.300	(296)	(0,10)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,113	24.09.2026		134.600	403	0,13
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,264	17.12.2026		30.000	82	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,273	12.11.2026		33.880	(87)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,353	05.11.2026		58.150	145	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,370	14.10.2026		24.200	(59)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,383	28.01.2027		29.500	71	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,460	04.02.2027		44.800	(99)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,530	14.01.2027		24.100	54	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,590	29.10.2026		40.000	85	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,673	31.12.2026		23.900	45	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,745	11.02.2027		53.100	(97)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,055	13.06.2033		57.100	(29)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,207	19.06.2028		135.000	(44)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,250	02.12.2032		85.900	17	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,280	29.07.2027		40.300	(38)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,281	28.03.2033		68.000	44	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,340	21.04.2033		35.500	(57)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,374	14.03.2033		135.600	146	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,400	21.05.2027		47.400	(19)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,402	20.05.2027		34.800	(14)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,438	20.03.2028		307.500	22	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,453	30.11.2027		332.600	(10)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,480	30.11.2027		105.200	3	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,498	11.03.2027		25.400	(10)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,563	16.05.2033		31.700	(59)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,616	05.11.2027		165.400	48	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,620	09.11.2027		82.900	55	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,728	22.05.2028		135.300	(116)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,740	30.08.2027		30.800	(19)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,755	03.02.2033		45.900	(114)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,785	06.05.2027		24.900	(6)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,800	02.02.2033		73.500	(195)	(0,06)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,810	01.07.2027		60.100	24	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,844	07.02.2033		104.900	(299)	(0,10)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,921	25.08.2027		61.100	(34)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,940	07.02.2028		136.200	(146)	(0,05)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,020	03.06.2027		91.300	(78)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,060	14.09.2027		61.100	(75)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,070	24.06.2027		13.500	(13)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,114	24.06.2027		11.700	(12)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,215	09.02.2028		146.800	(250)	(0,08)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,290	23.09.2027		22.500	35	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,295	21.10.2027		116.100	(191)	(0,06)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,300	24.09.2027		34.400	54	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,345	16.02.2028		99.400	(202)	(0,07)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,382	12.10.2027		153.800	(289)	(0,10)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,390	07.10.2027		40.300	(74)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,536	22.09.2027		67.800	(140)	(0,05)
Zahlung	CPURNSA	2,525	07.06.2033	\$	4.200	(10)	0,00
						\$ (5.452)	(1,81)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						\$ (5.126)	(1,70)

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückertlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### OPTIONSKAUF

#### DEIVENSOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC USD versus JPY	¥	125.000	25.07.2023	20.000	\$ 2	\$ 1 0,00
RBC	Call - OTC USD versus CAD	CAD	1,383	20.07.2023	6.000	1	0 0,00
						\$ 3	\$ 1 0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 55.000	\$ (47)	\$ 129	\$ 82	0,03
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.12.2027	143.400	98	30	128	0,04
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	125.700	(76)	(36)	(112)	(0,04)
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	5.100	6	2	8	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	55.300	169	(120)	49	0,02
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	4,000	21.12.2027	39.700	131	(256)	(125)	(0,04)
JPM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	24.800	23	14	37	0,01
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.12.2027	86.500	103	(26)	77	0,03
MYC	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	49.800	(1)	(44)	(45)	(0,02)
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	4,000	21.12.2027	47.600	101	(251)	(150)	(0,05)
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	40.300	46	(10)	36	0,01
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	4,250	21.12.2027	38.980	13	198	211	0,07
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	2.100	(3)	1	(2)	0,00
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	33.500	29	1	30	0,01
						\$ 592	\$ (368)	\$ 224	0,07

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
MEI	Erhalt	BOVESPA Index	195	0,000 %	BRL 23.509	16.08.2023	\$ 0	\$ (28)	\$ (28)	(0,01)
	Erhalt	KOSPI2 Index	32.000.000	0,000	KRW 11.068.163	14.09.2023	0	(131)	(131)	(0,04)
	Zahlung	Thailand Equity Index	270.400	0,000	THB 244.719	28.09.2023	0	(73)	(73)	(0,03)
						\$ 0	\$ (232)	\$ (232)	(0,08)	

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettozunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	\$ 3.216	¥ 431.000	\$ 0	\$ (232)	\$ (232)	(0,08)
	08.2023	6.410	9.562	0	(37)	(37)	(0,01)
BOA	07.2023	CLP 92.793	\$ 115	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	IDR 61.808.103	4.131	9	0	9	0,00
BPS	07.2023	PLN 1.643	397	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	TRY 3.063	138	21	0	21	0,01
BPS	07.2023	\$ 6	CZK 121	0	0	0	0,00
	07.2023	4.113	IDR 61.808.103	9	0	9	0,00
BPS	07.2023	279	PLN 1.172	9	0	9	0,00
	07.2023	77	TRY 1.837	0	(7)	(7)	0,00
BPS	08.2023	AUD 37.031	\$ 25.029	352	(2)	350	0,12
	08.2023	CAD 4.164	3.102	0	(46)	(46)	(0,02)
BPS	08.2023	£ 1.721	2.151	0	(39)	(39)	(0,01)
	08.2023	¥ 1.786.900	12.893	451	0	451	0,15
BPS	08.2023	NZD 19.475	12.129	200	0	200	0,07
	08.2023	SEK 69.738	6.783	314	0	314	0,10
BPS	08.2023	\$ 859	AUD 1.306	14	(2)	12	0,00
	08.2023	708	CAD 940	3	0	3	0,00
BPS	08.2023	3.297	€ 3.066	55	0	55	0,02
	08.2023	126	£ 101	2	0	2	0,00
BPS	08.2023	122	¥ 16.400	0	(8)	(8)	0,00
	08.2023	19	SEK 205	0	0	0	0,00
BPS	08.2023	ZAR 7.012	\$ 372	4	(2)	2	0,00
	09.2023	HKD 12.697	1.625	2	0	2	0,00
BPS	09.2023	IDR 24.088.000	1.600	0	0	0	0,00
	09.2023	INR 1.929.851	23.480	22	0	22	0,01
BPS	09.2023	KRW 640.033	505	17	0	17	0,01
	09.2023	TWD 45.097	1.487	36	0	36	0,01
BPS	09.2023	\$ 4.131	IDR 61.857.680	0	(23)	(23)	(0,01)
	11.2023	28	ILS 100	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	BRL 11.493	\$ 2.340	0	(42)	(42)	(0,01)
	07.2023	PLN 460	107	0	(6)	(6)	0,00
BPS	07.2023	SGD 614	463	9	0	9	0,00
	07.2023	TRY 329	14	2	0	2	0,00
BPS	07.2023	\$ 4	CLP 2.938	0	0	0	0,00
	07.2023	63	COP 262.528	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07.2023	5.634	CZK 120.532	0	(103)	(103)	(0,03)
	07.2023	380	PLN 1.586	10	0	10	0,00
BPS	07.2023	15	SGD 20	0	0	0	0,00
	07.2023	9	TRY 196	0	(1)	(1)	0,00
BPS	08.2023	AUD 487	\$ 331	7	0	7	0,00
	08.2023	CAD 1.757	1.300	0	(29)	(29)	(0,01)
BPS	08.2023	CHF 17.730	20.073	170	0	170	0,06
	08.2023	CNH 7.386	1.069	50	0	50	0,02
BPS	08.2023	€ 6.600	7.122	6	(100)	(94)	(0,03)
	08.2023	SEK 2.655	248	2	0	2	0,00
BPS	08.2023	TWD 23.310	763	15	0	15	0,01

Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	\$ 1.045	AUD 1.538	\$ 0	\$ (20)	\$ (20)	(0,01)
	08.2023	524	€ 486	7	0	7	0,00
	08.2023	334	¥ 46.300	0	(12)	(12)	0,00
	08.2023	2.502	MXN 43.559	17	0	17	0,01
	08.2023	95	ZAR 1.776	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	ZAR 888	\$ 46	0	0	0	0,00
	09.2023	AUD 3.700	2.449	0	(19)	(19)	(0,01)
	09.2023	BRL 5.970	1.200	0	(21)	(21)	(0,01)
	09.2023	CLP 940.367	1.151	0	(10)	(10)	0,00
	09.2023	COP 262.528	62	1	0	1	0,00
	09.2023	¥ 627.327	4.500	108	0	108	0,04
	09.2023	KRW 2.750.742	2.137	40	0	40	0,01
	09.2023	PLN 14.040	3.300	0	(143)	(143)	(0,05)
	09.2023	RON 11.139	2.400	0	(45)	(45)	(0,01)
	09.2023	SEK 13.610	1.258	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023	THB 641.340	18.621	395	0	395	0,13
	09.2023	\$ 6.791	AUD 10.000	0	(120)	(120)	(0,04)
	09.2023	1.300	BRL 6.416	12	0	12	0,00
	09.2023	12.500	CAD 16.638	88	0	88	0,03
	09.2023	1.300	COP 5.885.100	81	0	81	0,03
	09.2023	5.349	€ 4.875	0	(10)	(10)	0,00
	09.2023	13.728	£ 10.688	0	(138)	(138)	(0,05)
	09.2023	910	HUF 313.488	0	(10)	(10)	0,00
	09.2023	5.583	ILS 19.917	0	(201)	(201)	(0,07)
	09.2023	9.100	KRW 11.708.485	0	(176)	(176)	(0,06)
	09.2023	5.225	NZD 8.400	0	(80)	(80)	(0,03)
	09.2023	1.400	PLN 5.722	3	0	3	0,00
	09.2023	3.311	RON 15.030	0	(12)	(12)	0,00
	09.2023	14.406	THB 493.710	0	(377)	(377)	(0,12)
	09.2023	5.364	ZAR 99.481	0	(139)	(139)	(0,05)
BRC	12.2023	MXN 383.334	\$ 21.501	0	(187)	(187)	(0,06)
	07.2023	CZK 52.677	2.384	0	(34)	(34)	(0,01)
	07.2023	¥ 1.370.000	10.592	1.096	0	1.096	0,36
	07.2023	MYR 66.031	14.392	218	0	218	0,07
	07.2023	SGD 453	337	3	0	3	0,00
	07.2023	TRY 1.434	60	5	0	5	0,00
	07.2023	\$ 6.480	PLN 26.895	134	0	134	0,04
	07.2023	1.771	RON 8.150	21	0	21	0,01
	07.2023	56	SGD 75	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	COP 3.274.284	\$ 769	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	£ 15.617	19.487	0	(373)	(373)	(0,12)
	08.2023	HUF 686.424	1.978	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	¥ 322.368	2.436	191	0	191	0,06
	08.2023	\$ 17.159	CNH 122.253	0	(300)	(300)	(0,10)
	08.2023	4.353	€ 4.015	36	0	36	0,01
	08.2023	538	£ 427	6	(1)	5	0,00
	08.2023	90	¥ 12.200	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	78	MXN 1.352	0	0	0	0,00
	08.2023	156	ZAR 3.021	4	(1)	3	0,00
	08.2023	ZAR 1.299	\$ 68	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	HKD 7.899	1.011	1	0	1	0,00
	09.2023	ILS 14.703	4.137	164	0	164	0,05
	09.2023	SGD 2.683	2.009	21	0	21	0,01
	09.2023	\$ 113	HKD 886	0	0	0	0,00
	09.2023	2.000	ILS 7.236	0	(45)	(45)	(0,01)
	09.2023	3.300	KRW 4.275.150	0	(42)	(42)	(0,01)
CBK	07.2023	BRL 12.668	\$ 2.640	14	0	14	0,01
	07.2023	€ 1.272	1.365	0	(23)	(23)	(0,01)
	07.2023	IDR 47.763.202	3.179	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	MXN 1.059	59	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	RON 14.639	3.238	19	0	19	0,01
	07.2023	TRY 1.924	85	11	0	11	0,00
	07.2023	\$ 1.763	CLP 1.426.848	14	0	14	0,00
	07.2023	646	CZK 13.928	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	3.179	IDR 47.763.202	7	0	7	0,00
	07.2023	18.900	INR 1.551.407	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	16.672	PHP 909.467	0	(230)	(230)	(0,08)
	07.2023	33	PLN 133	0	0	0	0,00
	08.2023	CAD 1.688	\$ 1.254	0	(23)	(23)	(0,01)
	08.2023	CLP 2.024.098	2.474	0	(31)	(31)	(0,01)
	08.2023	CNH 220.848	31.676	1.220	0	1.220	0,40
	08.2023	¥ 339.412	2.554	191	0	191	0,06
	08.2023	NOK 8.659	830	21	0	21	0,01
	08.2023	SEK 22.976	2.266	134	0	134	0,04
	08.2023	TWD 55.070	1.804	36	0	36	0,01
	08.2023	\$ 173	AUD 262	2	0	2	0,00
	08.2023	13.266	CLP 10.669.473	0	(23)	(23)	(0,01)
	08.2023	579	€ 538	10	0	10	0,00
	08.2023	27.504	£ 21.737	138	0	138	0,05
	08.2023	698	¥ 95.800	0	(31)	(31)	(0,01)
	08.2023	73	SEK 765	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	2.757	TWD 84.415	0	(47)	(47)	(0,02)



Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	\$ 169	ZAR 3.177	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	09.2023	COP 6.025.600	\$ 1.400	0	(14)	(14)	0,00
	09.2023	IDR 21.721	1	0	0	0	0,00
	09.2023	INR 62.165	756	1	0	1	0,00
	09.2023	MXN 26.102	1.500	0	0	0	0,00
	09.2023	PEN 38.618	10.548	0	(97)	(97)	0,00
	09.2023	SEK 13.203	1.221	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	\$ 2.611	BRL 12.668	0	(14)	(14)	0,00
	09.2023	4.259	IDR 63.902.621	0	(15)	(15)	0,01
	09.2023	13	ILS 48	0	0	0	0,00
	09.2023	4.260	NOK 44.774	0	(70)	(70)	0,02
	09.2023	ZAR 12.167	\$ 658	19	0	19	0,01
	10.2023	\$ 1.187	CLP 969.447	7	0	7	0,00
	11.2023	ILS 98	\$ 30	3	0	3	0,00
	04.2024	100	28	0	0	0	0,00
DUB	07.2023	MXN 35.716	2.080	1	0	1	0,00
	07.2023	\$ 844	BRL 4.570	104	0	104	0,03
	07.2023	133	CZK 2.947	2	0	2	0,00
	08.2023	€ 920	\$ 1.004	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 22.495	CHF 20.171	149	0	149	0,05
	08.2023	302	£ 243	7	0	7	0,00
	08.2023	34	SEK 360	0	0	0	0,00
	08.2023	34	ZAR 647	0	0	0	0,00
FAR	09.2023	3.360	HUF 1.156.833	0	(39)	(39)	0,01
	07.2023	1.828	CLP 1.450.837	0	(21)	(21)	0,01
	08.2023	51	£ 41	1	0	1	0,00
GLM	07.2023	COP 24.235.035	\$ 5.742	0	(48)	(48)	0,02
	07.2023	PHP 102	2	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN 1.686	397	0	(17)	(17)	0,01
	07.2023	SGD 5.942	4.476	83	0	83	0,03
	07.2023	\$ 803	BRL 4.293	87	0	87	0,03
	07.2023	8	RON 36	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF 2.217	\$ 2.505	16	0	16	0,01
	08.2023	NOK 16.616	1.566	13	0	13	0,00
	09.2023	BRL 33	6	0	0	0	0,00
	09.2023	SGD 406	304	3	0	3	0,00
	09.2023	\$ 10.190	BRL 51.385	344	0	344	0,11
	09.2023	1.476	MXN 25.802	6	0	6	0,00
	09.2023	147	SGD 196	0	(1)	(1)	0,00
IND	10.2023	MXN 20.762	\$ 1.183	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	\$ 28.296	¥ 3.784.000	0	(2.041)	(2.041)	0,67
	07.2023	41	SGD 55	0	0	0	0,00
	08.2023	£ 1.710	\$ 2.135	0	(40)	(40)	0,01
	08.2023	NOK 6.834	652	13	0	13	0,00
JPM	07.2023	431	25	0	0	0	0,00
	07.2023	SGD 2.086	1.579	37	0	37	0,01
	07.2023	TRY 6.350	276	34	0	34	0,01
	07.2023	\$ 1.089	PHP 59.517	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	62	PLN 264	3	0	3	0,00
	07.2023	22	SGD 30	0	0	0	0,00
	07.2023	178	TRY 4.085	0	(22)	(22)	0,01
	08.2023	CAD 2.631	1.968	0	(22)	(22)	0,01
	08.2023	CNH 18.874	2.731	128	0	128	0,04
	08.2023	€ 1.034	1.139	9	0	9	0,00
	08.2023	£ 760	982	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	¥ 339.295	2.554	192	0	192	0,06
	08.2023	MXN 2.041	118	0	0	0	0,00
	08.2023	NOK 22.739	2.144	18	0	18	0,01
	08.2023	68	AUD 102	0	0	0	0,00
	08.2023	1.246	CAD 1.687	30	0	30	0,01
	08.2023	228	€ 211	2	0	2	0,00
	08.2023	1.094	£ 875	21	(2)	19	0,01
	08.2023	6.111	HUF 2.106.276	2	(28)	(26)	0,01
	08.2023	12	¥ 1.600	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	8.951	NZD 14.500	0	(70)	(70)	0,02
	09.2023	CHF 9.615	\$ 10.700	0	(134)	(134)	0,04
	09.2023	COP 1.109.099	261	1	0	1	0,00
	09.2023	CZK 26.554	1.200	0	(15)	(15)	0,01
	09.2023	HKD 4.038	517	1	0	1	0,00
	09.2023	IDR 47.568.000	3.200	40	0	40	0,01
	09.2023	ILS 3.629	1.022	41	0	41	0,01
	09.2023	INR 133.502	1.620	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	PHP 619.377	11.014	0	(164)	(164)	0,05
	09.2023	SEK 13.206	1.221	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	THB 177.650	5.109	61	0	61	0,02
	09.2023	\$ 1.377	AUD 2.000	0	(42)	(42)	0,01
	09.2023	1.187	BRL 5.998	43	0	43	0,01
	09.2023	1.700	CLP 1.386.180	12	0	12	0,00
	09.2023	30	HUF 10.325	0	0	0	0,00
	09.2023	1.075	IDR 16.138.617	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	1.000	ILS 3.549	0	(41)	(41)	0,01
	09.2023	7.123	INR 589.620	44	0	44	0,01

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2023	\$ 2.003	KRW 2.538.382	\$ 0	\$ (68)	\$ (68)	(0,02)
	09.2023	1.600	MXN 28.316	27	0	27	0,01
	09.2023	1.540	NOK 16.154	0	(28)	(28)	(0,01)
	09.2023	20.139	PEN 74.151	195	0	195	0,06
	09.2023	2	PHP 133	0	0	0	0,00
	09.2023	60	SGD 80	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	2.136	ZAR 40.075	0	(31)	(31)	(0,01)
MBC	07.2023	CZK 4.349	\$ 202	2	0	2	0,00
	07.2023	£ 736	911	0	(25)	(25)	(0,01)
	07.2023	¥ 3.784.000	28.974	2.720	0	2.720	0,90
	07.2023	PLN 12.381	2.899	0	(146)	(146)	(0,05)
	07.2023	\$ 5.961	¥ 850.000	0	(69)	(69)	(0,02)
	07.2023	53	PLN 219	1	0	1	0,00
	07.2023	140	SGD 188	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	€ 800	\$ 883	8	0	8	0,00
	08.2023	TWD 286.896	9.385	171	0	171	0,06
	08.2023	\$ 3.011	AUD 4.425	0	(62)	(62)	(0,02)
	08.2023	21.100	CAD 28.022	90	0	90	0,03
	09.2023	KRW 2.078.511	\$ 1.630	46	0	46	0,02
MYI	09.2023	\$ 109	HKD 854	0	0	0	0,00
	07.2023	CZK 7.881	\$ 358	1	(4)	(3)	0,00
	07.2023	IDR 3.527.922	236	1	0	1	0,00
	07.2023	INR 1.551.690	18.900	2	0	2	0,00
	07.2023	MYR 22.010	4.781	57	0	57	0,02
	07.2023	TRY 6.741	277	20	0	20	0,01
	07.2023	\$ 20	CZK 425	0	0	0	0,00
	07.2023	13	€ 12	0	0	0	0,00
	07.2023	539	£ 427	4	0	4	0,00
	07.2023	235	IDR 3.527.922	1	0	1	0,00
	07.2023	9.602	MYR 44.219	0	(111)	(111)	(0,04)
	07.2023	825	PLN 3.480	31	0	31	0,01
	07.2023	23	TRY 597	0	0	0	0,00
	08.2023	CAD 393	\$ 295	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	¥ 140.647	1.058	79	0	79	0,03
	08.2023	NOK 27.285	2.577	26	0	26	0,01
	08.2023	SEK 4.010	374	2	0	2	0,00
	08.2023	TWD 30.532	1.002	22	0	22	0,01
	08.2023	\$ 539	CAD 719	4	0	4	0,00
	08.2023	42	€ 39	0	0	0	0,00
	08.2023	926	¥ 128.000	0	(35)	(35)	(0,01)
	08.2023	196	SEK 2.105	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	BRL 4.919	\$ 1.000	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	ILS 29.483	8.218	251	0	251	0,08
	09.2023	KRW 4.418.771	3.453	85	0	85	0,03
	09.2023	THB 151.234	4.339	41	0	41	0,01
	09.2023	TRY 3.180	119	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 6.900	CAD 9.118	8	(9)	(1)	0,00
	09.2023	35	HKD 273	0	0	0	0,00
	09.2023	236	IDR 3.530.989	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	19.790	INR 1.628.172	2	(1)	1	0,00
	09.2023	1.800	MXN 31.471	8	0	8	0,00
RBC	09.2023	ZAR 40.005	\$ 2.149	48	0	48	0,02
	07.2023	\$ 33.700	MXN 648.426	4.043	0	4.043	1,34
	07.2023	148	SGD 200	0	0	0	0,00
	08.2023	CAD 28.835	\$ 21.364	0	(442)	(442)	(0,15)
	08.2023	£ 1.271	1.606	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	¥ 2.354.758	17.524	1.128	0	1.128	0,37
	08.2023	83	AUD 123	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	45	€ 41	0	0	0	0,00
	08.2023	224	£ 180	4	0	4	0,00
	08.2023	148	MXN 2.566	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	PLN 7.368	\$ 1.738	0	(74)	(74)	(0,02)
	08.2023	SEK 1.820	168	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 88	AUD 132	0	0	0	0,00
	08.2023	60	SEK 635	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2023	SGD 1.949	\$ 1.441	0	0	0	0,00
	07.2023	TRY 4.527	195	23	0	23	0,01
	07.2023	\$ 2.032	PLN 8.649	95	0	95	0,03
	08.2023	AUD 19.492	\$ 13.065	83	(8)	75	0,03
	08.2023	CNH 12.802	1.861	95	0	95	0,03
	08.2023	€ 1.839	2.013	2	0	2	0,00
	08.2023	£ 534	676	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	NZD 3.425	2.138	40	0	40	0,01
	08.2023	SEK 15.610	1.465	17	0	17	0,01
	08.2023	TWD 18.509	606	12	0	12	0,00
	08.2023	\$ 159	AUD 238	0	0	0	0,00
	08.2023	962	€ 890	11	0	11	0,00
	08.2023	3.858	£ 3.095	78	0	78	0,03
	08.2023	441	NOK 4.685	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	99	SEK 1.030	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	INR 85.880	\$ 1.043	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	THB 98.370	2.831	36	0	36	0,01
	09.2023	TWD 211.516	6.938	132	0	132	0,04
	09.2023	\$ 18.310	INR 1.505.832	0	(6)	(6)	0,00
SOG	07.2023	PLN 3.511	\$ 815	0	(48)	(48)	(0,02)
	07.2023	SGD 145	109	2	0	2	0,00
	07.2023	\$ 1.229	SGD 1.649	0	(10)	(10)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SSB	08.2023	\$ 77	SEK 840	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	3.046	BRL 15.298	126	0	126	0,04
	07.2023	115	CLP 92.793	0	0	0	0,00
	07.2023	15.353	COP 68.133.777	964	0	964	0,32
	08.2023	CLP 34.068.674	\$ 42.019	0	(303)	(303)	(0,10)
	09.2023	1.100.110	1.349	0	(10)	(10)	0,00
	09.2023	\$ 39.508	CLP 31.930.100	0	(48)	(48)	(0,02)
	10.2023	CLP 92.793	\$ 114	0	0	0	0,00
	07.2023	COP 69.311.116	16.709	121	(10)	111	0,04
	07.2023	\$ 16.501	COP 68.954.036	0	(98)	(98)	(0,03)
TOR	07.2023	50	CZK 1.077	0	0	0	0,00
	07.2023	935	£ 736	0	0	0	0,00
	07.2023	151	PLN 642	7	0	7	0,00
	08.2023	€ 336	\$ 367	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	£ 1.597	2.014	0	(17)	(17)	(0,01)
	08.2023	¥ 167.426	1.263	97	0	97	0,03
	08.2023	\$ 1.934	CLP 1.552.352	0	(8)	(8)	0,00
	08.2023	21	£ 17	0	0	0	0,00
	08.2023	62	SEK 670	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS 20.507	\$ 5.782	241	0	241	0,08
	09.2023	\$ 52	ILS 185	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	134	SGD 180	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CZK 1.724	\$ 78	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	¥ 431.000	3.288	304	0	304	0,10
	07.2023	TRY 29.091	1.278	170	0	170	0,06
	07.2023	\$ 17	CZK 362	0	0	0	0,00
	07.2023	1.406	TRY 32.420	0	(171)	(171)	(0,06)
	08.2023	CAD 419	\$ 319	2	0	2	0,00
	08.2023	€ 1.084	1.190	5	0	5	0,00
	08.2023	£ 429	542	0	(3)	(3)	0,00
08.2023	¥ 1.360.000	10.033	577	0	577	0,19	
08.2023	\$ 150	€ 140	3	0	3	0,00	
08.2023	501	£ 396	2	0	2	0,00	
08.2023	1.831	HUF 638.347	13	0	13	0,00	
08.2023	1	TWD 43	0	0	0	0,00	
08.2023	ZAR 67.072	\$ 3.478	1	(59)	(58)	(0,02)	
09.2023	ILS 3.682	1.028	33	0	33	0,01	
09.2023	\$ 2.889	RON 13.121	0	(8)	(8)	0,00	
				\$ 20.258	\$ (8.618)	\$ 11.640	3,8

## ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 204	\$ 221	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2023	\$ 16.469	€ 15.324	250	0	250	0,08
BPS	07.2023	€ 15.732	\$ 17.238	74	0	74	0,02
	07.2023	\$ 17.543	€ 16.307	249	(2)	247	0,08
CBK	08.2023	17.218	15.692	0	(73)	(73)	(0,02)
	07.2023	€ 16.073	\$ 17.476	1	(61)	(60)	(0,02)
	07.2023	\$ 664	€ 619	11	0	11	0,00
	08.2023	17.176	15.776	59	0	59	0,02
JPM	07.2023	€ 15.776	\$ 17.225	14	0	14	0,01
	08.2023	\$ 17.250	€ 15.776	0	(15)	(15)	0,00
MBC	07.2023	€ 322	\$ 346	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	\$ 458	€ 427	8	0	8	0,00
SOG	07.2023	16.778	15.597	238	0	238	0,08
				\$ 904	\$ (158)	\$ 746	0,25

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	£ 2.565	\$ 3.266	\$ 5	\$ (1)	\$ 4	0,00
	07.2023	\$ 1.064	£ 854	22	0	22	0,01
CBK	07.2023	£ 24	\$ 31	0	0	0	0,00
	07.2023	2.372	3.017	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	\$ 28.971	£ 23.403	783	0	783	0,26
	07.2023	£ 106	\$ 131	0	(3)	(3)	0,00
UAG	07.2023	\$ 29.076	£ 23.394	666	0	666	0,22
	07.2023	29.959	24.027	594	(5)	589	0,19
				\$ 2.071	\$ (9)	\$ 2.062	0,68
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						\$ 14.441	4,77

# Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
<b>Ginnie Mae, TBA</b>			
5,500 % fällig am 01.08.2053	\$ 17.200	\$ (17.113)	(5,66)
<b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b>			
4,500 % fällig am 01.07.2038	4.800	(4.707)	(1,55)
5,500 % fällig am 01.07.2053 (d)	2.850	(2.836)	(0,94)
5,500 % fällig am 01.08.2053	3.000	(2.985)	(0,99)
6,000 % fällig am 01.07.2053	160	(161)	(0,05)
6,000 % fällig am 01.08.2053	3.740	(3.773)	(1,25)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (31.575)</b>	<b>(10,44)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 253.207</b>	<b>83,74</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ 49.157</b>	<b>16,26</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 302.364</b>	<b>100,00</b>

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Mit dem Fonds verbunden.
- Zum 30. Juni 2023 leerverkaufter Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,21 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
DBS Bank Ltd.	4,467 %	22.11.2023	06.02.2023	\$ 4.805	\$ 4.660	1,54
Deutsche Bank AG	0,898	28.05.2024	31.03.2022 - 31.05.2023	2.408	2.376	0,79
MUFG Bank Ltd.	4,883	21.12.2023	06.02.2023 - 08.02.2023	1.037	999	0,33
				<b>\$ 8.250</b>	<b>\$ 8.035</b>	<b>2,66</b>

Barmittel in Höhe von 26.089 USD (31. Dezember 2022: 21.987 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.311 USD (31. Dezember 2022: 6.601 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

### Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 237.254	\$ 0	\$ 237.254
Investmentfonds	30.015	0	0	30.015
Pensionsgeschäfte	0	4.583	0	4.583
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2.979	9.951	0	12.930
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(31.575)	0	(31.575)
<b>Summen</b>	<b>\$ 32.994</b>	<b>\$ 220.213</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 253.207</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 335.879	\$ 0	\$ 335.879
Investmentfonds	10.879	30.814	0	41.693
Pensionsgeschäfte	0	27.452	0	27.452
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	467	(2.020)	0	(1.553)
Einlagen bei Kreditinstituten	0	600	0	600
<b>Summen</b>	<b>\$ 11.346</b>	<b>\$ 392.725</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 404.071</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (269)	\$ 270	\$ 1	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	1.730	(2.120)	(390)	(475)	490	15
BPS	(740)	920	180	(159)	380	221
BRC	1.112	(1.110)	2	(2.750)	2.340	(410)
CBK	1.206	(940)	266	1.779	(2.180)	(401)
CKL	k. A.	k. A.	k. A.	22	0	22
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	157	0	157
DUB	224	(300)	(76)	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(20)	0	(20)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	413	(420)	(7)	(251)	330	79
GST	(81)	261	180	(299)	261	(38)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	267	(260)	7
IND	(2.068)	1.860	(208)	(8)	0	(8)
JPM	278	(290)	(12)	153	(390)	(237)
MBC	3.521	(3.370)	151	931	(880)	51
MEI	(232)	0	(232)	(165)	450	285
MYC	211	(280)	(69)	204	0	204
MYI	1.185	(890)	295	(99)	120	21
RBC	4.722	(4.670)	52	(69)	50	(19)
RYL	(75)	0	(75)	(21)	0	(21)
SCX	627	(690)	(63)	1.408	(1.310)	98
SOG	182	(280)	(98)	1	0	1
SSB	729	(740)	(11)	38	0	38
TOR	329	(280)	49	(1.737)	1.620	(117)
UAG	1.457	(1.260)	197	(761)	560	(201)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	45,34	28,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	33,13	48,50
Investmentfonds	9,93	9,56
Pensionsgeschäfte	1,52	6,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	1,19	0,13
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,70)	(0,06)
Freiverkehrsinanzderivate	4,77	(0,42)
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,44)	k. A.
Einlagenzertifikate	k. A.	0,14

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	55,27	39,15
Kommunalanleihen und Wechsel	k. A.	0,23
US-Regierungsbehörden	2,36	1,39
Non-Agency-MBS	0,62	0,45
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,21	1,06
Staatsemissionen	3,08	0,53
Kurzfristige Instrumente	12,93	34,23
Investmentfonds	9,93	9,56
Pensionsgeschäfte	1,52	6,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	1,19	0,13
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,11	0,09
Zinsswaps	(1,81)	(0,15)
Freiverkehrsinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswaps	0,07	0,04
Total Return Swaps auf Indizes	(0,08)	(0,04)
Devisenterminkontrakte	3,85	(1,20)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,93	0,78
Einlagenzertifikate	k. A.	0,14
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,44)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	16,26	7,31
Nettovermögen	100,00	100,00



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PAR (000S)	% DES		
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	
<b>SCHWEIZ</b>												
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>												
Credit Suisse AG				GlaxoSmithKline Capital PLC	£ 2.100	£ 1.418	0,42	NatWest Group PLC	£ 1.800	£ 1.467	0,44	
7,750 % fällig am 10.03.2026	1.400	1.418	0,42	1,625 % fällig am 12.05.2035				2,057 % fällig am 09.11.2028				
UBS AG				Grainger PLC	1.385	1.050	0,31	2,875 % fällig am 19.09.2026	500	454	0,14	
5,125 % fällig am 15.05.2024 (f)	500	387	0,12	3,000 % fällig am 03.07.2030				3,125 % fällig am 28.03.2027	500	448	0,13	
UBS Group AG				Greene King Finance PLC	361	291	0,09	3,619 % fällig am 29.03.2029	900	774	0,23	
0,250 % fällig am 29.01.2026	300	238	0,07	3,593 % fällig am 15.03.2035				5,125 % fällig am 12.05.2027 (d)(f)	1.100	909	0,27	
0,625 % fällig am 18.01.2033	100	60	0,02	4,064 % fällig am 15.03.2035	202	166	0,05	7,416 % fällig am 06.06.2033	600	582	0,17	
4,125 % fällig am 24.09.2025	950	714	0,21	5,106 % fällig am 15.03.2034	533	470	0,14	NatWest Markets PLC				
4,550 % fällig am 17.04.2026	300	227	0,07	5,318 % fällig am 15.09.2031	1.367	1.231	0,37	6,375 % fällig am 08.11.2027	1.300	1.278	0,38	
7,375 % fällig am 07.09.2033	1.500	1.572	0,47	Haleon UK Capital PLC	1.450	1.246	0,37	Network Rail Infrastructure Finance PLC	1.800	1.786	0,53	
Summe Schweiz		4.616	1,38	3,375 % fällig am 29.03.2038	1.100	834	0,25	4,750 % fällig am 29.11.2035				
<b>GROSSBRITANNIEN</b>												
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>												
3i Group PLC				HSBC Holdings PLC	1.000	853	0,25	NIE Finance PLC	1.100	1.088	0,32	
3,750 % fällig am 05.06.2040	850	607	0,18	1,750 % fällig am 24.07.2027				5,875 % fällig am 01.12.2032				
Anchor Hanover Group				1,750 % fällig am 22.07.2028	1.700	1.460	0,44	Northern Gas Networks Finance PLC				
2,000 % fällig am 21.07.2051	400	210	0,06	3,000 % fällig am 29.05.2030	1.700	1.381	0,41	4,875 % fällig am 15.11.2035	250	221	0,07	
Anglian Water Services Financing PLC				5,875 % fällig am 28.09.2026 (d)(f)	900	787	0,24	5,625 % fällig am 23.03.2040	50	47	0,01	
2,750 % fällig am 26.10.2029	800	666	0,20	6,000 % fällig am 29.03.2040	978	859	0,26	Northern Powergrid Yorkshire PLC	300	270	0,08	
5,875 % fällig am 20.06.2031	1.000	990	0,30	Hyde Housing Association Ltd.	1.000	952	0,28	4,375 % fällig am 05.07.2032	200	188	0,06	
Annington Funding PLC				5,125 % fällig am 21.07.2040				5,125 % fällig am 04.05.2035				
2,308 % fällig am 06.10.2032	2.000	1.393	0,42	InterContinental Hotels Group PLC	1.000	865	0,26	Northumbrian Water Finance PLC	1.000	896	0,27	
3,184 % fällig am 17.01.2033	200	160	0,05	2,125 % fällig am 24.08.2026	400	340	0,10	4,500 % fällig am 14.02.2031	883	846	0,25	
3,935 % fällig am 12.07.2047	900	619	0,18	3,375 % fällig am 08.10.2028				5,625 % fällig am 29.04.2033				
Assura Financing PLC				John Lewis PLC	1.344	838	0,25	Notting Hill Genesis	700	458	0,14	
1,625 % fällig am 30.06.2033	1.000	656	0,20	4,250 % fällig am 18.12.2034	600	578	0,17	2,000 % fällig am 03.06.2036	1.000	667	0,20	
Aviva PLC				6,125 % fällig am 21.01.2025				3,250 % fällig am 12.10.2048	300	256	0,08	
5,125 % fällig am 04.06.2050	200	174	0,05	Karbon Homes Ltd.	400	293	0,09	3,750 % fällig am 20.12.2032				
6,875 % fällig am 20.05.2058	900	995	0,30	3,375 % fällig am 15.11.2047				Pacific Quay Finance PLC	154	149	0,04	
Barclays PLC				Land Securities Capital Markets PLC	1.251	1.043	0,31	5,565 % fällig am 25.07.2034				
1,700 % fällig am 03.11.2026	800	703	0,21	2,399 % fällig am 08.02.2031	500	474	0,14	Paragon Treasury PLC	500	324	0,10	
3,250 % fällig am 12.02.2027	200	175	0,05	4,875 % fällig am 15.09.2034	1.400	1.354	0,40	2,000 % fällig am 07.05.2036	900	606	0,18	
3,250 % fällig am 17.01.2033	1.700	1.275	0,38	LCR Finance PLC	1.400	1.354	0,40	Peabody Capital PLC	900	606	0,18	
6,369 % fällig am 31.01.2031	1.800	1.725	0,52	4,500 % fällig am 07.12.2038				3,250 % fällig am 14.09.2048				
8,407 % fällig am 14.11.2032	600	596	0,18	Legal & General Group PLC	1.200	1.139	0,34	Places for People Homes Ltd.	900	786	0,23	
Berkeley Group PLC				5,375 % fällig am 27.10.2045	850	657	0,20	3,625 % fällig am 22.11.2028	568	559	0,17	
2,500 % fällig am 11.08.2031	1.200	785	0,23	5,625 % fällig am 24.03.2031 (d)(f)				5,875 % fällig am 23.05.2031				
Beyond Housing Ltd.				Lloyds Banking Group PLC	2.600	2.160	0,65	Places for People Treasury PLC	800	548	0,16	
2,125 % fällig am 17.05.2051	500	273	0,08	2,000 % fällig am 12.04.2028	300	282	0,08	2,500 % fällig am 26.01.2036				
BG Energy Capital PLC				8,500 % fällig am 27.09.2027 (d)(f)	1.250	772	0,23	Platform HG Financing PLC	1.100	674	0,20	
5,000 % fällig am 04.11.2036	300	278	0,08	London & Quadrant Housing Trust	1.250	772	0,23	1,926 % fällig am 15.09.2041				
Blend Funding PLC				2,000 % fällig am 20.10.2038				Prudential Funding Asia PLC	580	561	0,17	
3,459 % fällig am 21.09.2049	800	586	0,18	M&G PLC	400	354	0,11	6,125 % fällig am 19.12.2031				
BP Capital Markets PLC				5,625 % fällig am 20.10.2051				Quadgas Finance PLC	800	636	0,19	
5,773 % fällig am 25.05.2038	1.200	1.184	0,35	Manchester Airport Group Funding PLC	235	161	0,05	3,375 % fällig am 17.09.2029				
BPHA Finance PLC				2,875 % fällig am 31.03.2039	900	572	0,17	RHP Finance PLC	350	251	0,07	
4,816 % fällig am 11.04.2044	300	271	0,08	2,875 % fällig am 30.09.2044	500	454	0,14	3,250 % fällig am 05.02.2048				
British Land Co. PLC				4,750 % fällig am 31.03.2034				Riverside Finance PLC	900	708	0,21	
2,375 % fällig am 14.09.2029	2.100	1.604	0,48	Marks & Spencer PLC	100	90	0,03	3,875 % fällig am 05.12.2044				
British Telecommunications PLC				3,750 % fällig am 19.05.2026				Sage Group PLC	800	588	0,18	
3,125 % fällig am 21.11.2031	800	645	0,19	Metropolitan Housing Trust Ltd.	1.800	1.160	0,35	1,625 % fällig am 25.02.2031	1.500	1.131	0,34	
3,625 % fällig am 21.11.2047	400	273	0,08	1,875 % fällig am 28.07.2036				2,875 % fällig am 08.02.2034				
5,750 % fällig am 13.02.2041	600	555	0,17	Mitchells & Butlers Finance PLC	40	39	0,01	Santander UK Group Holdings PLC	1.400	1.139	0,34	
Cadent Finance PLC				5,965 % fällig am 15.12.2025	\$ 1.165	844	0,25	2,421 % fällig am 17.01.2029	600	549	0,16	
2,625 % fällig am 22.09.2038	950	613	0,18	6,002 % fällig am 15.12.2030	£ 418	376	0,11	3,625 % fällig am 14.01.2026	500	491	0,15	
2,750 % fällig am 22.09.2046	700	407	0,12	6,013 % fällig am 15.12.2030				7,098 % fällig am 16.11.2027				
5,750 % fällig am 14.03.2034	500	481	0,14	Morhoms PLC	1.100	834	0,25	Scotland Gas Networks PLC	300	267	0,08	
Chanel Ceres PLC				3,400 % fällig am 19.02.2040				4,875 % fällig am 21.12.2034				
0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 600	459	0,14	Motability Operations Group PLC	1.900	1.187	0,35	Scottish Hydro Electric Transmission PLC	1.050	703	0,21	
Clarion Funding PLC				2,125 % fällig am 18.01.2042	1.250	1.040	0,31	2,125 % fällig am 24.03.2036	2.350	1.626	0,49	
1,875 % fällig am 22.01.2035	€ 1.000	673	0,20	3,625 % fällig am 10.03.2036	700	654	0,20	2,250 % fällig am 27.09.2035				
1,875 % fällig am 07.09.2051	1.400	662	0,20	4,875 % fällig am 17.01.2043	100	101	0,03	Segro PLC	300	294	0,09	
3,125 % fällig am 19.04.2048	300	198	0,06	5,625 % fällig am 29.11.2030				5,750 % fällig am 20.06.2035				
Compass Group PLC				National Gas Transmission PLC	800	569	0,17	Severn Trent Utilities Finance PLC	1.000	350	0,10	
4,375 % fällig am 08.09.2032	1.100	1.011	0,30	1,375 % fällig am 07.02.2031				2,000 % fällig am 02.06.2040	600	757	0,23	
Derwent London PLC				National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC	400	293	0,09	2,625 % fällig am 22.02.2033	1.000	757	0,23	
1,875 % fällig am 17.11.2031	1.900	1.317	0,39	1,750 % fällig am 09.09.2031				4,625 % fällig am 30.11.2034	400	356	0,11	
Diageo Finance PLC				National Grid Electricity Distribution South Wales PLC	850	828	0,25	4,875 % fällig am 24.01.2042	800	701	0,21	
2,750 % fällig am 08.06.2038	600	438	0,13	5,750 % fällig am 23.03.2040	1.600	1.564	0,47	5,250 % fällig am 04.04.2036	300	280	0,08	
EMH Treasury PLC				National Grid Electricity Distribution West Midlands PLC	1.400	1.098	0,33	Sky Ltd.	500	454	0,14	
4,500 % fällig am 29.01.2044	300	260	0,08	1,125 % fällig am 07.07.2028	900	656	0,20	4,000 % fällig am 26.11.2029				
ENW Finance PLC				2,750 % fällig am 06.02.2035	1.100	1.009	0,30	Society of Lloyd's	500	451	0,13	
1,415 % fällig am 30.07.2030	400	296	0,09	5,272 % fällig am 18.01.2043				4,875 % fällig am 07.02.2047				
4,893 % fällig am 24.11.2032	1.700	1.567	0,47	Nationwide Building Society	1.200	1.163	0,35	South Eastern Power Networks PLC	3.800	2.563	0,77	
				6,178 % fällig am 07.12.2027				1,750 % fällig am 30.09.2034				
								Southern Electric Power Distribution PLC	800	785	0,23	
								5,500 % fällig am 07.06.2032				
								Southern Gas Networks PLC	1.600	1.154	0,34	
								3,100 % fällig am 15.09.2036				



# Aufstellung des Wertpapierbestands des UK Corporate Bond Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Southern Housing 2,375 % fällig am 08.10.2036	£ 1.900	£ 1.304	0,39	Harbour 5,457 % fällig am 28.01.2054	£ 300	£ 296	0,09	Digital Stout Holding LLC 3,300 % fällig am 19.07.2029	£ 816	£ 660	0,20
Sovereign Housing Capital PLC 2,375 % fällig am 04.11.2048	1.000	583	0,17	Hops Hill PLC 5,854 % fällig am 27.05.2054	630	630	0,19	3,750 % fällig am 17.10.2030	1.350	1.103	0,33
Telereal Securitisation PLC 4,974 % fällig am 10.12.2033	141	136	0,04	Laarak Master Issuer PLC 5,319 % fällig am 22.12.2069	200	200	0,06	Eli Lilly & Co. 1,625 % fällig am 14.09.2043	800	455	0,14
Tesco Corporate Treasury Services PLC 1,875 % fällig am 02.11.2028	1.000	800	0,24	London Wall Mortgage Capital PLC 5,452 % fällig am 15.05.2051	335	333	0,10	Fiserv, Inc. 3,000 % fällig am 01.07.2031	791	634	0,19
5,500 % fällig am 27.02.2035	300	277	0,08	Ludgate Funding PLC 5,030 % fällig am 01.01.2061	1.618	1.549	0,46	Ford Motor Co. 3,250 % fällig am 12.02.2032	\$ 150	93	0,03
Tesco Property Finance PLC 5,661 % fällig am 13.10.2041	276	253	0,08	Mansard Mortgages PLC 5,651 % fällig am 15.12.2049	78	77	0,02	Ford Motor Credit Co. LLC 7,200 % fällig am 10.06.2030	1.000	795	0,24
5,744 % fällig am 13.04.2040	1.335	1.239	0,37	Mortimer BTL PLC 5,614 % fällig am 23.06.2053	1.548	1.531	0,46	General Motors Financial Co., Inc. 5,150 % fällig am 15.08.2026	£ 500	474	0,14
5,801 % fällig am 13.10.2040	277	259	0,08	Newgate Funding PLC 4,126 % fällig am 15.12.2050	€ 790	654	0,20	Goldman Sachs Group, Inc. 1,875 % fällig am 16.12.2030	3.200	2.376	0,71
6,052 % fällig am 13.10.2039	113	108	0,03	Pierpoint BTL PLC 0,000 % fällig am 21.09.2054	£ 1.000	998	0,30	3,625 % fällig am 29.10.2029	2.350	2.030	0,61
Thames Water Utilities Finance PLC 2,375 % fällig am 22.04.2040	800	459	0,14	Polaris PLC 5,631 % fällig am 23.12.2058	935	930	0,28	International Business Machines Corp. 4,875 % fällig am 06.02.2038	400	357	0,11
2,625 % fällig am 24.01.2032	1.300	959	0,29	5,614 % fällig am 23.03.2054	872	872	0,26	JPMorgan Chase & Co. 1,895 % fällig am 28.04.2033	1.500	1.089	0,33
3,500 % fällig am 25.02.2028	1.300	1.108	0,33	Residential Mortgage Securities PLC 6,159 % fällig am 20.06.2070	1.069	1.072	0,32	MassMutual Global Funding 1,375 % fällig am 15.12.2026	1.500	1.270	0,38
4,375 % fällig am 18.01.2031	€ 600	459	0,14	Stratton Mortgage Funding PLC 5,391 % fällig am 20.07.2060	1.237	1.237	0,37	McDonald's Corp. 2,950 % fällig am 15.03.2034	500	393	0,12
Together Housing Finance PLC 4,500 % fällig am 17.12.2042	£ 400	341	0,10	5,765 % fällig am 12.03.2052	63	63	0,02	3,750 % fällig am 31.05.2038	500	400	0,12
TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028	1.650	1.220	0,36	5,792 % fällig am 25.09.2051	68	68	0,02	Metropolitan Life Global Funding 0,625 % fällig am 08.12.2027	400	314	0,09
Travis Perkins PLC 3,750 % fällig am 17.02.2026	300	270	0,08	Towd Point Mortgage Funding PLC 5,635 % fällig am 20.10.2051	1.287	1.289	0,38	1,625 % fällig am 21.09.2029	400	308	0,09
Unique Pub Finance Co. PLC 5,659 % fällig am 30.06.2027	908	890	0,27	5,841 % fällig am 20.07.2045	235	235	0,07	3,500 % fällig am 30.09.2026	740	677	0,20
7,395 % fällig am 28.03.2024	179	180	0,05	Twin Bridges PLC 5,715 % fällig am 12.03.2055	1.264	1.259	0,38	5,000 % fällig am 10.01.2030	900	854	0,25
UNITE Group PLC 3,500 % fällig am 15.10.2028	1.000	844	0,25	Summe Großbritannien		20.302	6,07	Morgan Stanley 5,789 % fällig am 18.11.2033	900	864	0,26
Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	400	316	0,09	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Nestle Holdings, Inc. 2,500 % fällig am 04.04.2032	1.500	1.221	0,36
Virgin Money UK PLC 3,375 % fällig am 24.04.2026	250	228	0,07	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 30.01.2026	14.100	12.433	3,71	New York Life Global Funding 1,250 % fällig am 17.12.2026	500	422	0,13
4,000 % fällig am 25.09.2026	1.600	1.447	0,43	1,250 % fällig am 31.07.2051	3.400	1.687	0,50	4,350 % fällig am 16.09.2025	1.600	1.528	0,46
Vodafone Group PLC 3,375 % fällig am 08.08.2049	1.900	1.208	0,36	1,500 % fällig am 31.07.2053	12.600	6.580	1,96	Pfizer, Inc. 2,735 % fällig am 15.06.2043	1.000	683	0,20
Weir Group PLC 6,875 % fällig am 14.06.2028	1.800	1.776	0,53	1,625 % fällig am 22.10.2028 (g)	17.700	15.200	4,54	Realty Income Corp. 1,750 % fällig am 13.07.2033	1.100	736	0,22
Wellcome Trust Ltd. 1,500 % fällig am 14.07.2071	1.300	515	0,15	3,500 % fällig am 22.10.2025 (g)	14.900	14.227	4,25	Time Warner Cable LLC 5,250 % fällig am 15.07.2042	1.100	872	0,26
Workspace Group PLC 2,250 % fällig am 11.03.2028	1.000	733	0,22	3,750 % fällig am 22.10.2053	3.300	2.935	0,88	Verizon Communications, Inc. 1,875 % fällig am 19.09.2030	500	382	0,11
Yorkshire Building Society 1,500 % fällig am 15.09.2029	800	603	0,18	4,250 % fällig am 07.03.2036	10.500	10.308	3,08	1,875 % fällig am 03.11.2038	700	416	0,12
Yorkshire Water Finance PLC 1,750 % fällig am 27.10.2032	949	662	0,20	4,250 % fällig am 07.12.2049	300	290	0,09	2,500 % fällig am 08.04.2031	1.400	1.106	0,33
2,750 % fällig am 18.04.2041	700	449	0,13	Summe Großbritannien		65.266	19,49	3,125 % fällig am 02.11.2035	200	150	0,04
3,625 % fällig am 01.08.2029	500	435	0,13	<b>USA</b>				3,375 % fällig am 27.10.2036	1.200	914	0,27
5,250 % fällig am 28.04.2030	900	849	0,25	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,750 % fällig am 17.02.2034	550	498	0,15
5,500 % fällig am 28.04.2035	500	469	0,14	AES Corp. 2,450 % fällig am 15.01.2031	\$ 900	573	0,17	Walmart, Inc. 5,625 % fällig am 27.03.2034	300	310	0,09
		119.074	35,56	Amgen, Inc. 4,000 % fällig am 13.09.2029	£ 740	667	0,20	Wells Fargo & Co. 2,125 % fällig am 24.09.2031	1.800	1.333	0,40
				5,250 % fällig am 02.03.2033	\$ 200	158	0,05	2,500 % fällig am 02.05.2029	2.050	1.641	0,49
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Apple, Inc. 3,050 % fällig am 31.07.2029	£ 500	442	0,13	3,500 % fällig am 12.09.2029	700	589	0,18
Alba PLC 5,171 % fällig am 15.12.2038	827	791	0,24	3,600 % fällig am 31.07.2042	600	499	0,15	Welltower OP LLC 4,800 % fällig am 20.11.2028	500	451	0,13
Atlas Funding PLC 5,432 % fällig am 25.07.2058	934	933	0,28	AT&T, Inc. 4,250 % fällig am 01.06.2043	1.800	1.378	0,41			40.548	12,11
5,937 % fällig am 20.01.2061	594	595	0,18	4,375 % fällig am 14.09.2029	1.000	902	0,27	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Avon Finance PLC 5,809 % fällig am 20.09.2048	1.437	1.437	0,43	4,875 % fällig am 01.06.2044	500	415	0,12	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 5,650 % fällig am 25.04.2035	\$ 90	63	0,02
Barley Hill PLC 5,824 % fällig am 27.08.2058	710	706	0,21	Bank of America Corp. 3,584 % fällig am 27.04.2031	2.800	2.373	0,71	Sequoia Mortgage Trust 3,565 % fällig am 20.07.2037 ^	5	3	0,00
Brants Bridge PLC 6,115 % fällig am 12.12.2064	250	251	0,07	Berkshire Hathaway Finance Corp. 2,375 % fällig am 19.06.2039	1.600	1.088	0,32	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 5,282 % fällig am 25.02.2034	1	1	0,00
Canada Square Funding PLC 5,852 % fällig am 17.06.2058	63	63	0,02	Citigroup, Inc. 1,750 % fällig am 23.10.2026	1.000	862	0,26	WalMart Mortgage Pass-Through Certificates Trust 5,176 % fällig am 25.11.2042	10	7	0,00
Eurohome UK Mortgages PLC 5,137 % fällig am 15.06.2044	77	74	0,02	2,750 % fällig am 24.01.2024	650	638	0,19			74	0,02
EuroMASTR PLC 5,205 % fällig am 15.06.2040	525	484	0,14	5,150 % fällig am 21.05.2026	1.060	1.026	0,31	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Gosforth Funding PLC 5,465 % fällig am 25.08.2060	177	177	0,05	Comcast Corp. 1,500 % fällig am 20.02.2029	400	319	0,10	Fannie Mae 4,560 % fällig am 01.08.2036	4	3	0,00
Great Hall Mortgages PLC 5,152 % fällig am 18.03.2039	334	331	0,10	1,875 % fällig am 20.02.2036	1.200	804	0,24	4,944 % fällig am 01.07.2044	4	3	0,00
5,172 % fällig am 18.06.2038	6	6	0,00	Credit Suisse AG AT1 Claim ^	\$ 200	6	0,00				

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>INVESTMENT FONDS</b>			
4,500 % fällig am 01.07.2053	\$ 1.180	£ 892	0,27	<b>U.K. TREASURY BILLS</b>				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
5,000 % fällig am 01.07.2053	1.180	909	0,27	4,480 % fällig am 03.07.2023	£ 5.400	£ 5.400	1,61	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro			
5,500 % fällig am 01.08.2053	1.180	924	0,28	(b)(c)				Short Maturity UCITS	2.500	£ 208	0,06
6,000 % fällig am 01.08.2053	1.180	936	0,28	4,510 % fällig am 03.07.2023	2.900	2.900	0,87	ETF (e)			
6,500 % fällig am 01.07.2053	1.180	948	0,28	(b)(c)				Summe Investmentfonds		£ 208	0,06
		4.615	1,38	4,700 % fällig am 17.07.2023	5.400	5.390	1,61				
				(b)(c)							
Summe USA		45.237	13,51	Summe kurzfristige Instrumente		13.690	4,09				
				Summe Übertragbare Wertpapiere		£ 345.995	103,33				

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BRC	4,940 %	30.06.2023	03.07.2023	£ 13.000	United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 31.07.2035	£ (13.263)	£ 13.000	£ 13.005	3,88
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	\$ 130	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(104)	102	102	0,03
Summe Pensionsgeschäfte						£ (13.367)	£ 13.102	£ 13.107	3,91

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	21	£ 27	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	30	33	0,01
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	26	(20)	(0,01)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	5	(14)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	35	(23)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	123	(183)	(0,05)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	2	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	33	(51)	(0,02)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	194	88	0,03
				£ (142)	(0,04)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				£ (142)	(0,04)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Marks & Spencer PLC	1,000 %	20.06.2030	€ 500	£ 3	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	21.09.2024	£ 44.600	£ (904)	(0,27)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,728	16.12.2025	20.400	(737)	(0,22)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053	5.300	228	0,07
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	4.000	92	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	800	6	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	6.800	(210)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.12.2026	\$ 3.100	(307)	(0,09)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	9.200	1.262	0,38
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	9.300	856	0,25
Zahlung <sup>(3)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	12.02.2045	2.100	(409)	(0,12)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.09.2023	9.200	78	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.09.2023	9.300	74	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.08.2023	2.100	(7)	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des UK Corporate Bond Fund (Fort.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547 %	09.03.2033	€ 1.600	£ (26)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	400	(1)	0,00
Zahlung <sup>(2)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	1.900	18	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	5.400	(4)	0,00
					£ 9	0,01
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>£ 12</b>	<b>0,01</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### DEVISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	08.2023	€ 759	£ 655	£ 3	£ (1)	£ 2	0,00
	08.2023	£ 528	€ 606	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	\$ 336	£ 268	4	0	4	0,00
CBK	08.2023	1.059	832	0	(1)	(1)	0,00
DUB	08.2023	£ 700	\$ 870	0	(16)	(16)	(0,01)
JPM	08.2023	€ 6.241	£ 5.437	72	0	72	0,02
	08.2023	£ 1.695	€ 1.964	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	\$ 3.744	£ 2.956	12	0	12	0,00
MBC	08.2023	£ 1.304	€ 1.505	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	461	\$ 587	1	0	1	0,00
	08.2023	¥ 12.500	£ 74	6	0	6	0,00
MYI	08.2023	£ 366	\$ 458	0	(6)	(6)	0,00
RBC	08.2023	€ 63	£ 55	0	0	0	0,00
	08.2023	£ 1.245	€ 1.427	0	(18)	(18)	(0,01)
	08.2023	1.105	\$ 1.374	0	(23)	(23)	(0,01)
	08.2023	\$ 722	£ 571	4	0	4	0,00
SCX	08.2023	€ 9.873	8.621	131	0	131	0,04
	08.2023	£ 884	€ 1.028	0	0	0	0,00
	08.2023	1.028	\$ 1.291	0	(13)	(13)	0,00
	08.2023	\$ 1.212	£ 946	0	(7)	(7)	0,00
UAG	08.2023	4.198	3.322	20	0	20	0,01
				£ 253	£ (108)	£ 145	0,04
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						£ 145	0,04
<b>Summe Anlagen</b>						£ 359.320	107,31
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						£ (24.485)	(7,31)
<b>Nettovermögen</b>						£ 334.835	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 24.771 GBP (31. Dezember 2022: null GBP) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.217 GBP (31. Dezember 2022: 7.199 GBP) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

#### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 345.995	£ 0	£ 345.995
Investmentfonds	208	0	0	208
Pensionsgeschäfte	0	13.102	0	13.102
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	114	(99)	0	15
<b>Summen</b>	<b>£ 322</b>	<b>£ 358.998</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 359.320</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 372.745	£ 0	£ 372.745
Investmentfonds	0	5.370	0	5.370
Pensionsgeschäfte	0	177	0	177
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	637	1.806	0	2.443
<b>Summen</b>	<b>£ 637</b>	<b>£ 380.098</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 380.735</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
SCX	4,340 %	16.05.2023	08.08.2023	£ (15.930)	£ (16.017)	(4,78)
	4,650	16.05.2023	08.08.2023	(8.984)	(9.037)	(2,70)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>£ (25.054)</b>	<b>(7,48)</b>

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	£ k. A.	£ k. A.	£ k. A.	£ 260	£ (330)	£ (70)
BRC	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	(16)	0	(16)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(87)	0	(87)
JPM	78	0	78	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	(3)	0	(3)	(9)	0	(9)
MYI	(6)	0	(6)	(8)	0	(8)
RBC	(37)	0	(37)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	111	0	111	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	(213)	0	(213)
UAG	20	0	20	k. A.	k. A.	k. A.

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	99,95	94,43
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	3,38	1,35
Investmentfonds	0,06	1,38
Pensionsgeschäfte	3,91	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,04)	0,16
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	0,48
Freiverkehrsfinanzderivate	0,04	(0,02)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(7,48)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,12	k. A.
Österreich	k. A.	0,05
Belgien	0,08	0,07
Kanada	1,21	0,20
Cayman-Inseln	0,13	0,12
Tschechische Republik	0,02	k. A.
Dänemark	0,90	0,82
Frankreich	4,28	3,51
Deutschland	1,31	2,21
Irland	1,51	1,24
Italien	0,24	0,57
Japan	k. A.	0,31
Jersey, Kanalinseln	1,65	1,71
Luxemburg	0,68	1,18
Niederlande	5,53	5,67
Norwegen	0,53	0,42
Singapur	0,22	0,20
Spanien	0,68	1,11
Supranational	3,49	3,11
Schweden	0,65	0,44
Schweiz	1,38	0,89
Großbritannien	61,12	59,89
USA	13,51	11,68
Kurzfristige Instrumente	4,09	0,38
Investmentfonds	0,06	1,38
Pensionsgeschäfte	3,91	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,04)	0,16
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,10
Zinsswaps	0,01	0,39
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,03)
Devisenterminkontrakte	0,04	0,01
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,31)	2,17
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG SUPRANATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>AUSTRALIEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>JERSEY, KANALINSELN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>SCHWEDEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
BHP Billiton Finance Ltd. 4,300 % fällig am 25.09.2042	£ 500	£ 420	0,14	Intesa Sanpaolo SpA 7,778 % fällig am 20.06.2054	\$ 1.000	£ 784	0,26	Europäische Investitionsbank 3,875 % fällig am 08.06.2037	£ 1.200	£ 1.104	0,37
<b>CAYMAN INSELN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Italien		2.692	0,90	<b>GROSSBRITANNIEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Southern Water Services Finance Ltd. 3,000 % fällig am 28.05.2037 4,500 % fällig am 31.03.2052	1.700 700	1.153 573	0,39 0,19	AA Bond Co. Ltd. 3,250 % fällig am 31.07.2050 5,500 % fällig am 31.07.2050	£ 200 180	152 157	0,05 0,05	3i Group PLC 3,750 % fällig am 05.06.2040	1.400	999	0,34
Summe Cayman Inseln		1.726	0,58	CPUK Finance Ltd. 6,136 % fällig am 28.02.2047	700	662	0,22	Accent Capital PLC 2,625 % fällig am 18.07.2049	400	248	0,08
<b>DÄNEMARK</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Gatwick Funding Ltd. 2,625 % fällig am 07.10.2048 2,875 % fällig am 05.07.2051 3,125 % fällig am 28.09.2041 3,250 % fällig am 31.10.2046 5,750 % fällig am 23.01.2039	1.400 1.800 1.000 900 129	802 1.051 677 573 121	0,27 0,35 0,23 0,19 0,04	Anglian Water Services Financing PLC 6,000 % fällig am 20.06.2039	400	400	0,13
Orsted A/S 2,500 % fällig am 16.05.2033 5,125 % fällig am 13.09.2034 5,375 % fällig am 13.09.2042	850 1.200 2.100	638 1.121 1.973	0,21 0,38 0,66	Heathrow Funding Ltd. 2,750 % fällig am 09.08.2051 4,625 % fällig am 31.10.2046 5,875 % fällig am 13.05.2043	2.000 2.377 300	1.167 1.932 290	0,39 0,65 0,10	Annington Funding PLC 2,308 % fällig am 06.10.2032 2,924 % fällig am 06.10.2051 3,685 % fällig am 12.07.2034	1.600 2.500 1.319	1.114 1.364 994	0,37 0,46 0,33
Summe Dänemark		3.732	1,25	HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig am 05.11.2031 (a)	2.321	2.333	0,79	Aviva PLC 4,000 % fällig am 03.06.2055	1.600	1.199	0,40
<b>FRANKREICH</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Jersey, Kanalinseln		9.917	3,33	Barclays PLC 3,250 % fällig am 17.01.2033 8,875 % fällig am 15.09.2027 (a)(b) 9,250 % fällig am 15.09.2028 (a)(b)	1.530 500 900	1.147 461 815	0,39 0,15 0,27
AXA S.A. 5,453 % fällig am 04.03.2026 (a)	600	584	0,19	<b>LUXEMBURG</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Berkeley Group PLC 2,500 % fällig am 11.08.2031	800	523	0,18
BNP Paribas S.A. 2,000 % fällig am 13.09.2036 4,625 % fällig am 12.01.2027 (a)(b) 5,750 % fällig am 13.06.2032	1.600 \$ 400 £ 400	1.004 249 380	0,34 0,08 0,13	Aroundtown S.A. 3,000 % fällig am 16.10.2029	300	190	0,06	BG Energy Capital PLC 5,000 % fällig am 04.11.2036	300	278	0,09
Electricite de France S.A. 5,125 % fällig am 22.09.2050 5,500 % fällig am 27.03.2037 5,500 % fällig am 17.10.2041 5,625 % fällig am 25.01.2053	4.800 3.600 4.800 1.900	3.851 3.157 4.137 1.628	1,29 1,06 1,39 0,55	Becton Dickinson Euro Finance SARL 1,336 % fällig am 13.08.2041	€ 900	494	0,17	Blend Funding PLC 3,459 % fällig am 21.09.2049	300	220	0,07
Engie S.A. 5,000 % fällig am 01.10.2060	700	617	0,21	Prologis International Funding S.A. 3,000 % fällig am 22.02.2042	£ 1.000	669	0,23	BP Capital Markets PLC 5,773 % fällig am 25.05.2038	100	99	0,03
Orange S.A. 5,625 % fällig am 23.01.2034	1.575	1.577	0,53	Summe Luxemburg		1.353	0,46	BPFA Finance PLC 4,816 % fällig am 11.04.2044	495	447	0,15
Societe Generale S.A. 6,250 % fällig am 22.06.2033	500	497	0,17	<b>MEXIKO</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				British Land Co. PLC 2,375 % fällig am 14.09.2029 5,264 % fällig am 24.09.2035	800 400	611 363	0,21 0,12
Summe Frankreich		17.681	5,94	America Movil S.A.B. de C.V. 4,375 % fällig am 07.08.2041 4,948 % fällig am 22.07.2033	388 100	322 93	0,11 0,03	British Telecommunications PLC 3,125 % fällig am 21.11.2031 3,625 % fällig am 21.11.2047 5,750 % fällig am 13.02.2041 8,375 % fällig am 20.12.2083	400 300 2.500 800	323 205 2.312 788	0,11 0,07 0,78 0,26
Summe Mexiko		415	0,14	Summe Mexiko		415	0,14	Broadgate Financing PLC 4,999 % fällig am 05.10.2033 5,098 % fällig am 05.04.2035	600 88	553 77	0,19 0,03
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>NIEDERLANDE</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Cadent Finance PLC 2,250 % fällig am 10.10.2035 2,625 % fällig am 22.09.2038 2,750 % fällig am 22.09.2046 3,125 % fällig am 21.03.2040	500 2.700 1.500 300	332 1.742 873 204	0,11 0,58 0,29 0,07
SNCF Reseau 5,000 % fällig am 11.03.2052 5,250 % fällig am 31.01.2035	400 300	389 303	0,13 0,10	Cooperatieve Rabobank UA 5,250 % fällig am 23.05.2041	2.050	2.071	0,69	Catalyst Housing Ltd. 3,125 % fällig am 31.10.2047	900	596	0,20
Summe Frankreich		692	0,23	CTP NV 1,250 % fällig am 21.06.2029	€ 400	249	0,08	Chancellor Masters & Scholars of the University of Cambridge 2,350 % fällig am 27.06.2078 3,750 % fällig am 17.10.2052	200 800	115 667	0,04 0,22
<b>DEUTSCHLAND</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				E.ON International Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034 5,875 % fällig am 30.10.2037 6,125 % fällig am 06.07.2039	£ 3.800 2.500 1.650	3.402 2.410 1.628	1,14 0,81 0,55	Church Commissioners for England 3,625 % fällig am 14.07.2052	1.400	1.056	0,35
Deutsche Telekom AG 3,125 % fällig am 06.02.2034	1.700	1.372	0,46	Enel Finance International NV 5,750 % fällig am 14.09.2040	2.763	2.606	0,87	Citizen Treasury PLC 3,250 % fällig am 20.10.2048	1.300	910	0,31
<b>IRLAND</b> <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Holcim Sterling Finance Netherlands BV 2,250 % fällig am 04.04.2034 3,000 % fällig am 12.05.2032	1.800 300	1.243 234	0,42 0,08	Clarion Funding PLC 1,250 % fällig am 13.11.2032 1,875 % fällig am 22.01.2035 1,875 % fällig am 07.09.2051 3,125 % fällig am 19.04.2048	100 3.600 2.600 1.000	68 2.424 1.230 659	0,02 0,81 0,41 0,22
Toro European CLO DAC 3,995 % fällig am 12.01.2032	€ 2.600	2.188	0,73	ING Groep NV 6,250 % fällig am 20.05.2033	600	557	0,19	Derwent London PLC 1,875 % fällig am 17.11.2031	1.750	1.213	0,41
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				JAB Holdings BV 2,250 % fällig am 19.12.2039	€ 400	244	0,08	Diageo Finance PLC 2,750 % fällig am 08.06.2038	2.200	1.605	0,54
ESB Finance DAC 1,875 % fällig am 21.07.2035	£ 300	202	0,07	Siemens Financieringsmaatschappij NV 3,750 % fällig am 10.09.2042	£ 2.200	1.841	0,62	Eastern Power Networks PLC 2,125 % fällig am 25.11.2033	721	519	0,17
GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 18.01.2033	2.500	2.421	0,81	Summe Niederlande		16.485	5,53				
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. 5,125 % fällig am 23.11.2052	1.200	1.040	0,35	<b>NORWEGEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Summe Irland		5.851	1,96	Equinor ASA 4,250 % fällig am 10.04.2041	700	610	0,21				
<b>ITALIEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>SINGAPUR</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Enel SpA 5,750 % fällig am 22.06.2037	2.000	1.908	0,64	Temasek Financial Ltd. 5,125 % fällig am 26.07.2040	1.050	1.027	0,35				

# Aufstellung des Wertpapierbestands des UK Long Term Corporate Bond Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
EMH Treasury PLC 4,500 % fällig am 29.01.2044	£ 800	£ 692	0,23	Meadowhall Finance PLC 4,988 % fällig am 12.07.2037	£ 62	£ 47	0,02	Riverside Finance PLC 3,875 % fällig am 05.12.2044	£ 600	£ 472	0,16
Eversholt Funding PLC 3,529 % fällig am 07.08.2042	800	574	0,19	Metropolitan Housing Trust Ltd. 1,875 % fällig am 28.07.2036	2.400	1.546	0,52	Sage Group PLC 1,625 % fällig am 25.02.2031 2,875 % fällig am 08.02.2034	1.000 1.700	735 1.281	0,25 0,43
Futures Treasury PLC 3,375 % fällig am 08.02.2044	1.000	736	0,25	Mitchells & Butlers Finance PLC 5,965 % fällig am 15.12.2025 6,002 % fällig am 15.12.2030 6,013 % fällig am 15.12.2030 6,876 % fällig am 15.09.2034	37 \$ 660 £ 523 993	36 478 470 813	0,01 0,16 0,16 0,27	Sanctuary Capital PLC 2,375 % fällig am 14.04.2050 5,000 % fällig am 26.04.2047	1.000 500	572 457	0,19 0,15
GlaxoSmithKline Capital PLC 1,625 % fällig am 12.05.2035 5,250 % fällig am 19.12.2033 6,375 % fällig am 09.03.2039	4.000 105 500	2.700 104 547	0,91 0,04 0,18	Morhomes PLC 3,400 % fällig am 19.02.2040	4.200	3.185	1,07	Scottish Hydro Electric Transmission PLC 1,225 % fällig am 24.03.2036 2,250 % fällig am 27.09.2035	3.300 400	2.208 277	0,74 0,09
Grainger PLC 3,000 % fällig am 03.07.2030 3,375 % fällig am 24.04.2028	2.100 100	1.591 83	0,53 0,03	Motability Operations Group PLC 1,500 % fällig am 20.01.2041 2,125 % fällig am 18.01.2042 2,375 % fällig am 03.07.2039 4,875 % fällig am 17.01.2043	800 2.800 1.400 1.100	455 1.624 947 1.028	0,15 0,55 0,32 0,35	Segro PLC 5,750 % fällig am 20.06.2035	300	294	0,10
Great Places Housing Group Ltd. 4,750 % fällig am 22.10.2042	1.000	905	0,30	National Gas Transmission PLC 5,750 % fällig am 05.04.2035	1.850	1.761	0,59	Severn Trent Utilities Finance PLC 2,000 % fällig am 02.06.2040 2,625 % fällig am 22.02.2033 4,625 % fällig am 30.11.2034 4,875 % fällig am 24.01.2042 5,250 % fällig am 04.04.2036	1.800 556 300 1.300 300	1.050 421 267 1.140 280	0,35 0,14 0,09 0,38 0,09
Greene King Finance PLC 3,593 % fällig am 15.03.2035 4,064 % fällig am 15.03.2035 5,106 % fällig am 15.03.2034 5,318 % fällig am 15.09.2031	721 271 2.154 2.126	582 222 1.898 1.915	0,20 0,07 0,64 0,64	National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC 6,250 % fällig am 10.12.2040	500	514	0,17	Society of Lloyd's 4,875 % fällig am 07.02.2047	1.800	1.624	0,55
Guinness Partnership Ltd. 4,000 % fällig am 24.10.2044	1.000	810	0,27	National Grid Electricity Distribution South Wales PLC 1,625 % fällig am 07.10.2035	1.100	694	0,23	South Eastern Power Networks PLC 1,750 % fällig am 30.09.2034	5.000	3.374	1,12
Haleon UK Capital PLC 3,375 % fällig am 29.03.2038	1.920	1.456	0,49	National Grid Electricity Distribution South West PLC 5,750 % fällig am 23.03.2040	700	682	0,23	Southern Electric Power Distribution PLC 4,625 % fällig am 20.02.2037	1.500	1.312	0,44
Hexagon Housing Association Ltd. 3,625 % fällig am 22.04.2048	1.300	888	0,30	National Grid Electricity Transmission PLC 2,000 % fällig am 16.09.2038 2,000 % fällig am 17.04.2040 2,750 % fällig am 06.02.2035 5,272 % fällig am 18.01.2043	1.200 2.008 600 2.000	732 1.178 438 1.834	0,25 0,40 0,15 0,62	Southern Gas Networks PLC 3,100 % fällig am 15.09.2036 6,375 % fällig am 15.05.2040	2.100 600	1.515 601	0,51 0,20
High Speed Rail Finance PLC 4,375 % fällig am 01.11.2038	1.500	1.301	0,44	Nationwide Building Society 5,875 % fällig am 20.12.2024 (a)(b)	700	655	0,22	Southern Housing 2,375 % fällig am 08.10.2036 3,500 % fällig am 19.10.2047	1.500 1.400	1.029 978	0,35 0,33
Home Group Ltd. 3,125 % fällig am 27.03.2043	1.300	884	0,30	Nats En Route PLC 1,750 % fällig am 30.09.2033	400	280	0,09	Sovereign Housing Capital PLC 2,375 % fällig am 04.11.2048 5,705 % fällig am 10.09.2039	200 700	117 710	0,04 0,24
HSBC Holdings PLC 5,875 % fällig am 28.09.2026 (a)(b) 6,000 % fällig am 29.03.2040	200 600	175 527	0,06 0,18	NatWest Group PLC 3,619 % fällig am 29.03.2029 4,600 % fällig am 28.06.2031 (a)(b)	2.000 \$ 600	1.719 328	0,58 0,11	Standard Chartered PLC 4,375 % fällig am 18.01.2038 5,125 % fällig am 06.06.2034	900 500	799 429	0,27 0,14
Hyde Housing Association Ltd. 1,750 % fällig am 18.08.2055	1.600	739	0,25	Network Rail Infrastructure Finance PLC 4,750 % fällig am 29.11.2035	£ 400	397	0,13	Telereal Secured Finance PLC 4,010 % fällig am 10.12.2033	1.234	1.088	0,37
Jigsaw Funding PLC 3,375 % fällig am 05.05.2052	800	575	0,19	NIE Finance PLC 5,875 % fällig am 01.12.2032	400	396	0,13	Telereal Securitisation PLC 6,165 % fällig am 10.12.2033	85	81	0,03
John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034	2.222	1.386	0,47	Northern Electric Finance PLC 2,750 % fällig am 24.05.2049	2.150	1.365	0,46	Tesco Corporate Treasury Services PLC 5,500 % fällig am 27.02.2035	1.800	1.664	0,56
Juturna European Loan Conduit PLC 5,064 % fällig am 10.08.2033	967	916	0,31	Northern Gas Networks Finance PLC 4,875 % fällig am 15.11.2035 5,625 % fällig am 23.03.2040	900 800	796 746	0,27 0,25	Tesco Property Finance PLC 5,411 % fällig am 13.07.2044 5,661 % fällig am 13.10.2041 5,744 % fällig am 13.04.2040 5,801 % fällig am 13.10.2040 6,052 % fällig am 13.10.2039	1.993 190 2.887 325 113	1.780 174 2.681 303 108	0,60 0,06 0,90 0,10 0,04
Karbon Homes Ltd. 3,375 % fällig am 15.11.2047	300	220	0,07	Northern Powergrid Northeast PLC 1,875 % fällig am 16.06.2062 3,250 % fällig am 01.04.2052	100 600	47 413	0,02 0,14	Thames Water Utilities Finance PLC 2,375 % fällig am 22.04.2040 2,625 % fällig am 24.01.2032 4,375 % fällig am 03.07.2034 4,625 % fällig am 04.06.2046 5,125 % fällig am 28.09.2037 5,500 % fällig am 11.02.2041	1.100 300 3.700 700 800 200	632 221 2.987 528 668 172	0,21 0,07 1,00 0,18 0,22 0,06
Land Securities Capital Markets PLC 2,625 % fällig am 22.09.2039 2,750 % fällig am 22.09.2059	1.373 301	965 175	0,32 0,06	Northern Powergrid Yorkshire PLC 2,250 % fällig am 09.10.2059 5,125 % fällig am 04.05.2035	1.000 710	522 666	0,18 0,22	TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028	2.000	1.479	0,50
LCR Finance PLC 4,500 % fällig am 07.12.2038	75	72	0,02	Northumbrian Water Finance PLC 4,500 % fällig am 14.02.2031 5,625 % fällig am 29.04.2033 6,375 % fällig am 28.10.2034	800 400 1.020	717 383 1.025	0,24 0,13 0,34	Travis Perkins PLC 3,750 % fällig am 17.02.2026	300	270	0,09
Legal & General Group PLC 4,500 % fällig am 01.11.2050 5,500 % fällig am 27.06.2064 5,625 % fällig am 24.03.2031 (a)(b)	400 100 900	335 91 696	0,11 0,03 0,23	Notting Hill Genesis 2,000 % fällig am 03.06.2036 3,250 % fällig am 12.10.2048 5,250 % fällig am 07.07.2042	2.534 1.141 199	1.660 761 185	0,56 0,26 0,06	Unique Pub Finance Co. PLC 5,659 % fällig am 30.06.2027 7,395 % fällig am 28.03.2024	1.012 412	992 413	0,33 0,14
Lendlease Europe Finance PLC 3,500 % fällig am 02.12.2033	532	348	0,12	Orbit Capital PLC 3,375 % fällig am 14.06.2048	700	483	0,16	United Utilities Water Finance PLC 1,875 % fällig am 03.06.2042 5,750 % fällig am 26.06.2036	800 1.700	440 1.674	0,15 0,56
Liberty Living Finance PLC 3,375 % fällig am 28.11.2029	600	487	0,16	Pacific Quay Finance PLC 5,565 % fällig am 25.07.2034	768	743	0,25	University of Oxford 2,544 % fällig am 08.12.2117	1.850	970	0,33
Lloyds Banking Group PLC 2,707 % fällig am 03.12.2035 6,625 % fällig am 02.06.2033	127 500	92 474	0,03 0,16	Paragon Treasury PLC 2,000 % fällig am 07.05.2036	1.300	843	0,28	Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	1.100	868	0,29
London & Quadrant Housing Trust 2,000 % fällig am 31.03.2032 2,000 % fällig am 20.10.2038 3,125 % fällig am 28.02.2053 3,750 % fällig am 27.10.2049 4,625 % fällig am 05.12.2033	2.000 1.200 1.000 300 900	1.483 741 636 217 819	0,50 0,25 0,21 0,07 0,28	Peabody Capital PLC 3,250 % fällig am 14.09.2048 5,250 % fällig am 17.03.2043	2.400 300	1.615 281	0,54 0,09	Vodafone Group PLC 3,000 % fällig am 12.08.2056 3,375 % fällig am 08.08.2049	2.100 3.900	1.171 2.480	0,39 0,83
London Stock Exchange Group PLC 1,625 % fällig am 06.04.2030	900	703	0,24	Places for People Treasury PLC 2,500 % fällig am 26.01.2036	1.100	753	0,25	Weir Group PLC 6,875 % fällig am 14.06.2028	700	691	0,23
Longstone Finance PLC 4,896 % fällig am 19.04.2036	100	89	0,03	Platform HG Financing PLC 1,926 % fällig am 15.09.2041	1.200	735	0,25	Wellcome Trust Finance PLC 4,625 % fällig am 25.07.2036	500	481	0,16
M&G PLC 5,580 % fällig am 20.07.2055	3.450	2.950	0,99	Prudential Funding Asia PLC 6,125 % fällig am 19.12.2031	620	599	0,20				
Manchester Airport Group Funding PLC 2,875 % fällig am 30.09.2044 4,750 % fällig am 31.03.2034	2.050 500	1.303 454	0,44 0,15	RHP Finance PLC 3,250 % fällig am 05.02.2048	700	503	0,17				
Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	100	90	0,03								



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>Wellcome Trust Ltd.</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Mondelez International, Inc.</b>			
1,500 % fällig am 14.07.2071	£ 5.600	£ 2.220	0,75	United Kingdom Gilt	£ 21.600	£ 10.718	3,60	3,875 % fällig am 06.03.2045	£ 100	£ 74	0,03
2,517 % fällig am 07.02.2118	1.500	782	0,26	1,250 % fällig am 31.07.2051	400	209	0,07	<b>Morgan Stanley</b>	800	768	0,26
4,000 % fällig am 09.05.2059	400	348	0,12	1,500 % fällig am 31.07.2053	3.800	2.109	0,71	<b>National Fuel Gas Co.</b>	159	100	0,03
<b>Workspace Group PLC</b>				1,750 % fällig am 22.07.2057	3.300	2.747	0,92	2,950 % fällig am 01.03.2031			
2,250 % fällig am 11.03.2028	450	330	0,11	3,250 % fällig am 22.10.2044 (c)	2.800	2.490	0,83	<b>Pfizer, Inc.</b>	4.600	3.142	1,06
<b>Yorkshire Housing Finance PLC</b>				3,750 % fällig am 22.10.2053				2,735 % fällig am 15.06.2043	1.100	736	0,25
4,125 % fällig am 31.10.2044	800	637	0,21			18.273	6,13	<b>Realty Income Corp.</b>	500	302	0,10
<b>Yorkshire Water Finance PLC</b>				Summe Großbritannien		183.492	61,58	1,750 % fällig am 13.07.2033			
1,750 % fällig am 27.10.2032	715	499	0,17	<b>USA</b>				2,500 % fällig am 14.01.2042			
2,750 % fällig am 18.04.2041	1.100	705	0,24	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Time Warner Cable LLC</b>	2.986	2.367	0,79
5,500 % fällig am 28.04.2035	1.300	1.221	0,41	<b>Apple, Inc.</b>	1.400	1.164	0,39	5,250 % fällig am 15.07.2042			
		157.177	52,75	3,600 % fällig am 31.07.2042				<b>Verizon Communications, Inc.</b>	2.700	1.603	0,54
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>AT&amp;T, Inc.</b>	5.113	3.913	1,31	1,875 % fällig am 03.11.2038	600	452	0,15
<b>Atlas Funding PLC</b>				4,250 % fällig am 01.06.2043	4.038	3.352	1,13	3,125 % fällig am 02.11.2035	2.800	2.132	0,72
5,937 % fällig am 20.01.2061	594	595	0,20	4,875 % fällig am 01.06.2044				3,375 % fällig am 27.10.2036	1.000	905	0,30
<b>Avon Finance PLC</b>				<b>Berkshire Hathaway Finance Corp.</b>				4,750 % fällig am 17.02.2034			
5,809 % fällig am 20.09.2048	719	718	0,24	2,375 % fällig am 19.06.2039	400	272	0,09	<b>Walmart, Inc.</b>	2.000	2.006	0,67
<b>Great Hall Mortgages PLC</b>				2,625 % fällig am 19.06.2059	100	59	0,02	5,250 % fällig am 28.09.2035	1.600	1.655	0,56
3,697 % fällig am 18.06.2038	€ 6	5	0,00	<b>Charter Communications Operating LLC</b>				5,625 % fällig am 27.03.2034			
5,152 % fällig am 18.03.2039	€ 6	6	0,00	5,125 % fällig am 01.07.2049	\$ 500	310	0,10	<b>Wells Fargo &amp; Co.</b>	400	296	0,10
<b>Hops Hill PLC</b>				<b>Citigroup, Inc.</b>				2,125 % fällig am 24.09.2031	1.729	1.529	0,51
5,854 % fällig am 27.05.2054	394	394	0,13	6,800 % fällig am 25.06.2038	€ 2.000	2.213	0,74	4,625 % fällig am 02.11.2035	1.700	1.442	0,48
<b>Mansard Mortgages PLC</b>				7,375 % fällig am 01.09.2039	100	118	0,04	4,875 % fällig am 29.11.2035			
5,651 % fällig am 15.12.2049	124	122	0,04	<b>Comcast Corp.</b>	2.400	1.608	0,54	<b>Welltower OP LLC</b>	1.000	821	0,28
<b>Mortimer BTL PLC</b>				1,875 % fällig am 20.02.2036	\$ 1.600	50	0,02	4,500 % fällig am 01.12.2034			
5,614 % fällig am 23.06.2053	1.006	995	0,34	<b>Credit Suisse AG AT1 Claim ^</b>							
5,976 % fällig am 23.03.2054	775	775	0,26	<b>Eli Lilly &amp; Co.</b>	700	398	0,13				
<b>Newgate Funding PLC</b>				1,625 % fällig am 14.09.2043	€ 700						
4,126 % fällig am 15.12.2050	€ 1.234	1.021	0,34	<b>Entergy Corp.</b>							
5,038 % fällig am 01.12.2050	€ 60	57	0,02	3,750 % fällig am 15.06.2050	\$ 57	33	0,01	<b>Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust</b>	\$ 144	100	0,03
<b>Pierpont BTL PLC</b>				<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>				5,650 % fällig am 25.04.2035			
0,000 % fällig am 21.09.2054	900	898	0,30	6,825 % fällig am 29.10.2029	€ 2.300	1.987	0,67	<b>GSR Mortgage Loan Trust</b>	0	0	0,00
<b>Polaris PLC</b>				6,875 % fällig am 18.01.2038	500	499	0,17	4,662 % fällig am 25.09.2035			
5,631 % fällig am 23.12.2058	534	531	0,18	<b>International Business Machines Corp.</b>	200	179	0,06	<b>Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust</b>	3	3	0,00
<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>				4,875 % fällig am 06.02.2038				5,633 % fällig am 15.12.2030			
5,391 % fällig am 20.07.2060	651	651	0,22	<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>	1.400	1.016	0,34	<b>Sequoia Mortgage Trust</b>	6	4	0,00
<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>				1,895 % fällig am 28.04.2033				3,565 % fällig am 20.07.2037 ^			
5,635 % fällig am 20.10.2051	574	575	0,19	<b>McDonald's Corp.</b>	400	314	0,11				
<b>Twin Bridges PLC</b>				2,950 % fällig am 15.03.2034	2.100	1.679	0,56	Summe USA		39.494	13,29
5,715 % fällig am 12.03.2055	702	699	0,24	3,750 % fällig am 31.05.2038				Summe Übertragbare Wertpapiere	£	289.477	97,16
		8.042	2,70								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>		% des Nettovermögens
							Pensions- geschäfte, zum Wert		
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 410	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	£ (329)	£ 322	£ 322	0,11
SCX	4,900	30.06.2023	03.07.2023	£ 1.600	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.10.2041	(1.644)	1.600	1.601	0,54
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						£ (1.973)	£ 1.922	£ 1.923	0,65

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	19	£ 21	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	2	6	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	46	(35)	(0,01)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	6	(18)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	12	27	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	29	(47)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	24	1	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	14	6	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	20	(13)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2023	5	(8)	0,00
				£ (60)	(0,02)
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				£ (60)	(0,02)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des UK Long Term Corporate Bond Fund (Fort.)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 11.900	£ (142)	(0,05)	
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	20.900	(1.138)	(0,38)	
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	11.700	521	0,18	
Zahlung <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	3.400	(52)	(0,02)	
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	\$ 3.700	484	0,16	
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.12.2050	100	27	0,01	
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	2.700	424	0,14	
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,625	16.01.2050	100	34	0,01	
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.06.2047	1.300	423	0,14	
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	18.12.2049	400	136	0,05	
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	12.02.2045	6.600	2.161	0,73	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.09.2023	3.700	34	0,01	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023	100	1	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.09.2023	3.500	28	0,01	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	16.07.2023	100	0	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	18.09.2023	400	3	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.09.2023	1.300	10	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.08.2023	6.600	21	0,01	
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 500	(8)	0,00	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	1.400	(23)	(0,01)	
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	500	1	0,00	
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	4.300	(3)	0,00	
					£ 2.942	0,99	
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>£ 2.942</b>	<b>0,99</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

#### DEVISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BRC	08.2023	£ 710	€ 815	£ 0	£ (9)	£ (9)	0,00
	08.2023	\$ 362	\$ 448	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	\$ 733	£ 584	7	0	7	0,00
DUB	08.2023	£ 1.769	\$ 2.200	0	(39)	(39)	(0,01)
JPM	08.2023	€ 4.896	£ 4.266	56	0	56	0,02
	08.2023	\$ 8.166	\$ 6.448	26	0	26	0,01
MBC	08.2023	£ 3.435	€ 3.948	1	(42)	(41)	(0,01)
	08.2023	\$ 2.647	\$ 3.320	4	(40)	(36)	(0,01)
	08.2023	¥ 27.000	£ 161	13	0	13	0,00
	08.2023	\$ 655	£ 511	0	(4)	(4)	0,00
MYI	08.2023	£ 650	€ 753	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	\$ 683	\$ 854	0	(11)	(11)	0,00
RBC	08.2023	£ 1.326	€ 1.526	1	(15)	(14)	(0,01)
	08.2023	\$ 2.966	\$ 3.677	0	(76)	(76)	(0,03)
	08.2023	\$ 1.575	£ 1.246	8	0	8	0,00
SCX	08.2023	€ 7.746	£ 6.764	104	0	104	0,03
	08.2023	£ 351	\$ 441	0	(4)	(4)	0,00
TOR	08.2023	£ 1.275	£ 1.598	0	(18)	(18)	(0,01)
UAG	08.2023	\$ 522	€ 606	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	\$ 1.835	\$ 2.282	0	(40)	(40)	(0,01)
	08.2023	\$ 7.138	£ 5.648	34	0	34	0,01
				£ 254	£ (312)	£ (58)	(0,02)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>£ (58)</b>	<b>(0,02)</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>£ 294.223</b>	<b>98,76</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>£ 3.689</b>	<b>1,24</b>
<b>Nettvermögen</b>						<b>£ 297.912</b>	<b>100,00</b>

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend)\*:

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(b) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(c) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 2.747 GBP (31. Dezember 2022: null GBP) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 4.147 GBP (31. Dezember 2022: 10.123 GBP) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 289.477	£ 0	£ 289.477
Pensionsgeschäfte	0	1.922	0	1.922
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(34)	2.858	0	2.824
<b>Summen</b>	<b>£ (34)</b>	<b>£ 294.257</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 294.223</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 309.110	£ 0	£ 309.110
Pensionsgeschäfte	0	269	0	269
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.767)	6.087	0	4.320
<b>Summen</b>	<b>£ (1.767)</b>	<b>£ 315.466</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 313.699</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
SCX	4,650 %	16.05.2023	08.08.2023	£ (2.898)	£ (2.915)	(0,98)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>£ (2.915)</b>	<b>(0,98)</b>

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	£ k. A.	£ k. A.	£ k. A.	£ 408	£ (510)	£ (102)
BRC	(12)	0	(12)	1	0	1
DUB	(39)	0	(39)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(76)	0	(76)
JPM	82	0	82	48	0	48
MBC	(68)	0	(68)	9	0	9
MYI	(14)	0	(14)	2	0	2
RBC	(82)	0	(82)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	100	0	100	(4)	0	(4)
SBB	k. A.	k. A.	k. A.	(239)	0	(239)
TOR	(18)	0	(18)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(7)	0	(7)	(12)	0	(12)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	96,29	93,60
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	0,85	1,51
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,02	k. A.
Pensionsgeschäfte	0,65	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	(0,54)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,99	1,83
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,02)	0,04
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,98)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,14	k. A.
Belgien	k. A.	0,19
Cayman-Inseln	0,58	k. A.
Dänemark	1,25	1,23
Frankreich	6,17	5,11
Deutschland	0,46	2,80
Indien	k. A.	0,05
Irland	1,96	2,32
Italien	0,90	0,78
Japan	k. A.	0,09
Jersey, Kanalinseln	3,33	2,73
Luxemburg	0,46	1,21
Mexiko	0,14	0,13
Niederlande	5,53	5,45
Norwegen	0,21	0,27
Singapur	0,35	0,33
Spanien	k. A.	0,22
Supranational	0,37	1,18
Schweden	0,44	0,16
Schweiz	k. A.	1,21
Großbritannien	61,58	52,18
USA	13,29	13,85
Kurzfristige Instrumente	k. A.	3,62
Pensionsgeschäfte	0,65	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,02)	(0,54)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,05
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,14
Zinsswaps	0,99	1,64
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,02)	0,05
Sonstige Aktiva und Passiva	1,24	3,48
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
Hearland Dental LLC 10,102 % fällig am 28.04.2028	\$ 4.983	\$ 4.819	0,24	Rocket Mortgage LLC 3,625 % fällig am 01.03.2029	\$ 1.000	\$ 841	0,04	Athenahealth Group, Inc. 7,500 % fällig am 30.09.2029	\$ 2.000	\$ 1.240	0,06
Intelsat Jackson Holdings S.A. 9,443 % fällig am 01.02.2029	2.779	2.771	0,14	3,875 % fällig am 01.03.2031	2.000	1.624	0,08	6,500 % fällig am 15.02.2030	10.000	8.426	0,43
Serta Simmons Bedding LLC 8,098 % - 8,117 % fällig am 08.11.2023	3.101	132	0,01	4,000 % fällig am 15.10.2033	2.000	1.566	0,08	Avantor Funding, Inc. 4,625 % fällig am 15.07.2028	6.000	5.567	0,28
Team Health Holdings, Inc. 7,943 % fällig am 06.02.2024	5.780	5.140	0,26	SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	10.000	8.486	0,43	Axalta Coating Systems LLC 3,375 % fällig am 15.02.2029	5.000	4.261	0,22
		12.862	0,65	Voyager Aviation Holdings LLC 8,500 % fällig am 09.05.2026	1.805	1.426	0,07	B.C. Ltd. 9,000 % fällig am 30.01.2028	2.150	2.158	0,11
						137.282	6,94	B.C. Unlimited Liability Co. 3,500 % fällig am 15.02.2029	2.250	1.975	0,10
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
Alliant Holdings Intermediate LLC 4,250 % fällig am 15.10.2027	5.000	4.494	0,23	24 Hour Fitness Worldwide, Inc. 8,000 % fällig am 01.06.2022 ^	9.500	24	0,00	3,875 % fällig am 15.01.2028	2.000	1.830	0,09
6,750 % fällig am 15.04.2028	2.750	2.730	0,14	Academy Ltd. 6,000 % fällig am 15.11.2027	4.000	3.844	0,19	6,000 % fällig am 15.06.2029	1.750	1.739	0,09
Allied Universal Holdco LLC 4,625 % fällig am 01.06.2028	3.000	2.543	0,13	AdaptHealth LLC 6,125 % fällig am 01.08.2028	3.000	2.602	0,13	Bath & Body Works, Inc. 6,625 % fällig am 01.10.2030	2.000	1.933	0,10
Armor Holdco, Inc. 8,500 % fällig am 15.11.2029	7.500	6.232	0,31	Adient Global Holdings Ltd. 4,875 % fällig am 15.08.2026	3.000	2.853	0,14	6,875 % fällig am 01.11.2035	3.000	2.750	0,14
Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % fällig am 01.07.2031	6.250	6.219	0,31	ADT Security Corp. 4,875 % fällig am 15.07.2032	4.000	3.426	0,17	9,375 % fällig am 01.07.2025	1.438	1.528	0,08
Curo Group Holdings Corp. 7,500 % fällig am 01.08.2028	4.000	1.515	0,08	Advantage Sales & Marketing, Inc. 6,500 % fällig am 15.11.2028	5.000	4.233	0,21	Bausch Health Cos., Inc. 4,875 % fällig am 01.06.2028	2.000	1.193	0,06
Ford Motor Credit Co. LLC 2,900 % fällig am 16.02.2028	5.000	4.287	0,22	Ahead DB Holdings LLC 6,625 % fällig am 01.05.2028	10.000	8.144	0,41	5,500 % fällig am 01.11.2025	3.500	3.097	0,16
2,900 % fällig am 10.02.2029	8.000	6.628	0,34	Ahlstrom Holding 3 Oy 4,875 % fällig am 04.02.2028	4.000	3.326	0,17	5,750 % fällig am 15.08.2027	1.000	614	0,03
3,375 % fällig am 13.11.2025	5.000	4.654	0,24	Air Canada 3,875 % fällig am 15.08.2026	2.500	2.319	0,12	11,000 % fällig am 30.09.2028	2.750	1.960	0,10
3,664 % fällig am 08.09.2024	3.000	2.902	0,15	4,625 % fällig am 15.08.2029	CAD 1.750	1.193	0,06	14,000 % fällig am 15.10.2030	760	456	0,02
4,000 % fällig am 13.11.2030	7.500	6.416	0,32	Albertsons Cos., Inc. 3,500 % fällig am 15.03.2029	\$ 2.000	1.733	0,09	BCPE Empire Holdings, Inc. 7,625 % fällig am 01.05.2027	11.900	11.080	0,56
4,125 % fällig am 17.08.2027	5.000	4.570	0,23	5,125 % fällig am 15.01.2027	1.500	1.423	0,07	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 2.500	2.668	0,14
4,134 % fällig am 04.08.2025	5.000	4.747	0,24	4,625 % fällig am 15.02.2028	1.500	1.423	0,07	Black Knight InfoServ LLC 3,625 % fällig am 01.09.2028	\$ 3.000	2.693	0,14
4,542 % fällig am 01.08.2026	2.000	1.882	0,10	5,875 % fällig am 15.02.2028	1.500	1.459	0,07	Block, Inc. 3,500 % fällig am 01.06.2031	5.000	4.148	0,21
5,113 % fällig am 03.05.2029	3.000	2.785	0,14	6,500 % fällig am 15.02.2028	5.000	5.014	0,25	Bombardier, Inc. 6,000 % fällig am 15.02.2028	3.000	2.839	0,14
5,125 % fällig am 16.06.2025	2.500	2.434	0,12	Allison Transmission, Inc. 3,750 % fällig am 30.01.2031	5.000	4.228	0,21	7,125 % fällig am 15.06.2026	5.000	4.972	0,25
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 6,500 % fällig am 01.10.2025	3.222	3.177	0,16	Altice Financing S.A. 5,000 % fällig am 15.01.2028	4.000	3.201	0,16	7,500 % fällig am 15.03.2025	854	857	0,04
Getty Images, Inc. 9,750 % fällig am 01.03.2027	8.250	8.157	0,41	Altice France Holding S.A. 6,000 % fällig am 15.02.2028	5.000	2.444	0,12	7,500 % fällig am 01.02.2029	2.000	1.979	0,10
GreyStar Real Estate Partners LLC 5,750 % fällig am 01.12.2025	2.000	1.955	0,10	10,500 % fällig am 15.05.2027	3.000	1.820	0,09	7,875 % fällig am 15.04.2027	6.000	5.993	0,30
HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	2.600	2.333	0,12	Altice France S.A. 5,125 % fällig am 15.01.2029	3.000	2.142	0,11	Boyer USA, Inc. 4,750 % fällig am 15.05.2029	2.500	2.255	0,11
3,750 % fällig am 15.09.2030	4.600	3.613	0,18	5,125 % fällig am 15.07.2029	4.000	2.844	0,14	Buckeye Partners LP 4,125 % fällig am 01.03.2025	2.000	1.904	0,10
Howard Hughes Corp. 4,125 % fällig am 01.02.2029	1.000	829	0,04	5,500 % fällig am 15.01.2028	8.000	6.050	0,31	4,500 % fällig am 01.03.2028	2.000	1.794	0,09
4,375 % fällig am 01.02.2031	2.750	2.197	0,11	5,500 % fällig am 15.10.2029	2.000	1.432	0,07	Builders FirstSource, Inc. 5,000 % fällig am 01.03.2030	5.000	4.680	0,24
5,375 % fällig am 01.08.2028	2.500	2.228	0,11	8,125 % fällig am 01.02.2027	3.000	2.601	0,13	CAB SELAS 3,375 % fällig am 01.02.2028	€ 5.000	4.459	0,23
Intesa Sanpaolo SpA 5,710 % fällig am 15.01.2026	1.000	953	0,05	AMC Networks, Inc. 4,250 % fällig am 15.02.2029	5.000	2.693	0,14	Cablevision Lightpath LLC 5,625 % fällig am 15.09.2028	\$ 4.000	2.968	0,15
7,700 % fällig am 17.09.2025 (f)(h)	4.000	3.765	0,19	4,750 % fällig am 01.08.2025	5.700	4.991	0,25	Caesars Entertainment, Inc. 4,625 % fällig am 15.10.2029	9.000	7.867	0,40
Midcap Financial Issuer Trust 5,625 % fällig am 15.01.2030	2.000	1.590	0,08	American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % fällig am 01.11.2028	2.102	1.887	0,10	7,000 % fällig am 15.02.2030	2.000	2.010	0,10
6,500 % fällig am 01.05.2028	2.000	1.782	0,09	American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	5.700	5.652	0,29	8,125 % fällig am 01.07.2027	2.000	2.049	0,10
MPT Operating Partnership LP 3,500 % fällig am 15.03.2031	2.000	1.380	0,07	5,750 % fällig am 20.04.2029	14.950	14.530	0,74	Callon Petroleum Co. 7,500 % fällig am 15.06.2030	2.500	2.362	0,12
Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,125 % fällig am 15.12.2030	5.000	4.061	0,21	7,250 % fällig am 15.02.2028	700	697	0,04	Capstone Borrower, Inc. 8,000 % fällig am 15.06.2030	2.050	2.026	0,10
NCL Finance Ltd. 6,125 % fällig am 15.03.2028	2.000	1.802	0,09	Antero Resources Corp. 5,375 % fällig am 01.03.2030	1.500	1.390	0,07	Cargo Aircraft Management, Inc. 4,750 % fällig am 01.02.2028	1.000	877	0,04
OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027	4.000	3.436	0,17	Apache Corp. 4,875 % fällig am 15.11.2027	4.000	3.716	0,19	Carnival Corp. 4,000 % fällig am 01.08.2028	5.000	4.437	0,22
4,000 % fällig am 15.09.2030	3.000	2.313	0,12	API Group DE, Inc. 4,750 % fällig am 15.10.2029	4.000	3.607	0,18	5,750 % fällig am 01.03.2027	4.000	3.686	0,19
5,375 % fällig am 15.11.2029	3.000	2.553	0,13	Arches Buyer, Inc. 4,250 % fällig am 01.06.2028	3.500	3.050	0,15	6,000 % fällig am 01.05.2029	2.500	2.234	0,11
6,625 % fällig am 15.01.2028	1.500	1.416	0,07	6,125 % fällig am 01.12.2028 (j)	4.000	3.451	0,17	7,625 % fällig am 01.03.2026 (j)	4.000	3.921	0,20
6,875 % fällig am 15.03.2025	1.000	991	0,05	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3,250 % fällig am 01.09.2028	2.000	1.720	0,09	Carnival PLC 1,000 % fällig am 28.10.2029	€ 5.000	3.431	0,17
7,125 % fällig am 15.03.2026	3.000	2.950	0,15	4,000 % fällig am 01.09.2029	2.000	1.586	0,08	Carvana Co. 4,875 % fällig am 01.09.2029	\$ 2.000	1.137	0,06
Park Intermediate Holdings LLC 4,875 % fällig am 15.05.2029	1.000	863	0,04	Ascent Resources Ulica Holdings LLC 5,875 % fällig am 30.06.2029	2.000	1.786	0,09	5,500 % fällig am 15.04.2027	2.000	1.341	0,07
5,875 % fällig am 01.10.2028	1.500	1.378	0,07	8,250 % fällig am 31.12.2028	1.000	984	0,05	Catalent Pharma Solutions, Inc. 2,375 % fällig am 01.03.2028	€ 2.000	1.766	0,09
PennyMac Financial Services, Inc. 5,375 % fällig am 15.10.2025	1.000	946	0,05	ASP Unifrax Holdings, Inc. 5,250 % fällig am 30.09.2028	2.000	1.446	0,07	3,125 % fällig am 15.02.2029	\$ 6.000	4.884	0,25
5,750 % fällig am 15.09.2031	2.000	1.633	0,08					CCO Holdings LLC 4,250 % fällig am 01.02.2031	10.000	8.099	0,41





BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
LifePoint Health, Inc. 5,375 % fällig am 15.01.2029	\$ 5.000	\$ 2.958	0,15	5,000 % fällig am 15.08.2027	\$ 2.125	\$ 1.932	0,10	5,000 % fällig am 01.08.2027	\$ 1.000	\$ 929	0,05
Lindblad Expeditions LLC 6,750 % fällig am 15.02.2027	1.900	1.812	0,09	Owens-Brockway Glass Container, Inc. 7,250 % fällig am 15.05.2031	3.000	3.041	0,15	SM Energy Co. 6,500 % fällig am 15.07.2028	1.500	1.441	0,07
Madison IAQ LLC 4,125 % fällig am 30.06.2028 5,875 % fällig am 30.06.2029	3.000 2.250	2.644 1.825	0,13 0,09	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC 4,375 % fällig am 15.10.2028	3.000	2.601	0,13	Southwestern Energy Co. 4,750 % fällig am 01.02.2032 5,375 % fällig am 01.02.2029 5,375 % fällig am 15.03.2030	1.000 3.000 3.000	883 2.828 2.802	0,04 0,14 0,14
MajorDrive Holdings LLC 6,375 % fällig am 01.06.2029	7.800	6.202	0,31	Performance Food Group, Inc. 4,250 % fällig am 01.08.2029 5,500 % fällig am 15.10.2027 6,875 % fällig am 01.05.2025	3.000 1.500 1.000	2.674 1.447 1.002	0,14 0,07 0,05	Spectrum Brands, Inc. 3,875 % fällig am 15.03.2031 5,500 % fällig am 15.07.2030 5,750 % fällig am 15.07.2025	4.000 3.000 2.000	3.284 2.740 2.000	0,17 0,14 0,10
Marriott Ownership Resorts, Inc. 4,500 % fällig am 15.06.2029	3.250	2.808	0,14	Permian Resources Operating LLC 4,500 % fällig am 15.01.2026	5.000	4.768	0,24	Spirit AeroSystems, Inc. 4,600 % fällig am 15.06.2028 7,500 % fällig am 15.04.2025 9,375 % fällig am 30.11.2029	6.275 3.250 3.000	5.271 3.216 3.215	0,27 0,16 0,16
Mattel, Inc. 3,375 % fällig am 01.04.2026 3,750 % fällig am 01.04.2029 5,875 % fällig am 15.12.2027	3.000 2.000 4.000	2.764 1.762 3.932	0,14 0,09 0,20	PetSmart, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2028 7,750 % fällig am 15.02.2029	8.500 5.000	7.865 4.974	0,40 0,25	Spirit Loyalty Cayman Ltd. 8,000 % fällig am 20.09.2025	3.000	3.025	0,15
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 7,875 % fällig am 15.08.2026 9,250 % fällig am 15.04.2027	3.500 4.000	3.481 3.697	0,18 0,19	Post Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 15.09.2031 4,625 % fällig am 15.04.2030 5,625 % fällig am 15.01.2028	1.779 5.000 4.000	1.521 4.387 3.849	0,08 0,22 0,19	SRS Distribution, Inc. 6,000 % fällig am 01.12.2029 6,125 % fällig am 01.07.2028	4.300 4.300	3.717 3.719	0,19 0,19
McAfee Corp. 7,375 % fällig am 15.02.2030	9.000	7.835	0,40	Presidio Holdings, Inc. 4,875 % fällig am 01.02.2027 8,250 % fällig am 01.02.2028	2.500 3.750	2.349 3.575	0,12 0,18	Standard Industries, Inc. 3,375 % fällig am 15.01.2031 4,375 % fällig am 15.07.2030 4,750 % fällig am 15.01.2028 5,000 % fällig am 15.02.2027	4.000 2.500 3.500 1.500	3.225 2.168 3.263 1.431	0,16 0,11 0,17 0,07
Medline Borrower LP 3,875 % fällig am 01.04.2029 5,250 % fällig am 01.10.2029	7.000 18.000	6.090 15.637	0,31 0,79	Prime Security Services Borrower LLC 3,375 % fällig am 31.08.2027 5,250 % fällig am 15.04.2024 5,750 % fällig am 15.04.2026 6,250 % fällig am 15.01.2028	2.000 1.600 1.000 5.000	1.766 1.588 983 4.691	0,09 0,08 0,05 0,24	Strathcona Resources Ltd. 6,875 % fällig am 01.08.2026	4.625	4.053	0,21
Merlin Entertainment Ltd. 5,750 % fällig am 15.06.2026	2.000	1.930	0,10	Real Hero Merger Sub, Inc. 6,250 % fällig am 01.02.2029	2.500	2.053	0,10	Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP 5,875 % fällig am 15.05.2025	3.150	3.043	0,15
Michaels Cos., Inc. 5,250 % fällig am 01.05.2028	3.000	2.427	0,12	Ritchie Bros Holdings, Inc. 6,750 % fällig am 15.03.2028 7,750 % fällig am 15.03.2031	1.250 2.000	1.261 2.077	0,06 0,11	Summer BC Bidco LLC 5,500 % fällig am 31.10.2026	4.000	3.371	0,17
Midwest Gaming Borrower LLC 4,875 % fällig am 01.05.2029	5.000	4.420	0,22	Rockcliff Energy LLC 5,500 % fällig am 15.10.2029	6.000	5.541	0,28	Superior Plus LP 4,500 % fällig am 15.03.2029	3.000	2.633	0,13
Monitchem HoldCo 3 S.A. 8,750 % fällig am 01.05.2028	€ 800	864	0,04	Rockies Express Pipeline LLC 4,800 % fällig am 15.05.2030 4,950 % fällig am 15.07.2029	2.000 2.000	1.750 1.832	0,09 0,09	Syneos Health, Inc. 3,625 % fällig am 15.01.2029	3.000	2.936	0,15
Motion Bondco DAC 6,625 % fällig am 15.11.2027	\$ 1.000	916	0,05	Roller Bearing Co. of America, Inc. 4,375 % fällig am 15.10.2029	3.000	2.691	0,14	Team Health Holdings, Inc. 6,375 % fällig am 01.02.2025	10.300	5.478	0,28
MPH Acquisition Holdings LLC 5,750 % fällig am 01.11.2028 (j)	5.000	3.769	0,19	Rolls-Royce PLC 3,625 % fällig am 14.10.2025 5,750 % fällig am 15.10.2027	1.000 £ 1.750	950 2.068	0,05 0,10	TEGNA, Inc. 4,625 % fällig am 15.03.2028 4,750 % fällig am 15.03.2026 5,000 % fällig am 15.09.2029	1.000 1.000 4.000	886 956 3.455	0,05 0,05 0,17
Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 7.000	6.530	0,33	Royal Caribbean Cruises Ltd. 4,250 % fällig am 01.07.2026 5,375 % fällig am 15.07.2027 5,500 % fällig am 31.08.2026 5,500 % fällig am 01.04.2028 7,250 % fällig am 15.01.2030	5.000 3.000 10.000 7.100 2.000	4.594 2.808 9.490 6.628 2.027	0,23 0,14 0,48 0,34 0,10	Tenet Healthcare Corp. 4,375 % fällig am 15.01.2030 5,125 % fällig am 01.11.2027 6,125 % fällig am 01.10.2028 6,125 % fällig am 15.06.2030 6,875 % fällig am 15.11.2031	4.000 3.500 10.000 5.000 4.000	3.613 3.345 9.637 4.935 3.996	0,18 0,17 0,49 0,25 0,20
Nabors Industries, Inc. 7,375 % fällig am 15.05.2027	\$ 2.000	1.905	0,10	Sabre Global, Inc. 7,375 % fällig am 01.09.2025 9,250 % fällig am 15.04.2025	1.000 183	889 171	0,05 0,01	TK Elevator U.S. Newco, Inc. 5,250 % fällig am 15.07.2027	€ 1.800 \$ 4.734	1.686 4.300	0,09 0,22
NCL Corp. Ltd. 3,625 % fällig am 15.12.2024 5,875 % fällig am 15.03.2026 7,750 % fällig am 15.02.2029	5.000 4.000 2.500	4.816 3.746 2.377	0,24 0,19 0,12	Scientific Games Holdings LP 6,625 % fällig am 01.03.2030	7.000	6.166	0,31	TransDigm, Inc. 4,625 % fällig am 15.01.2029 5,500 % fällig am 15.11.2027 6,250 % fällig am 15.03.2026 6,750 % fällig am 15.08.2028	7.000 7.000 1.750 5.000	6.235 6.611 1.743 5.025	0,32 0,33 0,09 0,25
NCR Corp. 5,000 % fällig am 01.10.2028 5,125 % fällig am 15.04.2029 5,250 % fällig am 01.10.2030	1.750 3.000 2.000	1.564 2.659 1.742	0,08 0,13 0,09	SCIH Salt Holdings, Inc. 4,875 % fällig am 01.05.2028 6,625 % fällig am 01.05.2029	5.000 5.000	4.472 4.195	0,23 0,21	Transocean Titan Financing Ltd. 8,375 % fällig am 01.02.2028	4.000	4.089	0,21
NESCO Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.04.2029	2.250	2.017	0,10	Scripps Escrow, Inc. 5,375 % fällig am 15.01.2031 (j)	5.000	3.528	0,18	Transocean, Inc. 8,750 % fällig am 15.02.2030	2.000	2.032	0,10
Newell Brands, Inc. 5,875 % fällig am 01.04.2036 6,375 % fällig am 15.09.2027	1.200 1.250	1.005 1.200	0,05 0,06	Seagate HDD Cayman 8,250 % fällig am 15.12.2029 8,500 % fällig am 15.07.2031 9,625 % fällig am 01.12.2032	1.150 1.175 2.000	1.202 1.234 2.209	0,06 0,06 0,11	Travel + Leisure Co. 4,625 % fällig am 01.03.2030 6,625 % fällig am 31.07.2026	5.000 3.500	4.236 3.477	0,21 0,18
Newfold Digital Holdings Group, Inc. 6,000 % fällig am 15.02.2029	7.000	5.261	0,27	Sensata Technologies BV 4,000 % fällig am 15.04.2029	5.000	4.456	0,23	Trident TPI Holdings, Inc. 12,750 % fällig am 31.12.2028	9.750	10.123	0,51
Noble Finance LLC 8,000 % fällig am 15.04.2030	2.500	2.544	0,13	Sensata Technologies, Inc. 3,750 % fällig am 15.02.2031	4.000	3.426	0,17	TriNet Group, Inc. 3,500 % fällig am 01.03.2029	5.000	4.352	0,22
Nokia Oyj 6,625 % fällig am 15.05.2039	3.000	2.873	0,15	Sigma Holdco BV 7,875 % fällig am 15.05.2026	8.000	6.885	0,35	Triton Water Holdings, Inc. 6,250 % fällig am 01.04.2029	2.000	1.719	0,09
Novelis Corp. 3,250 % fällig am 15.11.2026 3,875 % fällig am 15.08.2031 4,750 % fällig am 30.01.2030	3.000 7.000 5.000	2.719 5.768 4.448	0,14 0,29 0,23	Simmons Foods, Inc. 4,625 % fällig am 01.03.2029	5.000	4.012	0,20	Triumph Group, Inc. 7,750 % fällig am 15.08.2025 9,000 % fällig am 15.03.2028	4.000 5.250	3.893 5.367	0,20 0,27
NuStar Logistics LP 5,750 % fällig am 01.10.2025 6,375 % fällig am 01.10.2030	2.000 2.000	1.952 1.910	0,10 0,10	Sirius XM Radio, Inc. 3,875 % fällig am 01.09.2031 4,125 % fällig am 01.07.2030	1.000 3.250	774 2.657	0,04 0,13				
Olympus Water U.S. Holding Corp. 3,875 % fällig am 01.10.2028 4,250 % fällig am 01.10.2028 5,375 % fällig am 01.10.2029 (j) 6,250 % fällig am 01.10.2029	€ 1.000 \$ 7.000 € 8.000 \$ 2.000	864 5.540 6.115 1.448	0,04 0,28 0,31 0,07	Outfront Media Capital LLC 4,250 % fällig am 15.01.2029	2.000	1.683	0,09				
ON Semiconductor Corp. 3,875 % fällig am 01.09.2028	2.500	2.278	0,12								
Organon & Co. 4,125 % fällig am 30.04.2028 5,125 % fällig am 30.04.2031	5.000 4.000	4.443 3.305	0,22 0,17								



# Aufstellung des Wertpapierbestands des US High Yield Bond Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Twilio, Inc. 3,625 % fällig am 15.03.2029	\$ 3.000	\$ 2.555	0,13	4,625 % fällig am 31.01.2032	\$ 5.000	4.523	0,23	Countrywide Alternative Loan Trust			
3,875 % fällig am 15.03.2031	2.500	2.084	0,11	4,750 % fällig am 15.01.2030	2.000	1.875	0,10	5,617 % fällig am 20.05.2046 ^	\$ 55	\$ 46	0,00
U.S. Acute Care Solutions LLC 6,375 % fällig am 01.03.2026	6.000	5.144	0,26	6,875 % fällig am 15.11.2037	2.000	2.161	0,11	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
U.S. Foods, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2029	7.000	6.416	0,32	Zayo Group Holdings, Inc. 4,000 % fällig am 01.03.2027	3.000	2.122	0,11	5,790 % fällig am 25.03.2035	16	13	0,00
6,250 % fällig am 15.04.2025	2.000	2.001	0,10	ZF North America Capital, Inc. 6,875 % fällig am 14.04.2028	550	558	0,03	5,850 % fällig am 25.02.2036 ^	3	1	0,00
U.S. Renal Care, Inc. 10,625 % fällig am 15.07.2027	6.000	1.530	0,08	7,125 % fällig am 14.04.2030	1.450	1.476	0,07	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust	344	82	0,01
Uber Technologies, Inc. 4,500 % fällig am 15.08.2029	4.000	3.689	0,19	Ziggo BV 4,875 % fällig am 15.01.2030	4.200	3.490	0,18	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust	39	32	0,00
7,500 % fällig am 15.09.2027	1.500	1.536	0,08			1.387.008	70,14	5,000 % fällig am 25.02.2037 ^			
United Airlines, Inc. 4,375 % fällig am 15.04.2026	4.000	3.804	0,19	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				GSR Mortgage Loan Trust	1	1	0,00
4,625 % fällig am 15.04.2029	8.900	8.117	0,41	Antero Midstream Partners LP 5,375 % fällig am 15.06.2029	2.500	2.325	0,12	4,567 % fällig am 25.04.2035			
Univar Solutions USA, Inc. 5,125 % fällig am 01.12.2027	2.500	2.558	0,13	5,750 % fällig am 01.03.2027	1.000	965	0,05	IndyMac Mortgage Loan Trust	188	138	0,01
Univision Communications, Inc. 4,500 % fällig am 01.05.2029	7.000	6.022	0,30	Blue Racer Midstream LLC 6,625 % fällig am 15.07.2026	2.000	1.982	0,10	MortgageIT Trust			
6,625 % fällig am 01.06.2027	2.000	1.936	0,10	7,625 % fällig am 15.12.2025	2.000	2.024	0,10	5,790 % fällig am 25.02.2035	29	28	0,00
UPC Holding BV 5,500 % fällig am 15.01.2028	3.000	2.623	0,13	Calpine Corp. 3,750 % fällig am 01.03.2031	5.000	4.055	0,21	Residential Accredit Loans, Inc. Trust	80	64	0,00
Valaris Ltd. 8,375 % fällig am 30.04.2030	2.700	2.712	0,14	4,500 % fällig am 15.02.2028	2.500	2.266	0,11	TBW Mortgage-Backed Trust	662	20	0,00
Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 15.08.2029	5.000	4.373	0,22	5,125 % fällig am 15.03.2028	2.000	1.788	0,09	6,470 % fällig am 25.09.2036 ^			
4,125 % fällig am 15.08.2031	3.000	2.584	0,13	Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	10.000	8.308	0,42	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	160	140	0,01
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	6.000	6.101	0,31	Crestwood Midstream Partners LP 5,625 % fällig am 01.05.2027	3.000	2.847	0,14	3,528 % fällig am 25.12.2036 ^	90	82	0,01
8,375 % fällig am 01.06.2031	10.100	10.196	0,52	6,000 % fällig am 01.02.2029	2.000	1.870	0,09	3,816 % fällig am 25.10.2036 ^			
Vertiv Group Corp. 4,125 % fällig am 15.11.2028	7.000	6.313	0,32	CrownRock LP 5,000 % fällig am 01.05.2029	2.000	1.876	0,09				
ViaSat, Inc. 5,625 % fällig am 15.09.2025	2.500	2.425	0,12	5,625 % fällig am 15.10.2025	3.000	2.959	0,15	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
6,500 % fällig am 15.07.2028	2.000	1.697	0,09	Endeavor Energy Resources LP 5,750 % fällig am 30.01.2028	5.000	4.895	0,25	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust	77	24	0,00
Viking Cruises Ltd. 5,875 % fällig am 15.09.2027	5.000	4.601	0,23	Genesis Energy LP 6,500 % fällig am 01.10.2025	2.000	1.972	0,10	2,959 % fällig am 25.01.2037 ^			
7,000 % fällig am 15.02.2029	4.000	3.724	0,19	7,750 % fällig am 01.02.2028	1.000	952	0,05				
9,125 % fällig am 15.07.2031	3.000	3.033	0,15	8,000 % fällig am 15.01.2027	2.000	1.952	0,10	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)	167.378	229	0,01
Virgin Media Secured Finance PLC 4,500 % fällig am 15.08.2030	5.000	4.196	0,21	High Ridge Brands Co. 8,875 % fällig am 15.03.2025	2.500	41	0,00	iHeartMedia, Inc. 'A' (c)	38.621	141	0,01
5,500 % fällig am 15.05.2029	4.000	3.622	0,18	Lumen Technologies, Inc. 4,500 % fällig am 15.01.2029	3.000	1.443	0,07	iHeartMedia, Inc. 'B' (c)	29.972	98	0,00
Vmed O2 UK Financing PLC 4,250 % fällig am 31.01.2031	5.000	4.047	0,20	NGL Energy Operating LLC 7,500 % fällig am 01.02.2026	4.575	4.511	0,23	Intelsat Emergency S.A. (c)(i)	152.075	3.498	0,18
VOC Escrow Ltd. 5,000 % fällig am 15.02.2028	2.000	1.837	0,09	NRG Energy, Inc. 3,375 % fällig am 15.02.2029	2.000	1.638	0,08				
WESCO Distribution, Inc. 7,125 % fällig am 15.06.2025	3.000	3.034	0,15	5,250 % fällig am 15.06.2029	1.250	1.119	0,06				
7,250 % fällig am 15.06.2028	4.000	4.084	0,21	6,625 % fällig am 15.01.2027	838	833	0,04	<b>ENERGIE</b>			
White Cap Buyer LLC 6,875 % fällig am 15.10.2028	7.200	6.535	0,33	NSG Holdings LLC 7,750 % fällig am 15.12.2025	500	498	0,03	CHC Group LLC (c)	3.887	0	0,00
White Cap Parent LLC (8,250 % bar oder 9,000 % PIK) 8,250 % fällig am 15.03.2026	5.250	5.035	0,25	Tallgrass Energy Partners LP 5,500 % fällig am 15.01.2028	1.750	1.602	0,08	<b>FINANZWERTE</b>			
(b)				6,000 % fällig am 31.12.2030	2.000	1.764	0,09	DB Investors, Inc. (c)(i)	30	0	0,00
Williams Scotsman International, Inc. 4,625 % fällig am 15.08.2028	2.750	2.517	0,13	7,500 % fällig am 01.10.2025	1.000	999	0,05	Voyager Aviation Holdings LLC (c)	833	0	0,00
6,125 % fällig am 15.06.2025	1.000	994	0,05	Telecom Italia Capital S.A. 6,375 % fällig am 15.11.2033	2.500	2.123	0,11				
WMG Acquisition Corp. 3,000 % fällig am 15.02.2031	3.250	2.632	0,13	7,200 % fällig am 18.07.2036	1.500	1.291	0,07	<b>OPTIONSSCHEINE</b>			
3,875 % fällig am 15.07.2030	3.000	2.591	0,13	TerraForm Power Operating LLC 4,750 % fällig am 15.01.2030	2.000	1.767	0,09	DB Investors, Inc. - Exp. 28.06.2069 (i)	113	0	0,00
WR Grace Holdings LLC 4,875 % fällig am 15.06.2027	3.000	2.786	0,14	5,000 % fällig am 31.01.2028	2.000	1.843	0,09	Revlon Group Holdings LLC - 28.04.2028	30.870	93	0,00
5,625 % fällig am 15.08.2029	3.000	2.461	0,12	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		1.588.798	80,34				
WW International, Inc. 4,500 % fällig am 15.04.2029	2.000	1.184	0,06	<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>			
Wyndham Hotels & Resorts, Inc. 4,375 % fällig am 15.08.2028	3.000	2.742	0,14	U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 31.08.2027	25.000	23.914	1,21	Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	5.000	1.205	0,06
Wynn Las Vegas LLC 5,250 % fällig am 15.05.2027	3.000	2.845	0,14	3,500 % fällig am 15.09.2025	40.000	38.926	1,97				
5,500 % fällig am 01.03.2025	3.000	2.955	0,15	3,500 % fällig am 31.01.2028	25.000	24.280	1,23	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 01.10.2027	2.000	1.782	0,09	3,875 % fällig am 30.11.2027	35.000	34.510	1,74	<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
Wynn Resorts Finance LLC 5,125 % fällig am 01.10.2029	3.000	2.692	0,14	3,875 % fällig am 31.12.2027	10.000	9.861	0,50	U.S. Treasury Bills 5,150 % fällig am 03.08.2023 (d)(e)	\$ 54.900	54.658	2,76
XPO, Inc. 7,125 % fällig am 01.06.2031	2.000	2.018	0,10	4,125 % fällig am 30.09.2027	25.000	24.865	1,26	Summe kurzfristige Instrumente		54.658	2,76
Yum! Brands, Inc. 3,625 % fällig am 15.03.2031	2.000	1.730	0,09	4,250 % fällig am 15.10.2025	50.000	49.449	2,50	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	1.868.312	94,47
						205.805	10,41				
				<b>NON-AGENCY-MBS</b>							
				Banc of America Funding Trust 4,123 % fällig am 20.02.2036 ^	69	63	0,00				

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)	661.211	\$ 6.011	0,30
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	6.209.417	61.833	3,13
		67.844	3,43
Summe Investmentfonds		\$ 67.844	3,43

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 10.034	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	\$ (10.235)	\$ 10.034	\$ 10.034	0,51
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (10.235)	\$ 10.034	\$ 10.034	0,51

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Newell Brands, Inc.	1,000 %	20.06.2028	\$ 2.275	\$ 20	0,00

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000 %	20.06.2028	\$ 168.200	\$ 2.781	0,14
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ 2.801	0,14

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	\$ 42.372	€ 38.671	\$ 0	\$ (182)	\$ (182)	(0,01)
	08.2023	€ 38.671	\$ 42.431	184	0	184	0,01
CBK	08.2023	CAD 872	€ 654	0	(5)	(5)	0,00
JPM	08.2023	1.433	1.072	0	(12)	(12)	0,00
MBC	07.2023	£ 3.451	4.272	0	(116)	(116)	(0,01)
MYI	07.2023	€ 70	€ 77	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 560	€ 514	1	0	1	0,00
	07.2023	€ 40	£ 32	0	0	0	0,00
SOG	07.2023	€ 38.671	\$ 41.600	0	(590)	(590)	(0,03)
TOR	07.2023	\$ 4.385	£ 3.451	2	0	2	0,00
	08.2023	£ 3.451	\$ 4.386	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 187	\$ (907)	\$ (720)	(0,04)

## Aufstellung des Wertpapierbestands des US High Yield Bond Fund (Fort.)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Wertzunahme (Wertabnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 1.865	\$ 2.038	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07.2023	\$ 116.442	€ 108.348	1.765	0	1.765	0,09
BPS	07.2023	€ 108.799	\$ 119.208	509	(1)	508	0,03
	07.2023	\$ 116.330	€ 108.209	1.729	(2)	1.727	0,09
	08.2023	118.571	108.063	0	(512)	(512)	(0,03)
CBK	07.2023	€ 110.393	\$ 119.976	0	(463)	(463)	(0,02)
	08.2023	\$ 116.082	€ 106.621	401	0	401	0,02
JPM	07.2023	€ 108.288	\$ 118.240	97	0	97	0,00
	07.2023	\$ 5.288	€ 4.945	108	0	108	0,01
	08.2023	118.405	108.288	0	(101)	(101)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 749	\$ 803	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	\$ 44	€ 41	1	0	1	0,00
SOG	07.2023	116.237	108.053	1.649	0	1.649	0,08
				\$ 6.262	\$ (1.094)	\$ 5.168	0,26

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 20	\$ 25	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 15	£ 12	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	£ 26	\$ 32	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	\$ 19.820	£ 15.999	526	(7)	519	0,03
BRC	07.2023	307	248	8	0	8	0,00
CBK	07.2023	£ 52	\$ 66	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	15.673	19.818	0	(109)	(109)	(0,01)
	08.2023	\$ 19.822	£ 15.673	109	0	109	0,01
MBC	07.2023	18.966	15.320	511	0	511	0,03
MYI	07.2023	18.858	15.173	432	0	432	0,02
TOR	07.2023	£ 15.694	\$ 19.942	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	\$ 19.947	£ 15.694	10	0	10	0,00
				\$ 1.596	\$ (127)	\$ 1.469	0,08

Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 5.917	0,30
Summe Anlagen						\$ 1.954.908	98,85
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 22.693	1,15
Nettovermögen						\$ 1.977.601	100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,39 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
DB Investors, Inc.	18.02.2015	\$ 0	\$ 0	0,00
DB Investors, Inc. - Exp. 28.06.2069	18.02.2015	0	0	0,00
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % Cash or 9,000 % PIK) 9,000 % fällig am 22.04.2027	12.05.2021	115	111	0,01
Intelsat Emergence S.A.	11.02.2014 - 02.03.2022	15.552	3.498	0,18
		\$ 15.667	\$ 3.609	0,19

(j) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 11.276 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 503 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 17.435 USD (31. Dezember 2022: 10.449 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

#### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 370	\$ 1.862.780	\$ 5.162	\$ 1.868.312
Investmentfonds	67.844	0	0	67.844
Pensionsgeschäfte	0	10.034	0	10.034
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	8.718	0	8.718
<b>Summen</b>	<b>\$ 68.214</b>	<b>\$ 1.881.532</b>	<b>\$ 5.162</b>	<b>\$ 1.954.908</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 413	\$ 1.889.527	\$ 5.525	\$ 1.895.465
Investmentfonds	39.162	0	0	39.162
Pensionsgeschäfte	0	9.269	0	9.269
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	11.167	0	11.167
<b>Summen</b>	<b>\$ 39.575</b>	<b>\$ 1.909.963</b>	<b>\$ 5.525</b>	<b>\$ 1.955.063</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	(1,250) %	28.06.2023	07.07.2023	\$ (2.784)	\$ (2.784)	(0,14)
	(0,750)	28.06.2023	07.07.2023	(355)	(355)	(0,02)
BRC	(1,900)	05.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	(1.745)	(1.740)	(0,09)
MYI	2,500	17.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	€ (968)	(1.060)	(0,05)
RDR	4,000	05.05.2023	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (3.525)	(3.547)	(0,18)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (9.486)</b>	<b>(0,48)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 1.768	\$ (1.368)	\$ 400	\$ 9	\$ 0	\$ 9
BPS	2.243	(1.870)	373	k. A.	k. A.	k. A.
BRC	8	0	8	1	0	1
CBK	(67)	0	(67)	3.592	(3.540)	52
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
JPM	92	0	92	(258)	0	(258)
MBC	381	(360)	21	1.402	(1.320)	82
MYI	433	(405)	28	(4)	0	(4)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	3.187	(3.050)	137
SOG	1.059	(790)	269	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	11	(20)	(9)
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	38,68	39,23
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	55,72	56,03
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,07	0,24
Investmentfonds	3,43	1,97
Pensionsgeschäfte	0,51	0,47
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,14	0,16
Freiverkehrsfinanzderivate	0,30	0,40
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,48)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

<b>Anlagen zum Marktwert</b>	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,65	0,70
Unternehmensanleihen und Wechsel	80,34	79,60
US-Schatzobligationen	10,41	11,62
Non-Agency-MBS	0,04	0,04
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,00	0,00
Stammaktien	0,20	0,21
Bezugsrechte	0,01	0,01
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,06	0,07
Kurzfristige Instrumente	2,76	3,25
Investmentfonds	3,43	1,97
Pensionsgeschäfte	0,51	0,47
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,14	0,16
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	(0,04)	(0,05)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,34	0,45
Sonstige Aktiva und Passiva	1,15	1,50
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
Charles Schwab Corp. 5,643 % fällig am 19.05.2029				\$ 800	\$ 800	0,18		2,357 % fällig am 18.08.2031	\$ 1.600	\$ 1.278	0,29
Citigroup, Inc. 2,976 % fällig am 05.11.2030				1.600	1.388	0,31		4,292 % fällig am 12.09.2026	1.000	962	0,22
3,785 % fällig am 17.03.2033 (h)				200	177	0,04		4,583 % fällig am 19.06.2029	400	377	0,08
4,075 % fällig am 23.04.2029				400	377	0,08		5,402 % fällig am 11.08.2033	900	880	0,20
6,270 % fällig am 17.11.2033 (h)				2.000	2.124	0,48		6,500 % fällig am 15.09.2037	100	100	0,02
Citizens Bank N.A. 5,284 % fällig am 26.01.2026				500	464	0,10		6,800 % fällig am 01.06.2038	220	222	0,05
Commonwealth Bank of Australia 3,784 % fällig am 14.03.2032 (g)				400	336	0,08		Hudson Pacific Properties LP 4,650 % fällig am 01.04.2029	100	71	0,02
Cooperative Rabobank UA 4,655 % fällig am 22.08.2028				400	383	0,09		5,950 % fällig am 15.02.2028	300	239	0,05
Corebridge Financial, Inc. 3,850 % fällig am 05.04.2029				900	811	0,18		Invitation Homes Operating Partnership LP 2,300 % fällig am 15.11.2028	1.300	1.107	0,25
Corporate Office Properties LP 2,250 % fällig am 15.03.2026				300	266	0,06		JAB Holdings BV 2,200 % fällig am 23.11.2030	1.600	1.260	0,28
2,750 % fällig am 15.04.2031				1.400	1.065	0,24		JPMorgan Chase & Co. 2,182 % fällig am 01.06.2028	700	623	0,14
Credit Suisse AG 7,500 % fällig am 15.02.2028				700	744	0,17		2,545 % fällig am 08.11.2032	900	738	0,17
Crown Castle, Inc. 2,100 % fällig am 01.04.2031				500	400	0,09		2,580 % fällig am 22.04.2032	5.100	4.238	0,95
3,100 % fällig am 15.11.2029				900	785	0,18		3,509 % fällig am 23.01.2029	1.105	1.022	0,23
4,300 % fällig am 15.02.2029				600	565	0,13		3,782 % fällig am 01.02.2028	40	38	0,01
CubeSmart LP 3,125 % fällig am 01.09.2026				600	553	0,12		4,000 % fällig am 01.04.2025 (e)	2.900	2.636	0,59
Deutsche Bank AG 2,222 % fällig am 18.09.2024				1.000	987	0,22		5,350 % fällig am 01.06.2034	400	403	0,09
EPR Properties 4,500 % fällig am 01.06.2027				450	404	0,09		Kilroy Realty LP 3,050 % fällig am 15.02.2030	1.800	1.410	0,32
4,750 % fällig am 15.12.2026				100	91	0,02		KKR Group Finance Co. LLC 3,625 % fällig am 25.02.2050	1.100	758	0,17
4,950 % fällig am 15.04.2028				400	358	0,08		Lazard Group LLC 3,625 % fällig am 01.03.2027	100	93	0,02
Equitable Holdings, Inc. 5,594 % fällig am 11.01.2033				200	196	0,04		4,500 % fällig am 19.09.2028	200	190	0,04
ERP Operating LP 3,250 % fällig am 01.08.2027				100	92	0,02		Legg Mason, Inc. 5,625 % fällig am 15.01.2044	200	197	0,04
Extra Space Storage LP 2,350 % fällig am 15.03.2032				400	313	0,07		Life Storage LP 3,875 % fällig am 15.12.2027	800	744	0,17
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028				€ 200	197	0,04		Lloyds Bank PLC 0,000 % fällig am 02.04.2032	200	125	0,03
4,625 % fällig am 29.04.2030				\$ 1.400	1.313	0,30		Mid-America Apartments LP 1,100 % fällig am 15.09.2026	1.200	1.048	0,24
4,850 % fällig am 17.04.2028				300	289	0,06		Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,309 % fällig am 20.07.2032	2.000	1.593	0,36
Federal Realty OP LP 3,500 % fällig am 01.06.2030				400	349	0,08		5,133 % fällig am 20.07.2033	900	883	0,20
Fifth Third Bancorp 4,772 % fällig am 28.07.2030				800	748	0,17		5,406 % fällig am 19.04.2034	500	496	0,11
Gaci First Investment Co. 5,125 % fällig am 14.02.2053				600	541	0,12		5,441 % fällig am 22.02.2034	300	299	0,07
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd. 3,400 % fällig am 30.09.2026				500	464	0,10		Mizuho Financial Group, Inc. 3,153 % fällig am 16.07.2030	1.873	1.618	0,36
Global Atlantic Fin Co. 3,125 % fällig am 15.06.2031				200	151	0,03		6,123 % fällig am 08.09.2024	1.600	1.601	0,36
4,400 % fällig am 15.10.2029				800	675	0,15		Morgan Stanley 4,889 % fällig am 20.07.2033	1.400	1.348	0,30
GLP Capital LP 3,350 % fällig am 01.09.2024				700	676	0,15		5,250 % fällig am 21.04.2034	3.600	3.557	0,80
4,000 % fällig am 15.01.2031				300	260	0,06		Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 20.06.2028	200	193	0,04
5,750 % fällig am 01.06.2028				700	685	0,15		Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023	426	423	0,09
Goldman Sachs Group, Inc. 2,383 % fällig am 21.07.2032				1.500	1.202	0,27		Nasdaq, Inc. 5,550 % fällig am 15.02.2034	400	402	0,09
2,615 % fällig am 22.04.2032				1.000	820	0,18		NatWest Group PLC 4,892 % fällig am 18.05.2029	1.700	1.619	0,36
3,691 % fällig am 05.06.2028				655	616	0,14		Neuberger Berman Group LLC 4,500 % fällig am 15.03.2027	1.000	944	0,21
Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % fällig am 15.03.2028				1.100	998	0,22		Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,750 % fällig am 09.03.2028	1.900	1.563	0,35
Great-West Lifeco Finance LP 4,581 % fällig am 17.05.2048				300	256	0,06		Nomura Holdings, Inc. 2,679 % fällig am 16.07.2030	1.300	1.065	0,24
Hanover Insurance Group, Inc. 4,500 % fällig am 15.04.2026				800	775	0,17		5,386 % fällig am 06.07.2027	2.100	2.062	0,46
Highwoods Realty LP 4,125 % fällig am 15.03.2028				500	438	0,10		Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 9.261	1.011	0,23
4,200 % fällig am 15.04.2029				200	169	0,04		Omega Healthcare Investors, Inc. 4,750 % fällig am 15.01.2028	\$ 1.200	1.097	0,25
Host Hotels & Resorts LP 3,500 % fällig am 15.09.2030				1.300	1.103	0,25		Owl Rock Capital Corp. 2,875 % fällig am 11.06.2028	300	245	0,06
4,000 % fällig am 15.06.2025				1.233	1.186	0,27		Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,800 % fällig am 23.06.2030	300	265	0,06
HSBC Capital Funding Dollar LP 10,176 % fällig am 30.06.2030 (e)				400	496	0,11		Physicians Realty LP 4,300 % fällig am 15.03.2027	300	283	0,06
HSBC Holdings PLC 2,099 % fällig am 04.06.2026				900	833	0,19		Sagax AB 2,250 % fällig am 13.03.2025	€ 300	309	0,07
								Santander Holdings USA, Inc. 2,490 % fällig am 06.01.2028	\$ 700	605	0,14
								4,400 % fällig am 13.07.2027	400	376	0,08

# Aufstellung des Wertpapierbestands des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
6,499 % fällig am 09.03.2029	\$ 600	\$ 594	0,13	4,800 % fällig am 15.02.2029	\$ 643	\$ 619	0,14	5,125 % fällig am 21.02.2030	\$ 1.500	\$ 1.491	0,34
Santander UK Group Holdings PLC	1.700	1.515	0,34	Alcon Finance Corp.	500	427	0,10	CVS Pass-Through Trust	36	35	0,01
1,532 % fällig am 21.08.2026				2,600 % fällig am 27.05.2030				5,789 % fällig am 10.01.2026	132	131	0,03
SBA Tower Trust	1.000	899	0,20	Alliegon U.S. Holding Co., Inc.	1.100	1.018	0,23	6,036 % fällig am 10.12.2028			
1,884 % fällig am 15.07.2050				3,550 % fällig am 01.10.2027				DAE Funding LLC	700	675	0,15
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.	2.100	126	0,03	Amdocs Ltd.	1.600	1.337	0,30	1,625 % fällig am 15.02.2024			
5,125 % fällig am 29.10.2022 ^				2,538 % fällig am 15.06.2030				Dell International LLC	1.050	1.068	0,24
5,250 % fällig am 23.05.2023	600	36	0,01	American Airlines Pass-Through Trust	627	563	0,13	6,020 % fällig am 15.06.2026	900	936	0,21
^(g)				3,200 % fällig am 15.12.2029				2,000 % fällig am 10.12.2029	903	795	0,18
SBL Holdings, Inc.	1.000	884	0,20	3,250 % fällig am 15.04.2030				Delta Air Lines Pass-Through Trust			
5,125 % fällig am 13.11.2026				3,375 % fällig am 01.11.2028				2,000 % fällig am 10.12.2029	1.100	998	0,22
SELP Finance SARL	€ 300	307	0,07	3,500 % fällig am 15.08.2033				Directv Financing LLC			
3,750 % fällig am 10.08.2027				3,575 % fällig am 15.07.2029				5,875 % fällig am 15.08.2027	2.300	1.701	0,38
SMBC Aviation Capital Finance DAC	\$ 1.100	1.077	0,24	3,600 % fällig am 15.04.2031				Eastern Gas Transmission & Storage, Inc.			
3,550 % fällig am 15.04.2024				4,000 % fällig am 15.01.2027				3,900 % fällig am 15.11.2049			
Societe Generale S.A.	200	204	0,05	Amgen, Inc.	3.075	3.086	0,69	Ecopetrol S.A.	300	297	0,07
6,691 % fällig am 10.01.2034				5,600 % fällig am 02.03.2043				8,875 % fällig am 13.01.2033	700	421	0,09
6,750 % fällig am 06.04.2028	400	325	0,07	Apple, Inc.	2.100	2.154	0,48	eHi Car Services Ltd.			
(e)(g)				4,850 % fällig am 10.05.2053				7,000 % fällig am 21.09.2026			
7,375 % fällig am 04.10.2023	300	292	0,07	ArcelorMittal S.A.	1.000	1.027	0,23	Elevance Health, Inc.	1.800	1.749	0,39
(e)(g)				6,800 % fällig am 29.11.2032				4,750 % fällig am 15.02.2033			
Spirit Realty LP	100	82	0,02	Ashtead Capital, Inc.	400	371	0,08	Energy Transfer LP	1.400	1.339	0,30
3,200 % fällig am 15.02.2031				4,000 % fällig am 01.05.2028				4,400 % fällig am 15.03.2027	1.000	1.008	0,23
4,000 % fällig am 15.07.2029	200	176	0,04	AstraZeneca PLC	500	483	0,11	5,750 % fällig am 15.02.2033	100	94	0,02
Standard Chartered PLC	200	158	0,04	4,000 % fällig am 17.01.2029				5,950 % fällig am 01.10.2043	100	101	0,02
3,265 % fällig am 18.02.2036	250	251	0,06	Bacardi Ltd.	1.100	1.092	0,25	6,500 % fällig am 01.02.2042			
6,296 % fällig am 06.07.2034 (a)	1.000	1.006	0,23	5,250 % fällig am 15.01.2029				EnLink Midstream LLC	700	700	0,16
6,301 % fällig am 09.01.2029				BAE Systems PLC	200	181	0,04	6,500 % fällig am 01.09.2030			
Stifel Financial Corp.	600	513	0,12	3,400 % fällig am 15.04.2030				Enterprise Products Operating LLC	300	305	0,07
4,000 % fällig am 15.05.2030				Baptist Healthcare System Obligated Group	300	222	0,05	5,700 % fällig am 15.02.2042			
STORE Capital Corp.	200	175	0,04	3,540 % fällig am 15.08.2050				Equifax, Inc.	500	493	0,11
4,500 % fällig am 15.03.2028				BAT International Finance PLC	600	540	0,12	5,100 % fällig am 01.06.2028	1.000	930	0,21
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	1.100	1.011	0,23	1,668 % fällig am 25.03.2026				ERAC USA Finance LLC	300	300	0,07
1,474 % fällig am 08.07.2025	700	612	0,14	Bayer U.S. Finance LLC	1.100	1.062	0,24	3,300 % fällig am 01.12.2026	1.300	1.282	0,29
3,202 % fällig am 17.09.2029 (g)	1.100	1.114	0,25	4,250 % fällig am 15.12.2025				Expedia Group, Inc.			
5,710 % fällig am 13.01.2030				6,562 % fällig am 15.12.2023				5,000 % fällig am 15.02.2026			
Synchrony Financial	1.200	1.082	0,24	Berry Global, Inc.	1.500	1.353	0,30	Ferguson Finance PLC	300	261	0,06
7,250 % fällig am 02.02.2033				1,570 % fällig am 15.01.2026				3,250 % fällig am 02.06.2030			
Toyota Motor Credit Corp.	900	893	0,20	Boardwalk Pipelines LP	500	431	0,10	Flex Ltd.	300	293	0,07
4,625 % fällig am 12.01.2028				Boeing Co.	700	694	0,16	4,750 % fällig am 15.06.2025			
TP ICAP Finance PLC	€ 400	469	0,11	5,930 % fällig am 01.05.2060				Glencore Funding LLC	100	99	0,02
5,250 % fällig am 29.05.2026				British Airways Pass-Through Trust	274	244	0,05	5,400 % fällig am 08.05.2028	600	509	0,11
UBS Group AG	\$ 400	381	0,09	4,125 % fällig am 20.03.2033				Global Payments, Inc.			
2,593 % fällig am 11.09.2025	900	759	0,17	4,250 % fällig am 15.05.2034				2,900 % fällig am 15.05.2030	110	126	0,03
3,126 % fällig am 13.08.2030	1.250	1.156	0,26	Broadcom, Inc.	569	467	0,11	Greene King Finance PLC	\$ 300	307	0,07
4,282 % fällig am 09.01.2028	1.400	1.394	0,31	3,469 % fällig am 15.04.2034				Greensaf Pipelines Bidco SARL			
5,959 % fällig am 12.01.2034	2.750	2.819	0,63	Burlington Northern Santa Fe LLC	100	102	0,02	6,129 % fällig am 23.02.2038	2.400	2.182	0,49
6,537 % fällig am 12.08.2033				5,200 % fällig am 15.04.2054				Haleon U.S. Capital LLC	700	485	0,11
UDR, Inc.	300	239	0,05	Caesars Entertainment, Inc.	400	402	0,09	3,375 % fällig am 24.03.2029	900	899	0,20
3,100 % fällig am 01.11.2034	300	275	0,06	7,000 % fällig am 15.02.2030				HCA, Inc.	600	568	0,13
3,500 % fällig am 15.01.2028				Cameron LNG LLC	1.400	1.169	0,26	3,500 % fällig am 15.07.2051			
VICI Properties LP	300	264	0,06	3,302 % fällig am 15.01.2035				5,500 % fällig am 01.06.2033			
3,875 % fällig am 15.02.2029	100	92	0,02	Canadian Pacific Railway Co.	300	281	0,06	Health & Happiness International Holdings Ltd.	600	600	0,13
4,500 % fällig am 15.01.2028	600	562	0,13	3,125 % fällig am 01.06.2026				13,500 % fällig am 26.06.2026			
5,125 % fällig am 15.05.2032	100	98	0,02	CDW LLC	700	592	0,13	Howard Midstream Energy Partners LLC	200	201	0,05
5,750 % fällig am 01.02.2027				4,125 % fällig am 20.03.2033				8,875 % fällig am 15.07.2028 (a)			
Vonovia SE	€ 1.200	1.155	0,26	4,250 % fällig am 15.05.2034				Humana, Inc.	800	832	0,19
0,000 % fällig am 01.12.2025 (c)				3,569 % fällig am 01.12.2031				5,875 % fällig am 01.03.2033	1.600	1.346	0,30
Wells Fargo & Co.	\$ 800	713	0,16	Centene Corp.	1.100	941	0,21	Hyundai Capital America			
2,393 % fällig am 02.06.2028	4.400	4.134	0,93	2,450 % fällig am 15.07.2028				2,000 % fällig am 15.06.2028			
3,196 % fällig am 17.06.2027	2.100	2.015	0,45	Charter Communications Operating LLC	1.300	1.219	0,27	Illumina, Inc.	900	905	0,20
4,897 % fällig am 25.07.2033				4,200 % fällig am 15.03.2028				5,750 % fällig am 13.12.2027			
Weyerhaeuser Co.	1.300	1.197	0,27	Cheniery Energy Partners LP	400	330	0,07	Imperial Brands Finance PLC	1.500	1.323	0,30
4,000 % fällig am 15.04.2030	600	590	0,13	3,250 % fällig am 31.01.2032				3,875 % fällig am 26.07.2029	500	480	0,11
4,750 % fällig am 15.05.2026	343	383	0,09	4,000 % fällig am 01.03.2031				4,250 % fällig am 21.07.2025			
7,375 % fällig am 15.03.2032				5,950 % fällig am 30.06.2033				Incitec Pivot Finance LLC	500	469	0,11
		144.901	32,58	Cloud Software Group, Inc.	100	89	0,02	3,950 % fällig am 03.08.2027			
				6,500 % fällig am 31.03.2029				Infor, Inc.	600	548	0,12
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Comcast Corp.	500	507	0,11	Intel Corp.	1.200	1.212	0,27
AbbVie, Inc.	200	173	0,04	5,500 % fällig am 15.05.2064				Jabil, Inc.	200	199	0,04
4,250 % fällig am 21.11.2049				Continental Airlines Pass-Through Trust	211	204	0,05	5,450 % fällig am 01.02.2029			
Adani Transmission Step-One Ltd.	400	350	0,08	4,000 % fällig am 29.04.2026				JetBlue Pass-Through Trust	252	215	0,05
4,000 % fällig am 03.08.2026				Continental Resources, Inc.	400	380	0,09	2,750 % fällig am 15.11.2033			
Adventist Health System	300	298	0,07	5,750 % fällig am 15.01.2031							
5,430 % fällig am 01.03.2032				CVS Health Corp.	900	759	0,17				
Air Canada Pass-Through Trust	770	683	0,15	4,125 % fällig am 01.04.2040							
3,300 % fällig am 15.07.2031	132	121	0,03								
3,750 % fällig am 15.06.2029	274	266	0,06								
5,250 % fällig am 01.10.2030											
Alaska Airlines Pass-Through Trust											





# Aufstellung des Wertpapierbestands des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
3,000 % fällig am 15.06.2028	\$ 900	\$ 777	0,17	<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				<b>STAMMAKTIVEN</b>			
3,150 % fällig am 01.01.2026	700	650	0,15	U.S. Treasury Bonds				<b>FINANZWERTE</b>			
3,750 % fällig am 01.07.2028	300	269	0,06	3,875 % fällig am 15.02.2043	\$ 3.600	\$ 3.511	0,79	Stearns Holdings LLC 'B' (b)	14.062	\$ 0	0,00
4,250 % fällig am 15.03.2046 ^	1.100	784	0,18	4,000 % fällig am 15.11.2042	10.700	10.637	2,39	<b>OPTIONSSCHEINE</b>			
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	100	71	0,02	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31.12.2060	68	0	0,00
6,750 % fällig am 15.01.2053	400	395	0,09	0,750 % fällig am 15.02.2045	773	639	0,14	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>			
PECO Energy Co.				1,500 % fällig am 15.02.2053	3.459	3.362	0,76	Wells Fargo & Co. 4,250 % fällig am 15.09.2026 (e)	40.800	696	0,16
3,000 % fällig am 15.09.2049	100	70	0,02	U.S. Treasury Notes				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
PPL Electric Utilities Corp. 5,000 % fällig am 15.05.2033	300	300	0,07	2,750 % fällig am 15.08.2032	1.900	1.742	0,39	<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
Progress Energy, Inc. 7,750 % fällig am 01.03.2031	204	231	0,05	2,875 % fällig am 15.05.2032	3.401	3.154	0,71	AT&T, Inc. 5,700 % fällig am 19.03.2024	\$ 2.300	2.202	0,49
San Diego Gas & Electric Co. 5,350 % fällig am 01.04.2053	1.100	1.092	0,25	3,375 % fällig am 15.05.2033	7.700	7.427	1,67	Dominion Resources, Inc. 5,490 % fällig am 10.07.2023	1.700	1.698	0,38
SCE Recovery Funding LLC 5,112 % fällig am 14.12.2049	200	198	0,04	3,500 % fällig am 15.02.2033	4.400	4.286	0,96	5,520 % fällig am 18.08.2023	300	298	0,07
Southern California Edison Co. 2,850 % fällig am 01.08.2029	800	700	0,16	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Electricite de France S.A. 5,510 % fällig am 04.08.2023	800	796	0,18
3,900 % fällig am 01.12.2041	108	85	0,02	Barclays Commercial Mortgage Securities Trust 6,193 % fällig am 15.10.2037	260	254	0,06	Enbridge, Inc. 5,400 % fällig am 12.07.2023	1.200	1.198	0,27
4,200 % fällig am 01.03.2029	200	190	0,04	CityLine Commercial Mortgage Trust 2,871 % fällig am 10.11.2031	1.000	933	0,21	Humana, Inc. 5,450 % fällig am 10.07.2023	1.800	1.797	0,40
5,300 % fällig am 01.03.2028	700	701	0,16	Countrywide Alternative Loan Trust 5,326 % fällig am 25.08.2035 ^	33	26	0,01	J.M. Smucker Co. 5,450 % fällig am 12.07.2023	300	299	0,07
6,650 % fällig am 01.04.2029	2.035	2.109	0,47	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 5,590 % fällig am 25.11.2034	155	146	0,03	Keurig Dr Pepper, Inc. 5,350 % fällig am 20.07.2023	500	498	0,11
Southern California Gas Co. 5,200 % fällig am 01.06.2033	1.300	1.283	0,29	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Mondelez International, Inc. 5,370 % fällig am 25.07.2023	500	498	0,11
Southern Co. Gas Capital Corp. 3,250 % fällig am 15.06.2026	2.700	2.546	0,57	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 6,080 % fällig am 25.02.2036 ^	206	187	0,04	Walgreens Boots Alliance 6,000 % fällig am 06.07.2023	1.500	1.499	0,34
Southwest Gas Corp. 5,800 % fällig am 01.12.2027	1.000	1.011	0,23	Citigroup Mortgage Loan Trust 5,350 % fällig am 25.01.2037	1.111	476	0,11	Summe kurzfristige Instrumente		10.783	2,42
Southwestern Public Service Co. 3,750 % fällig am 15.06.2049	500	384	0,09	Ellington Loan Acquisition Trust 6,250 % fällig am 25.05.2037	193	185	0,04	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 384.707	86,49
Sprint LLC 7,875 % fällig am 15.09.2023	400	401	0,09	LCM LP 6,270 % fällig am 20.04.2031	1.100	1.088	0,25	<b>AKTIEN</b>			
System Energy Resources, Inc. 2,140 % fällig am 09.12.2025	800	726	0,16	Long Beach Mortgage Loan Trust 6,125 % fällig am 25.07.2034	912	884	0,20	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
6,000 % fällig am 15.04.2028	600	594	0,13	New Century Home Equity Loan Trust 5,855 % fällig am 25.02.2036	182	152	0,03	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Targa Resources Partners LP 5,500 % fällig am 01.03.2030	300	289	0,06	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	4.371.784	43.534	9,79
Transcanada Trust 5,300 % fällig am 15.03.2077	50	45	0,01	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,125 % fällig am 16.04.2030	600	557	0,13	Summe Investmentfonds		\$ 43.534	9,79
		40.037	9,00	Export-Import Bank of India 3,250 % fällig am 15.01.2030	400	353	0,08				
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		302.175	67,94	Italy Government International Bond 6,875 % fällig am 27.09.2023	600	601	0,13				
<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Romania Government International Bond 3,750 % fällig am 07.02.2034	€ 400	354	0,08				
Texas Natural Gas Securitization Finance Corp. Revenue Bonds, Series 2023 5,102 % fällig am 01.04.2035	600	603	0,13	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026 ZAR	62.900	3.458	0,78				
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>						5.323	1,20				
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.05.2052	886	782	0,18								
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2053	7.340	6.696	1,50								
4,000 % fällig am 01.07.2053	12.000	11.266	2,53								
4,500 % fällig am 01.07.2053	3.000	2.884	0,65								
5,000 % fällig am 01.09.2053	4.000	3.922	0,88								
		25.550	5,74								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
BPS	5,180 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 22.300	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.04.2025	\$ (22.755)	\$ 22.300	\$ 22.310	5,01
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	2.968	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(3.027)	2.968	2.968	0,67
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (25.782)</b>	<b>\$ 25.268</b>	<b>\$ 25.278</b>	<b>5,68</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	27	\$ (43)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	4	(7)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	9	12	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	8	(7)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	386	506	0,11
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	28	46	0,01
				\$ 507	0,11

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	\$ 111,500	21.07.2023	10	\$ (4)	\$ (4)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	10	(4)	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	3	(1)	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	3	(2)	(1)	0,00
				\$ (11)	\$ (5)	0,00
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>					\$ 502	0,11

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 200	\$ 0	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2026	\$ 500	(4)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	1,400	(14)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	1,100	5	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	900	(8)	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2023	€ 1,500	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	\$ 200	5	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	7	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	2,900	183	0,04
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 700	(3)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	400	(2)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	200	0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	300	4	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	1,100	3	0,00
Devon Energy Corp.	1,000	20.12.2026	\$ 800	9	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.12.2026	900	1	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	1,600	(2)	0,00
Expedia Group, Inc.	1,000	20.12.2026	300	0	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	1,300	(79)	(0,02)
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	500	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	300	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1,200	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	200	0	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	710	(57)	(0,01)
General Motors Co.	5,000	20.06.2028	890	19	0,01
Hess Corp.	1,000	20.12.2026	1,200	11	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2023	200	(4)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	1,400	(28)	(0,01)
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	1,000	20.12.2026	200	0	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 1,600	219	0,05
Southwest Airlines Co.	1,000	20.12.2026	\$ 550	7	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	€ 800	2	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	1,000	(12)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	2,400	22	0,01
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	500	2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 1,200	(19)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	1,800	(30)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	1,400	4	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	€ 200	(4)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	1,600	(25)	(0,01)
				\$ 229	0,05

# Aufstellung des Wertpapierbestands des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Fort.)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	\$ 100.700	\$ 712	0,16

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabel	Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		1,175 %	28.02.2052	£ 200	\$ (114)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		3,500	20.09.2033	600	49	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,300	20.03.2028	¥ 231.200	47	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		0,000	04.08.2023	\$ 25.000	345	0,08
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,270	04.11.2023	25.000	(86)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		0,000	04.08.2023	25.000	(343)	(0,08)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		7,195	25.04.2027	ZAR 22.300	52	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		7,300	28.04.2027	3.900	8	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,000	17.03.2053	€ 3.850	1.810	0,41
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,550	10.08.2024	1.600	(71)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	13.05.2027	3.300	(310)	(0,07)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	18.05.2027	1.400	(131)	(0,03)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		1,000	19.09.2023	HUF 115.000	(25)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		1,250	19.09.2023	352.100	(84)	(0,02)
						\$ 1.147	0,26
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 2.088</b>	<b>0,47</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## VERKAUFSOPTIEN

### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	500	\$ (2)	\$ (2)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	500	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	300	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	300	(2)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	200	(1)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	200	0	0	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	200	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	200	(1)	0	0,00
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	200	0	0	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	200	0	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	500	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
							\$ (28)	\$ (16)	(0,01)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	\$ 95.875	07.08.2023	600	\$ (4)	\$ (3)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	97.875	07.08.2023	600	(3)	(1)	0,00
					\$ (7)	\$ (4)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 100	\$ (4)	\$ 4	\$ 0	0,00
BRC	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20.12.2024	400	5	(2)	3	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	2.800	(41)	77	36	0,01
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2025	500	11	(5)	6	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	400	(2)	6	4	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	4	4	0,00
GLM	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	2.300	(26)	65	39	0,01
GST	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(2)	4	2	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	4	4	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	400	(9)	6	(3)	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	0	5	5	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.000	(62)	50	(12)	0,00
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20.06.2025	300	0	(2)	(2)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	200	1	1	2	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	400	(10)	10	0	0,00
					\$ (140)	\$ 229	\$ 89	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2023	\$ 100	\$ 12	\$ (9)	\$ 3	0,00
CBK	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	100	10	(8)	2	0,00
GST	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	400	48	(38)	10	0,01
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	300	33	(26)	7	0,00
					\$ 103	\$ (81)	\$ 22	0,01

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	449	\$ 298	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07.2023	\$	575	AUD 879	10	10	0,00
	08.2023		298		1	1	0,00
BOA	07.2023	DKK	1.999	\$ 289	(4)	(4)	0,00
	07.2023	¥	5.700	41	2	2	0,00
	07.2023	MXN	12.767	728	(15)	(15)	0,00
	07.2023	\$	1.172	AUD 1.806	31	31	0,01
	07.2023		533	DKK 3.625	0	(2)	0,00
	08.2023	DKK	3.619	\$ 533	2	2	0,00
	08.2023	\$	182	ZAR 3.322	0	(7)	0,00
	09.2023		175	IDR 2.623.448	0	(1)	0,00
BPS	07.2023	AUD	1.360	\$ 901	0	(4)	0,00
	07.2023	\$	4.338	¥ 603.008	0	(166)	(0,04)
	08.2023		902	AUD 1.360	4	4	0,00
	08.2023		2.486	MXN 43.281	17	17	0,00
	08.2023	ZAR	17.426	\$ 937	18	18	0,01
	09.2023	\$	164	IDR 2.458.019	0	0	0,00
	10.2023	ZAR	8.009	\$ 430	11	11	0,00
BRC	08.2023	\$	993	COP 4.231.838	8	8	0,00
	08.2023	ZAR	20.839	\$ 1.127	29	29	0,01
	09.2023	IDR	7.880	1	0	0	0,00
	09.2023	\$	216	PEN 792	1	1	0,00
BSH	07.2023		112	413	2	2	0,00
CBK	07.2023	€	2.242	\$ 2.406	0	(40)	(0,01)
	07.2023	\$	1.262	PEN 4.628	14	14	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Fort.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	PEN	\$	2.070	\$	(153)	(0,03)
	08.2023	\$	CLP	1.338.260	47	0	0,01
	08.2023	292	NOK	3.051	0	(7)	0,00
	09.2023	ZAR	\$	620	44	0	0,01
CLY	07.2023	DKK	\$	848	0	(13)	0,00
	08.2023	\$	NOK	3.460	0	(7)	0,00
GLM	07.2023	PEN	\$	898	0	(6)	0,00
	07.2023	\$	PEN	307	0	0	0,00
	08.2023	CLP	\$	1.623	0	(27)	(0,01)
	08.2023	\$	NOK	1.364	0	(1)	0,00
	08.2023	414	PEN	1.511	1	0	0,00
	08.2023	ZAR	\$	264	6	0	0,00
	09.2023	\$	PEN	2.398	5	0	0,00
JPM	07.2023	¥	\$	1.422	15	0	0,00
	07.2023	\$	£	796	6	0	0,00
	08.2023	£	\$	1.006	0	(6)	0,00
	08.2023	\$	¥	202.546	0	(15)	0,00
	08.2023	47	NOK	503	0	0	0,00
	09.2023	73	IDR	1.102.119	0	0	0,00
	09.2023	715	INR	58.889	1	0	0,00
	10.2023	432	MXN	7.579	2	0	0,00
MYI	07.2023	£	\$	1.028	0	(23)	(0,01)
	07.2023	IDR	\$	46	0	0	0,00
	07.2023	\$	DKK	3.233	0	0	0,00
	07.2023	307	£	243	2	0	0,00
	07.2023	46	IDR	691.578	0	0	0,00
	08.2023	CLP	\$	12	0	0	0,00
	08.2023	DKK	\$	474	0	0	0,00
	09.2023	\$	IDR	3.116.556	0	(2)	0,00
	09.2023	154	INR	12.720	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD	\$	438	0	(1)	0,00
	08.2023	\$	AUD	660	1	0	0,00
	09.2023	679	IDR	10.144.750	0	(5)	0,00
	09.2023	447	INR	36.830	0	0	0,00
	09.2023	350	PEN	1.290	4	0	0,00
SSB	09.2023	453	BRL	2.298	18	0	0,00
				\$	\$	\$	
				302	(506)	(204)	(0,05)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	\$	€	39.283	36.552	\$	596
BPS	07.2023	€	\$	33.544	36.754	157	0,04
	07.2023	\$	€	39.146	36.414	582	0,13
	08.2023	36.792	33.532	0	(159)	(159)	(0,04)
BRC	07.2023	€	\$	817	894	2	0,00
	07.2023	\$	€	747	697	13	0,00
CBK	07.2023	€	\$	36.100	39.220	0	(165)
	08.2023	\$	€	36.801	33.802	127	0,03
DUB	07.2023	€	\$	9.487	10.148	0	(204)
JPM	07.2023	33.820	36.928	30	0	30	0,01
	07.2023	\$	€	36.212	33.869	740	0,17
	08.2023	36.980	33.820	0	(31)	(31)	(0,01)
MYI	07.2023	€	\$	15	16	0	0,00
	07.2023	\$	€	566	516	0	(3)
SCX	07.2023	6.139	5.736	120	0	120	0,03
				\$	\$	\$	
				2.367	(562)	1.805	0,41

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	\$	45	58	\$	0
	07.2023	\$	£	248	196	1	0,00
BPS	07.2023	£	\$	4	5	0	0,00
	07.2023	\$	£	9.621	7.771	261	(2)
BRC	07.2023	£	\$	38	49	0	0
	07.2023	\$	£	392	311	3	0
CBK	07.2023	£	\$	21	17	0	0
JPM	07.2023	£	\$	7.758	9.809	0	(54)
	07.2023	\$	£	6	5	0	0
	08.2023	9.761	7.718	54	0	54	0,01

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
MYI	07.2023	£ 116	\$ 148	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00		
	07.2023	\$ 9.282	£ 7.468	212	0	212	0,05		
SCX	07.2023	£ 24	\$ 29	0	(1)	(1)	0,00		
	07.2023	\$ 9.419	£ 7.561	194	0	194	0,04		
						\$ 725	\$ (57)	\$ 668	0,15
<b>Summe Freiverkehrsfina n z d e r i v a t e</b>							\$ 2.360	0,53	
<b>Summe Anlagen</b>							\$ 458.459	103,07	
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>							\$ (13.666)	(3,07)	
<b>Nettovermögen</b>							\$ 444.793	100,00	

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend)\*:

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,92 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	3,785 %	17.03.2033	10.03.2022	\$ 200	\$ 177	0,04
Citigroup, Inc.	6,270	17.11.2033	09.11.2022	2.000	2.124	0,48
Oracle Corp.	6,250	09.11.2032	07.11.2022	998	1.062	0,24
				\$ 3.198	\$ 3.363	0,76

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 12.732 USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 11.254 USD (31. Dezember 2022: 11.785 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 350 USD (31. Dezember 2022: 830 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

#### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
	Übertragbare Wertpapiere	\$ 696	\$ 383.449	
Investmentfonds	43.534	0	0	43.534
Pensionsgeschäfte	0	25.268	0	25.268
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	6	4.944	0	4.950
<b>Summen</b>	<b>\$ 44.236</b>	<b>\$ 413.661</b>	<b>\$ 562</b>	<b>\$ 458.459</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
	Übertragbare Wertpapiere	\$ 672	\$ 345.328	
Investmentfonds	38.657	0	0	38.657
Pensionsgeschäfte	0	15.383	0	15.383
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	587	303	0	890
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(2.035)	0	(2.035)
<b>Summen</b>	<b>\$ 39.916</b>	<b>\$ 358.979</b>	<b>\$ 399</b>	<b>\$ 399.294</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.



Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 10	\$ 0	\$ 10	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	596	(570)	26	(108)	0	(108)
BPS	722	(670)	52	(856)	740	(116)
BRC	102	0	102	14	0	14
BSH	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(131)	0	(131)	988	(750)	238
CLY	(20)	0	(20)	(36)	0	(36)
DUB	(200)	260	60	(1)	0	(1)
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	8	0	8
GLM	15	0	15	138	0	138
GST	16	0	16	23	0	23
JPM	748	(620)	128	240	(170)	70
MYC	(12)	90	78	(71)	90	19
MYI	186	(30)	156	(5)	(10)	(15)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	294	0	294
SAL	(4)	0	(4)	(3)	0	(3)
SCX	312	(290)	22	979	(930)	49
SSB	18	0	18	45	0	45

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	60,96	59,33
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	25,53	29,34
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,48
Investmentfonds	9,79	9,95
Pensionsgeschäfte	5,68	3,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,11	0,18
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,47	(0,37)
Freiverkehrsfinaanzderivate	0,53	0,42
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,52)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(9,95)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,11	1,26
Unternehmensanleihen und Wechsel	67,94	67,65
Kommunalanleihen und Wechsel	0,13	k. A.
US-Regierungsbehörden	5,74	5,09
US-Schatzobligationen	7,81	8,62
Non-Agency-MBS	0,31	0,26
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,67	0,52
Staatsemissionen	1,20	2,12
Stammaktien	0,00	0,00
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,16	0,17
Kurzfristige Instrumente	2,42	3,46
Investmentfonds	9,79	9,95
Pensionsgeschäfte	5,68	3,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,11	0,18
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,05	(0,05)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,16	(0,03)
Zinsswaps	0,26	(0,29)
Freiverkehrsfinaanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,54
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,96)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,01	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,05)	(0,06)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,56	0,89
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,52)
Sonstige Aktiva und Passiva	(3,07)	(2,77)
Nettovermögen	100,00	100,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des US Short-Term Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>KATAR</b>				<b>Nationwide Building Society</b>				<b>Naviest Private Education Loan Trust</b>			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				0,550 % fällig am 22.01.2024				\$ 39 \$ 39 0,00			
Qatar National Bank QPSC				\$ 560	\$ 544	0,03		2,650 % fällig am 15.12.2028			
5,966 % fällig am 10.10.2023	\$ 900	\$ 900	0,04	10,535	10,514	0,51		5,913 % fällig am 15.12.2059	3,681	3,644	0,18
<b>SAUDI-ARABIEN</b>				<b>NatWest Group PLC</b>				<b>6,643 % fällig am 16.07.2040</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,269 % fällig am 22.03.2025				6,793 % fällig am 15.10.2031			
Saudi Arabian Oil Co.				5,000	4,913	0,24		7,343 % fällig am 15.12.2045	429	431	0,02
1,625 % fällig am 24.11.2025	2,200	2,013	0,10	<b>NatWest Markets PLC</b>				<b>Naviest Student Loan Trust</b>			
<b>SINGAPUR</b>				6,541 % fällig am 22.03.2025				6,893 % fällig am 15.11.2030			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,796 % fällig am 15.11.2024				5,750 % fällig am 27.02.2051			
Aviation Ltd.				2,800	2,779	0,13		<b>Nelnet Student Loan Trust</b>	968	956	0,05
6,667 % fällig am 26.09.2023	1,700	1,700	0,08	<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>				<b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>			
<b>SÜDKOREA</b>				6,021 % fällig am 23.11.2025				5,810 % fällig am 25.01.2036			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,832 % fällig am 30.03.2026				12,000			
<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				12,000				12,090			
<b>Korea Development Bank</b>				5,137 % fällig am 15.06.2044				101,369			
0,500 % fällig am 27.10.2023	500	491	0,03	<b>Great Hall Mortgages PLC</b>				4,91			
Summe Südkorea		17,034	0,83	5,172 % fällig am 18.06.2038							
<b>SPANIEN</b>				<b>Lanebrook Mortgage Transaction PLC</b>				<b>SBA Tower Trust</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,965 % fällig am 12.06.2057				3,869 % fällig am 15.10.2049			
Santander S.A.				3,490	4,443	0,21		<b>SLC Student Loan Trust</b>	835	830	0,04
3,892 % fällig am 24.05.2024	7,900	7,748	0,38	<b>Precise Mortgage Funding PLC</b>				5,842 % fällig am 15.06.2039			
5,770 % fällig am 30.06.2024	6,900	6,863	0,33	5,657 % fällig am 16.10.2056				5,882 % fällig am 15.06.2039			
Summe Spanien		14,611	0,71	6,004 % fällig am 12.03.2055				5,800 % fällig am 27.12.2038			
<b>FRANZÖSISCHES SAARLAND</b>				<b>Residential Mortgage Securities PLC</b>				<b>SLM Student Loan Trust</b>			
<b>IONISCHE BANK FÜR WIEDERAUFBAU UND ENTWICKLUNG</b>				6,159 % fällig am 20.06.2070				5,855 % fällig am 25.10.2029			
0,650 % fällig am 10.02.2026	10,000	9,021	0,44	5,765 % fällig am 12.03.2052				6,155 % fällig am 25.07.2023			
<b>SCHWEIZ</b>				<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>				<b>SMB Private Education Loan Trust</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,635 % fällig am 20.10.2051				5,943 % fällig am 15.10.2035			
Credit Suisse AG				5,841 % fällig am 20.07.2045				5,943 % fällig am 15.11.2035			
5,464 % fällig am 02.02.2024	2,000	1,985	0,10	5,792 % fällig am 25.09.2051				6,643 % fällig am 17.02.2032			
UBS AG				<b>Tudor Rose Mortgages</b>				<b>SoFi Professional Loan Program LLC</b>			
4,548 % fällig am 30.07.2025	AUD 7,225	4,791	0,23	5,509 % fällig am 20.06.2048				2,650 % fällig am 25.09.2040			
UBS Group AG				3,973				5,700 % fällig am 25.09.2034			
6,669 % fällig am 12.05.2026	\$ 15,000	15,078	0,73	5,023				1,660			
Summe Schweiz		21,854	1,06	69,736				1,547			
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				<b>USA</b>				<b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				6,875 % fällig am 25.11.2035			
First Abu Dhabi Bank PJSC				<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>				1,775			
5,019 % fällig am 18.02.2025	AUD 1,040	690	0,03	5,183 % fällig am 25.03.2034				1,748			
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>CIT Mortgage Loan Trust</b>				59,553			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,500 % fällig am 25.10.2037				2,88			
Barclays PLC				6,275 % fällig am 25.03.2035							
1,007 % fällig am 10.12.2024	\$ 3,000	2,925	0,14	<b>College Avenue Student Loans LLC</b>				<b>American Tower Corp.</b>			
3,932 % fällig am 07.05.2025	12,800	12,513	0,61	6,800 % fällig am 26.11.2046				3,375 % fällig am 15.05.2024			
6,467 % fällig am 26.06.2024	AUD 2,750	1,845	0,09	2,730 % fällig am 25.10.2040				4,000 % fällig am 01.06.2025			
HSBC Bank PLC				<b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust</b>				<b>Athene Global Funding</b>			
3,641 % fällig am 28.09.2024	\$ 2,200	2,164	0,10	5,705 % fällig am 25.06.2036				0,950 % fällig am 08.01.2024			
HSBC Holdings PLC				6,650 % fällig am 25.10.2034				1,200 % fällig am 13.10.2023			
6,770 % fällig am 11.03.2025	15,500	15,564	0,75	6,105 % fällig am 25.10.2035				2,920			
6,920 % fällig am 12.09.2026	2,820	2,840	0,14	8,150 % fällig am 25.10.2034				2,514 % fällig am 08.03.2024			
Imperial Brands Finance PLC				<b>EquiFirst Mortgage Loan Trust</b>				5,790 % fällig am 24.05.2024			
3,125 % fällig am 26.07.2024	13,600	13,145	0,64	8,150 % fällig am 25.10.2034				5,941 % fällig am 08.01.2024			
Lloyds Banking Group PLC				<b>Finance America Mortgage Loan Trust</b>				<b>Bank of America Corp.</b>			
5,579 % fällig am 07.03.2025	AUD 2,360	1,563	0,08	5,975 % fällig am 25.08.2034				0,976 % fällig am 22.04.2025			
<b>USA</b>				<b>First NLC Trust</b>				3,864 % fällig am 23.07.2024			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,220 % fällig am 25.08.2037				6,422 % fällig am 02.04.2026			
Home Equity Asset Trust				5,220 % fällig am 25.08.2037				<b>Baxter International, Inc.</b>			
6,095 % fällig am 25.06.2034	541	531	0,03	5,885 % fällig am 25.01.2035				5,351 % fällig am 01.12.2023			
Long Beach Mortgage Loan Trust				<b>Fremont Home Loan Trust</b>				<b>Bayer U.S. Finance LLC</b>			
6,125 % fällig am 25.04.2035	1,078	1,063	0,05	5,885 % fällig am 25.01.2035				6,562 % fällig am 15.12.2023			
MASTR Asset-Backed Securities Trust				<b>Home Equity Asset Trust</b>				<b>Berry Global, Inc.</b>			
5,850 % fällig am 25.09.2034	838	710	0,03	6,095 % fällig am 25.06.2034				4,875 % fällig am 15.07.2026			
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>				<b>BGC Partners, Inc.</b>			
6,200 % fällig am 25.09.2033	609	600	0,03	6,125 % fällig am 25.04.2035				5,375 % fällig am 24.07.2023			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b>				<b>BOC Aviation USA Corp.</b>			
<b>AMERICAN TOWER CORP.</b>				5,850 % fällig am 25.09.2034				1,625 % fällig am 29.04.2024			
American Tower Corp.				<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>				<b>Brighthouse Financial Global Funding</b>			
3,375 % fällig am 15.05.2024	9,000	8,814	0,43	6,200 % fällig am 25.09.2033				5,780 % fällig am 12.04.2024			
4,000 % fällig am 01.06.2025	3,300	3,189	0,15	6,200 % fällig am 25.09.2033				4,000 % fällig am 02.04.2026			
<b>ATHENE GLOBAL FUNDING</b>				<b>Home Equity Asset Trust</b>				<b>Cantor Fitzgerald LP</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,275 % fällig am 25.03.2035				4,875 % fällig am 01.05.2024			
<b>AMERICAN TOWER CORP.</b>				6,275 % fällig am 25.03.2035				4,875 % fällig am 01.05.2024			
American Tower Corp.				6,275 % fällig am 25.03.2035				4,875 % fällig am 01.05.2024			
3,375 % fällig am 15.05.2024	9,000	8,814	0,43	6,275 % fällig am 25.03.2035				4,875 % fällig am 01.05.2024			
4,000 % fällig am 01.06.2025	3,300	3,189	0,15	6,275 % fällig am 25.03.2035				4,875 % fällig am 01.05.2024			
<b>ATHENE GLOBAL FUNDING</b>				<b>Home Equity Asset Trust</b>				<b>Capital One Financial Corp.</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,275 % fällig am 25.03.2035				6,439 % fällig am 09.05.2025			
<b>AMERICAN TOWER CORP.</b>				6,275 % fällig am 25.03.2035				6,949 % fällig am 01.02.2024			
American Tower Corp.				6,275 % fällig am 25.03.2035				6,949 % fällig am 01.02.2024			
3,375 % fällig am 15.05.2024	9,000	8,814	0,43	6,275 % fällig am 25.03.2035				6,949 % fällig am 01.02.2024			
4,000 % fällig am 01.06.2025	3,300	3,189	0,15	6,275 % fällig am 25.03.2035				6,949 % fällig am 01.02.2024			
<b>ATHENE GLOBAL FUNDING</b>				<b>Home Equity Asset Trust</b>				<b>Charter Communications Operating LLC</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,275 % fällig am 25.03.2035				6,949 % fällig am 01.02.2024			
<b>AMERICAN TOWER CORP.</b>				6,275 % fällig am 25.03.2035				6,949 % fällig am 01.02.2024			
American Tower Corp.				6,275 % fällig am 25.03.2035				6,949 % fällig am 01.02.2024			
3,375 % fällig am 15.05.2024	9,000	8,814	0,43	6,275 % fällig am 25.03.2035				6,949 % fällig am 01.02.2024			
4,000 % fällig am 01.06.2025	3,300	3,189	0,15	6,275 % fällig am 25.03.2035				6,949 % fällig am 01.02.2024			
<b>ATHENE GLOBAL FUNDING</b>				<b>Home Equity Asset Trust</b>				<b>Citigroup, Inc.</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,275 % fällig am 25.03.2035				4,140 % fällig am 24.05.2025			
<b>AMERICAN TOWER CORP.</b>				6,275 % fällig am 25.03.2035				5,379 % fällig am 27.10.2023			
American Tower Corp.				6,275 % fällig am 25.03.2035				5,379 % fällig am 27.10.2023			
3,375 % fällig am 15.05.2024	9,000	8,814	0,43	6,275 % fällig am 25.03.2035				5,379 % fällig am 27.10.2023			
4,000 % fällig am 01.06.2025	3,300	3,189	0,15	6,275 % fällig am 25.03.2035				5,379 % fällig am 27.10.2023			
<b>ATHENE GLOBAL FUNDING</b>				<b>Home Equity Asset Trust</b>				<b>CNH Industrial Capital LLC</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,275 % fällig am 25.03.2035				1,950 % fällig am 02.07.2023			
<b>AMERICAN TOWER CORP.</b>				6,275 % fällig am 25.03.2035				1,950 % fällig am 02.07.2023			
American Tower Corp.				6,275 % fällig am 25.03.2035				1,950 % fällig am 02.07.2023			
3,375 % fällig am 15.05.2024	9,000	8,814	0,43	6,275 % fällig am 25.03.2035				1,950 % fällig am 02.07.2023			
4,000 % fällig am 01.06.2025	3,300	3,189	0,15	6,275 % fällig am 25.03.2035				1,950 % fällig am 02.07.2023			

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS								
Daimler Truck Finance North America LLC 1,125 % fällig am 14.12.2023 5,841 % fällig am 13.12.2024	4.700 2.300	4.603 2.297	0,22 0,11	<b>NON-AGENCY-MBS</b> American Home Mortgage Investment Trust 5,750 % fällig am 25.09.2045	1.610	1.420	0,07	5,550 % fällig am 25.05.2037 - 25.10.2040 5,570 % fällig am 25.05.2037 5,600 % fällig am 25.10.2030 - 25.06.2060	31 49	30 48	0,00 0,00								
Energy Transfer LP 4,250 % fällig am 01.04.2024 4,500 % fällig am 15.04.2024 5,875 % fällig am 15.01.2024	5.000 3.000 2.000	4.924 2.966 2.001	0,24 0,14 0,10	Ashford Hospitality Trust 6,219 % fällig am 15.04.2035 Atrium Hotel Portfolio Trust 6,393 % fällig am 15.06.2035	989 11.300	967 11.056	0,05 0,54	5,650 % fällig am 25.08.2037 5,700 % fällig am 25.12.2049 5,820 % fällig am 25.03.2038	18.389 48 5	17.775 47 5	0,86 0,00 0,00								
Five Corners Funding Trust 4,419 % fällig am 15.11.2023	2.300	2.275	0,11	Barclays Commercial Mortgage Securities Trust 6,193 % fällig am 15.07.2037	900	881	0,04	5,830 % fällig am 25.12.2037 5,850 % fällig am 25.01.2041 6,150 % fällig am 25.05.2037	40 64 162	39 63 165	0,00 0,00 0,01								
Fox Corp. 4,030 % fällig am 25.01.2024	1.500	1.485	0,07	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 4,411 % fällig am 25.02.2036 ^	2	1	0,00	Federal Home Loan Bank 5,500 % fällig am 08.05.2025 5,650 % fällig am 28.05.2025 5,710 % fällig am 14.03.2025	38.000 21.000 20.000	37.913 20.974 20.010	1,83 1,02 0,97								
FS KKR Capital Corp. 1,650 % fällig am 12.10.2024	2.000	1.861	0,09	Bear Stearns ALT-A Trust 4,202 % fällig am 25.09.2035 ^	13	8	0,00	Freddie Mac 0,000 % fällig am 15.01.2038 (a)	627 751	26 666	0,00 0,03								
GA Global Funding Trust 0,800 % fällig am 13.09.2024 1,000 % fällig am 08.04.2024 1,250 % fällig am 08.12.2023 1,625 % fällig am 15.01.2026 5,591 % fällig am 13.09.2024 6,380 % fällig am 11.04.2025	300 2.800 1.500 3.500 500 3.000	279 2.671 1.465 3.107 490 2.939	0,01 0,13 0,07 0,15 0,02 0,14	BX Trust 6,243 % fällig am 15.05.2035 Citigroup Commercial Mortgage Trust 3,251 % fällig am 10.05.2035 Commercial Mortgage Trust 3,178 % fällig am 10.02.2035	2.775 1.027 3.000	2.744 954 2.787	0,13 0,05 0,14	2,500 % fällig am 25.10.2048 3,000 % fällig am 25.09.2045 4,000 % fällig am 01.08.2048 4,282 % fällig am 15.08.2038 4,299 % fällig am 15.10.2040 4,348 % fällig am 15.01.2038 5,375 % fällig am 24.04.2025 5,376 % fällig am 25.07.2044 5,493 % fällig am 15.05.2037 5,520 % fällig am 28.05.2025 5,550 % fällig am 09.05.2025 - 25.07.2050	2.101 1.450 239 6.698 15.688 10.000 4 44 22.400 34.244	1.841 1.385 230 6.436 15.248 9.954 3 43 22.351 33.704	0,09 0,07 0,01 0,31 0,74 0,48 0,00 0,00 1,08 1,63								
General Motors Financial Co., Inc. 1,700 % fällig am 18.08.2023 6,290 % fällig am 17.11.2023	4.918 8.000	4.893 8.006	0,24 0,39	Credit Suisse Mortgage Capital Trust 5,943 % fällig am 15.07.2032 DBCG Mortgage Trust 5,894 % fällig am 15.06.2034	1.305 21.800	1.244 21.529	0,06 1,04	5,593 % fällig am 15.02.2034 - 15.08.2056 5,603 % fällig am 15.06.2037 5,643 % fällig am 15.10.2036 - 15.06.2042 5,673 % fällig am 15.10.2040 5,680 % fällig am 03.04.2025 5,693 % fällig am 15.11.2050 5,713 % fällig am 15.05.2036 - 15.12.2041	6.820 545 44 68 21.000 77 171	6.518 534 43 67 20.974 72 167	0,32 0,03 0,00 0,00 1,02 0,00 0,01								
Goldman Sachs Group, Inc. 1,757 % fällig am 24.01.2025 5,236 % fällig am 02.05.2024 5,880 % fällig am 09.12.2026	13.100 3.000 4.300	12.758 2.001 4.267	0,62 0,10 0,21	DBGS Mortgage Trust 6,038 % fällig am 15.06.2033 DBWF Mortgage Trust 6,276 % fällig am 19.12.2030 Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates 3,910 % fällig am 28.09.2036	2.600 5.100 1.074	2.422 5.032 1.074	0,12 0,24 0,05	5,730 % fällig am 03.04.2025 5,800 % fällig am 03.07.2025 (b)	22.400 21.000 20.000	22.351 20.986 19.985	1,08 1,02 0,97								
HCA, Inc. 5,000 % fällig am 15.03.2024	24.235	24.086	1,17	GS Mortgage Securities Trust 3,648 % fällig am 10.01.2047	77	76	0,00	5,730 % fällig am 03.04.2025 5,800 % fällig am 03.07.2025	21.000	20.986	1,02								
Jackson National Life Global Funding 6,242 % fällig am 28.06.2024	8.200	8.212	0,40	GSR Mortgage Loan Trust 3,966 % fällig am 25.11.2035 ^ 4,234 % fällig am 25.06.2034	97 50	81 48	0,00 0,00	5,713 % fällig am 15.05.2036 - 15.12.2041 5,730 % fällig am 03.04.2025 5,800 % fällig am 03.07.2025	171 21.000	167 20.986	0,01 1,02								
JPMorgan Chase & Co. 3,797 % fällig am 23.07.2024 4,023 % fällig am 05.12.2024	500 10.000	499 9.915	0,02 0,48	Impac CMB Trust 5,790 % fällig am 25.03.2035 JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 4,128 % fällig am 05.07.2031 6,403 % fällig am 15.06.2035	80 3.000 2.229	73 2.739 2.071	0,00 0,13 0,10	5,800 % fällig am 03.07.2025 (b)	21.000 20.000	20.986 19.985	1,02 0,97								
Kinder Morgan, Inc. 5,625 % fällig am 15.11.2023	3.000	2.999	0,14	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 3,918 % fällig am 25.05.2033 7,119 % fällig am 25.03.2033	146 246	140 224	0,01 0,01	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.01.2049 2,625 % fällig am 20.08.2024 2,750 % fällig am 20.11.2029 3,625 % fällig am 20.03.2027 - 20.03.2030	729 0 2	643 0 2	0,03 0,00 0,00								
Nissan Motor Acceptance Co. LLC 3,875 % fällig am 21.09.2023	1.000	995	0,05	Mill City Mortgage Loan Trust 2,750 % fällig am 25.07.2059 New Residential Mortgage Loan Trust 3,500 % fällig am 25.12.2057 4,500 % fällig am 25.05.2058	176 386 180	174 362 172	0,01 0,02 0,01	3,689 % fällig am 20.12.2068 4,614 % fällig am 20.12.2065 4,770 % fällig am 20.01.2066 4,961 % fällig am 20.04.2067 5,099 % fällig am 20.09.2066 5,554 % fällig am 20.02.2067 5,646 % fällig am 20.10.2037 5,844 % fällig am 20.08.2067 5,944 % fällig am 20.11.2066 6,066 % fällig am 20.05.2073 6,166 % fällig am 20.05.2073 6,184 % fällig am 20.06.2071 6,986 % fällig am 20.05.2071 6,990 % fällig am 20.06.2071	22 1.018 827 389 3.257 1.400 597 138 1.944 787 4.307 1.000 7.114 4.856 5.103	20 988 817 385 3.239 1.424 593 138 1.931 782 4.313 1.001 7.272 4.968 5.210	0,00 0,05 0,04 0,02 0,16 0,07 0,03 0,01 0,09 0,04 0,21 0,05 0,35 0,24 0,25								
Pacific Gas & Electric Co. 1,700 % fällig am 15.11.2023 3,250 % fällig am 16.02.2024 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ 3,750 % fällig am 15.02.2024 ^ 3,850 % fällig am 15.11.2023 ^	5.700 2.000 500 1.700 300	5.603 1.964 484 1.672 297	0,27 0,09 0,02 0,08 0,01	Sequoia Mortgage Trust 5,837 % fällig am 20.10.2034 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 5,116 % fällig am 25.03.2034 Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,806 % fällig am 19.10.2034 Towd Point Mortgage Trust 3,750 % fällig am 25.05.2058	435 9 309	386 8 290	0,02 0,00 0,01	5,944 % fällig am 20.11.2066 6,066 % fällig am 20.05.2073 6,166 % fällig am 20.05.2073 6,184 % fällig am 20.06.2071 6,986 % fällig am 20.05.2071 6,990 % fällig am 20.06.2071 Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2049	1.018 827 389 3.257 1.400 597 138 1.944 787 4.307 1.000 7.114 4.856 5.103 3.687	988 817 385 3.239 1.424 593 138 1.931 782 4.313 1.001 7.272 4.968 5.210 3.512	0,05 0,04 0,02 0,16 0,07 0,03 0,01 0,09 0,04 0,21 0,05 0,35 0,24 0,25 0,17								
Pacific Life Global Funding 5,890 % fällig am 06.12.2024	400	398	0,02	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 4,218 % fällig am 15.07.2046	74	74	0,00	Summe USA	3.687	3.512	0,17								
Piper Sandler Cos. 5,200 % fällig am 15.10.2023	3.500	3.491	0,17			67.020	3,24			305.230	14,77								
Sabine Pass Liquefaction LLC 5,750 % fällig am 15.05.2024	7.500	7.489	0,36	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b> Fannie Mae 2,000 % fällig am 25.08.2038 3,166 % fällig am 25.08.2050 4,153 % fällig am 25.11.2047 4,366 % fällig am 01.10.2037 5,400 % fällig am 25.01.2037 5,460 % fällig am 25.04.2037 5,480 % fällig am 25.04.2037 5,500 % fällig am 25.07.2037 5,520 % fällig am 25.05.2037 5,540 % fällig am 25.04.2037	8.192 7.733 244 1 29 74	8,38 7,33 0,01 0,00 0,00 0,00								773.265	37,42				
Southern California Edison Co. 5,922 % fällig am 01.04.2024	4.500	4.494	0,22					<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE COMMERCIAL PAPER</b> Ameren Corp. 5,400 % fällig am 24.07.2023 Global Payments, Inc. 5,930 % fällig am 26.07.2023 5,930 % fällig am 28.07.2023 5,950 % fällig am 14.07.2023 Targa Resources Corp. 5,950 % fällig am 20.07.2023 Virginia Electric & Power Co. 5,330 % fällig am 13.07.2023	20.800 1.000 800 2.500 2.900 8.800	20.726 996 796 2.494 2.892 8.783	1,00 0,05 0,04 0,12 0,14 0,43							36.687	1,78
Synchrony Financial 4,250 % fällig am 15.08.2024 4,375 % fällig am 19.03.2024	3.400 4.900	3.279 4.806	0,16 0,23																
TD SYNEX Corp. 1,250 % fällig am 09.08.2024	8.000	7.570	0,37																
Verizon Communications, Inc. 6,421 % fällig am 15.05.2025	8.221	8.292	0,40																
VMware, Inc. 0,600 % fällig am 15.08.2023	500	497	0,02																
Volkswagen Group of America Finance LLC 3,950 % fällig am 06.06.2025	15.700	15.251	0,74																
Warnermedia Holdings, Inc. 3,788 % fällig am 15.03.2025	3.000	2.894	0,14																
Wells Fargo & Co. 6,372 % fällig am 25.04.2026	2.000	2.015	0,10																
<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b> Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, (GTD STD LNS Insured), Series 2006 5,385 % fällig am 25.10.2036	589	586	0,03																

## Aufstellung des Wertpapierbestands des US Short-Term Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS		
<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				<b>U.S. TREASURY BILLS</b>				<b>INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>					
Warnermedia Holdings, Inc.				5,175 % fällig am									
3,428 % fällig am 15.03.2024	\$ 12.325	\$ 12.104	0,59	01.08.2023 (b)(c)(d)	\$ 209.000	\$ 208.149	10,07	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	6.321	\$ 63	0,00		
3,528 % fällig am 15.03.2024	2.000	1.964	0,09	5,304 % fällig am 29.08.2023 (b)(c)(d)	215.400	213.650	10,34						
		14.068	0,68	5,390 % fällig am 31.10.2023 (b)(c)(d)	128.900	126.690	6,13						
						548.489	26,54						
<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>				Summe kurzfristige Instrumente				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>					
(0,186) % fällig am 07.08.2023 (c)(d)	¥ 2.486.000	17.202	0,83			619.380	29,97	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	2.082.187	206.824	10,00		
(0,166) % fällig am 07.08.2023 (c)(d)	424.000	2.934	0,14	Summe Übertragbare Wertpapiere				\$ 2.175.664	105,27				
		20.136	0,97										
								Summe Investmentfonds				\$ 206.887	10,00

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	5,100 %	30.06.2023	03.07.2023	\$ 196.400	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029	\$ (200.759)	\$ 196.400	\$ 196.483	9,51
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	29.300	U.S. Treasury Notes 0,500 % fällig am 30.06.2027	(29.947)	29.300	29.313	1,42
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	2.237	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(2.282)	2.237	2.237	0,11
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						\$ (232.988)	\$ 227.937	\$ 228.033	11,04

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	475	\$ 895	0,04
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	941	1.026	0,05
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	61	118	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	79	107	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	14	(28)	(0,01)
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				\$ 2.118	0,10

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme (Wertabnahme)	% des Nettovermögen
CDX.IG-40 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2028	\$ 352.200	\$ (2.593)	(0,13)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>				\$ (2.593)	(0,13)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	¥ 1.100	\$ 8	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 2.259	CAD 2.988	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	4.890	£ 3.867	26	0	26	0,00
	08.2023	AUD 88.451	\$ 59.791	843	0	843	0,04
	08.2023	\$ 3.285	AUD 5.017	58	0	58	0,00
BPS	02.2024	CAD 1.000	\$ 747	0	(12)	(12)	0,00
	07.2023	€ 85.239	91.633	0	(1.363)	(1.363)	(0,06)
	07.2023	\$ 93.258	€ 85.113	0	(400)	(400)	(0,02)
BRC	08.2023	€ 85.113	\$ 93.389	404	0	404	0,02
	09.2023	\$ 20	ILS 71	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2023	€ 8.437	\$ 9.054	0	(151)	(151)	(0,01)
	11.2023	ILS 9.434	2.738	179	0	179	0,01
DUB	02.2024	CAD 2.000	1.493	0	(23)	(23)	0,00
	07.2023	\$ 9.156	€ 8.563	187	0	187	0,01
JPM	07.2023	3	¥ 374	0	0	0	0,00
	08.2023	¥ 373	\$ 3	0	0	0	0,00
	09.2023	\$ 19	ILS 69	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	CAD 31	\$ 23	0	0	0	0,00
	07.2023	£ 60.641	75.065	0	(2.031)	(2.031)	(0,10)
MYI	07.2023	€ 386	421	0	0	0	0,00
	07.2023	\$ 1.114	£ 875	0	(2)	(2)	0,00
RBC	07.2023	MXN 60	\$ 3	0	0	0	0,00
	08.2023	\$ 18	MXN 319	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	CAD 2.096	£ 1.579	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	\$ 71.032	£ 55.899	36	0	36	0,00
	08.2023	£ 54.974	\$ 69.871	0	(35)	(35)	0,00
UAG	08.2023	\$ 1.579	CAD 2.095	5	0	5	0,00
	08.2023	¥ 2.910.000	\$ 21.468	1.234	0	1.234	0,05
	09.2023	\$ 17	ILS 59	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 2.972	\$ (4.026)	\$ (1.054)	(0,06)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 25	\$ 27	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2023	\$ 54.383	€ 50.602	824	0	824	0,04
BPS	07.2023	€ 45.378	\$ 49.721	213	0	213	0,01
	07.2023	\$ 504	€ 461	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	49.782	45.370	0	(216)	(216)	(0,01)
BRC	07.2023	€ 8.563	\$ 9.159	0	(183)	(183)	(0,01)
	07.2023	51.552	56.088	17	(173)	(156)	(0,01)
CBK	07.2023	\$ 192	€ 179	3	0	3	0,00
	08.2023	49.640	45.594	171	0	171	0,01
	07.2023	4.929	4.614	106	0	106	0,01
MBC	07.2023	€ 508	\$ 545	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	\$ 51.138	€ 47.842	1.058	0	1.058	0,05
SCX	07.2023	51.137	47.784	995	0	995	0,05
				\$ 3.387	\$ (582)	\$ 2.805	0,14

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	\$ 83	£ 67	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
RBC	07.2023	83	67	2	0	2	0,00
SCX	07.2023	83	67	2	0	2	0,00
				\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 1.756 0,08

Summe Anlagen

\$ 2.611.769 126,36

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (544.865) (26,36)

Nettovermögen

\$ 2.066.904 100,00



## Aufstellung des Wertpapierbestands des US Short-Term Fund (Fort.)

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend\*):

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.  
 (b) Wertpapier per Emissionstermin.  
 (c) Nullkuponwertpapier.  
 (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
 (e) Mit dem Fonds verbunden.  
 (f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,32 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	0,898 %	28.05.2024	31.03.2023 - 31.05.2023	\$ 5.382	\$ 5.331	0,26

Barmittel in Höhe von 11.983 USD (31. Dezember 2022: 16.350 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.820 USD (31. Dezember 2022: 1.780 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

#### Beizulegender Zeitwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.174.512	\$ 1.152	\$ 2.175.664
Investmentfonds	206.887	0	0	206.887
Pensionsgeschäfte	0	227.937	0	227.937
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	1.281	0	1.281
<b>Summen</b>	<b>\$ 206.887</b>	<b>\$ 2.403.730</b>	<b>\$ 1.152</b>	<b>\$ 2.611.769</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.891.711	\$ 0	\$ 1.891.711
Investmentfonds	62	225.956	0	226.018
Pensionsgeschäfte	0	154.472	0	154.472
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	4.760	0	4.760
<b>Summen</b>	<b>\$ 62</b>	<b>\$ 2.276.899</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 2.276.961</b>

<sup>(1)</sup> Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ 1.566	\$ (1.460)	\$ 106
BOA	1.738	(1.790)	(52)	(2.159)	1.770	(389)
BPS	(1.363)	1.430	67	131	0	131
BRC	(184)	0	(184)	(17)	0	(17)
CBK	47	0	47	1.487	(1.350)	137
DUB	(23)	0	(23)	(4)	0	(4)
GLM	106	0	106	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	186	(260)	(74)	350	(290)	60
MBC	(982)	390	(592)	(153)	0	(153)
MYI	(2)	(10)	(12)	(2)	10	8
RBC	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	997	(1.050)	(53)	2.590	(2.250)	340
TOR	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	1.233	(1.100)	133	(101)	0	(101)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.



## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	38,73	43,64
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	66,54	38,19
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,05
Investmentfonds	10,00	9,78
Pensionsgeschäfte	11,04	6,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,13)	0,01
Freiverkehrsinanzderivate	0,08	0,16

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,56	1,66
Belgien	k. A.	0,39
Bermuda	k. A.	0,39
Cayman Inseln	6,87	3,83
Dänemark	0,02	0,66
Finnland	0,13	0,38
Frankreich	2,03	2,56
Deutschland	1,00	1,17
Irland	5,59	5,43
Israel	0,55	0,35
Italien	k. A.	0,22
Japan	5,81	5,03
Luxemburg	k. A.	0,10
Multinational	0,12	k. A.
Niederlande	2,50	3,03
Norwegen	0,13	0,04
Katar	0,04	k. A.
Saudi-Arabien	0,10	0,11
Singapur	0,08	0,07
Südkorea	0,83	0,84
Spanien	0,71	0,42
Supranational	0,44	1,10
Schweiz	1,06	1,42
Vereinigte Arabische Emirate	0,03	0,08
Großbritannien	8,28	8,42
Vereinigte Staaten	37,42	42,70
Kurzfristige Instrumente	29,97	1,48
Investmentfonds	10,00	9,78
Pensionsgeschäfte	11,04	6,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,10	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,13)	0,01
Zinsswaps — Basisswaps	k. A.	0,00
Freiverkehrsinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	(0,06)	(0,11)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,14	0,27
Sonstige Aktiva und Passiva	(26,36)	1,44
Nettovermögen	100,00	100,00

## 1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die einzelnen in diesem Bericht beschriebenen Fonds (nachfolgend jeweils als ein „Fonds“ und gemeinsam als die „Fonds“ bezeichnet) sind Teilfonds der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und mit gesonderter Haftung zwischen den Fonds und mit beschränkter Haftung, die gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 in Irland eingetragen und von der Zentralbank von Irland (die „Zentralbank“) nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren („OGAW“)) (Verordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinien“) genehmigt wurde. Bei der Gesellschaft handelt es sich um eine Umbrella-Gesellschaft, die aus verschiedenen Fonds besteht, die jeweils eine oder mehrere Anteilklassen („Klassen“) umfassen. Nach dem Ermessen des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“ oder die „Verwaltungsratsmitglieder“) dürfen für einen Fonds mehrere Anteilklassen („Klassen“) ausgegeben werden. Für jeden einzelnen Fonds wird ein gesondertes Vermögenswertportfolio geführt, welches in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die auf diesen Fonds zutreffen, angelegt wird. Der Verwaltungsrat darf mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Fonds auflegen. Die Gesellschaft wurde am 10. Dezember 1997 gegründet.

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) ist die Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft.

Wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft vorgesehen, wurden Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Ltd und PIMCO Europe GmbH (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) als Anlageberatungsgesellschaften für verschiedene Fonds der Gesellschaft bestellt. PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) haben von der Zentralbank die Genehmigung erhalten, als Anlageberatungsgesellschaft für irische Fonds zu agieren.

Gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft kann jede Anlageberatungsgesellschaft die diskretionäre Anlageverwaltung der Fonds vorbehaltlich aller gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen einer oder mehreren Unter-Anlageberatungsgesellschaften übertragen. Wenn für einen bestimmten Fonds eine Anlageberatungsgesellschaft bestellt wurde, hat die Anlageberatungsgesellschaft die jeweils übrigen Anlageberatungsgesellschaften (PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd.) als Unter-Anlageberatungsgesellschaft bezüglich des bzw. der jeweiligen Fonds bestellt. Die Gebühren der einzelnen entsprechend bestellten Unter-Anlageberatungsgesellschaften sind von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften im Namen der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr zu begleichen.

Der Sitz der Gesellschaft befindet sich in 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irland.

## 2. WICHTIGE BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Die bei der Erstellung dieses Abschlusses verwendeten wesentlichen Rechnungslegungs- und Schätzungsmethoden sind mit denen konform, die die Gesellschaft für den geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (der „geprüfte Jahresabschluss“) verwendet hat. Der Abschluss wird für alle Fonds auf der Grundlage der Unternehmensfortführung erstellt.

### Erstellungsgrundlage

Bei dem vorliegenden Abschluss handelt es sich um den ungeprüften verkürzten Abschluss für den Sechsmonatszeitraum zum 30. Juni 2023. Er wurde gemäß Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Zwischenberichterstattung“, wie vom Financial Reporting Council („FRC“) veröffentlicht, und den OGAW-Richtlinien veröffentlicht.

Der ungeprüfte verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Jahresabschluss, der von den Abschlussprüfern einen uneingeschränkten Bestätigungsvermerk erhalten hat und der im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen (FRS 102), dem Irischen Statut, bestehend aus dem Companies Act (Gesetz über Aktiengesellschaften) von 2014 und den OGAW-Richtlinien erstellt wurde, gelesen werden. Bei den in Irland allgemein für die Erstellung von Rechnungsabschlüssen anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen handelt es sich um diejenigen, die vom FRC herausgegeben werden.

Die in der Aufstellung der ausgewiesenen Gesamtgewinne und -verluste sowie in einer Überleitung der Eigenkapitalveränderungen aufzuführenden Angaben sind nach Meinung des Verwaltungsrats in der Betriebsergebnisrechnung sowie im Ausweis der Nettovermögensänderungen enthalten.

Die Gesellschaft hat von der für offene Investmentfonds, die einen erheblichen Anteil ihres Vermögens in äußerst liquiden und zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen halten, verfügbaren Ausnahmeregelung gemäß Abschnitt 7 von FRS 102 Gebrauch gemacht und legt daher keine Kapitalflussrechnung vor.

Dieser Abschluss wurde nach der Anschaffungskostenregelung unter Zugrundelegung der Neubewertung der ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten Finanzvermögen und -verbindlichkeiten aufgestellt.

Die Gesellschaft verwendet den US-Dollar als Präsentationswährung. Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden in der Funktionswährung des Fonds erstellt. Der Finanzstatus der Gesellschaft wird mithilfe von Wechselkursen zum Ende des Berichtszeitraums umgerechnet und die Betriebsergebnisrechnung und der Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen der Gesellschaft werden zum durchschnittlichen Wechselkurs (als Annäherung an die tatsächlichen Kurse) des Berichtszeitraums umgerechnet, um diese in den Abschluss der Gesellschaft einzubeziehen.

Alle Beträge wurden, sofern nicht anders angegeben, auf die nächsten Tausend gerundet. Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Die Aufstellung des Wertpapierbestands bestimmter Fonds kann übertragbare Wertpapiere halten, die sowohl einen Nennwert von Null als auch einen Marktwert von Null aufweisen, wenn der tatsächliche Nennwert und der Marktwert auf den nächsten Tausender gerundet werden.

Die von der Gesellschaft während des Berichtszeitraums angewandte Swing-Pricing-Methode entspricht der im geprüften Jahresabschluss angewandten Methode.

Zum 30. Juni 2023 wurde Swing Pricing auf den Emerging Markets Bond ESG Fund angewandt. Zum 31. Dezember 2022 wurde Swing Pricing auf den Income Fund II angewandt.

Der NIW je Anteil wird in Erläuterung 16 angegeben und kann eine Swing-Pricing-Anpassung beinhalten. Swing-Price-Anpassungen werden in der Aufstellung der Aktiva und Passiva, der Betriebsergebnisrechnung oder der Aufstellung über die Nettovermögensänderungen ausgewiesen.

## 3. ANLAGEN ZUM MARKTWERT UND MARKTBEWERTUNGSHIERARCHIE

Die Gesellschaft muss Angaben bezüglich der Marktbewertungshierarchie machen, in die die Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingestuft werden. Die Angaben beruhen auf einer dreistufigen Marktbewertungshierarchie für die in Bewertungungsverfahren zur Bemessung des beizulegenden Zeitwerts verwendeten Inputfaktoren.

Der beizulegende Zeitwert ist definiert als der Betrag, zu dem in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ein Vermögenswert ausgetauscht, eine Verbindlichkeit beglichen oder ein Eigenkapitalinstrument gewährt würde. Es sind getrennte Angaben zur Marktbewertungshierarchie für jede Hauptklasse von Aktiva und Passiva erforderlich, die die Bewertung zum Marktwert in Stufen teilt (Stufen 1, 2 und 3). Diese Inputfaktoren oder Verfahren zur Bewertung von Wertpapieren geben nicht unbedingt das Risiko wieder, dass mit der Anlage in diesen Wertpapieren verbunden ist. Die Stufen 1, 2 und 3 der Marktbewertungshierarchie sind wie folgt definiert:

- Stufe 1 – Quotierte Preise auf aktiven Märkten oder Börsen für identische Aktiva und Passiva.
- Stufe 2 – Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren. Hierzu können insbesondere quotierte Preise für ähnliche Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten an Märkten, die aktiv sind, quotierte Preise für identische oder ähnliche Vermögenswerte und Verbindlichkeiten an Märkten, die nicht aktiv sind, andere Inputfaktoren als quotierte Preise, die für die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zu beobachten sind (wie zum Beispiel Zinssätze, Renditekurven, Volatilitäten, Tilgungsgeschwindigkeit, Verlustquoten, Kreditrisiken und Ausfallraten) oder andere bestätigte Inputfaktoren vom Markt zählen.
- Stufe 3 – Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren, die unter diesen Umständen auf bestmöglich verfügbaren Informationen beruhen, wenn beobachtbare Inputfaktoren nicht verfügbar sind, was zur Bestimmung des Marktwerts von Anlagen verwendete Annahmen des Verwaltungsrats oder anderer Personen, die nach seinem Ermessen handeln, einschließen kann.

Bei der Bewertung der erwarteten Wiederherstellung wird geschätzt, dass der beizulegende Zeitwert eines vorhandenen Vermögenswerts abzüglich etwaiger Verbindlichkeiten wiederhergestellt werden kann. Erhebliche Änderungen an den nicht beobachtbaren Inputfaktoren hätten direkte und proportionale Änderungen am Marktwert des Wertpapiers zur Folge. Diese Wertpapiere werden in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Eine Analyse der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands. Die von den Fonds zur Klassifizierung von zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten anhand einer Zeitwerthierarchie verwendete Methode ist mit derjenigen konform, die im geprüften Jahresabschluss angewandt wurde.

#### 4. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Innerhalb der durch die Anlageziele und Anlagepolitik der Fonds und nach Maßgabe der von der Zentralbank jeweils festgesetzten Grenzen und des laut Prospektbestimmungen erlaubten Umfangs sind die Finanzderivate und Anlagetechniken von allen Fonds für eine effiziente Portfolioverwaltung einzusetzen. Die Fonds können diese Finanzderivate und Anlagetechniken zur Absicherung gegen Zinsänderungen, Devisenkursänderungen in anderen Währungen als der Funktionswährung, gegen Änderungen in Wertpapierkursen oder als Teil ihrer allgemeinen Anlagestrategie einsetzen.

Der durch die Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 277.072.633 USD/(139.559 USD) (30. Juni 2022: 15.018.247 USD/(1.166.271 USD)).

Der durch die umgekehrten Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 204.499 USD/(66.620.552 UD) (30. Juni 2022: 8.488.913 USD/(9.218.518 USD)).

Der durch die Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 1.074 USD/(2.626.118 USD) (30. Juni 2022: 223.876 USD/(954.715 USD)).

#### 5. DIVIDENDENAUSCHÜTTUNGSPOLITIK

Wie in der jeweiligen Fondsergänzung angegeben, können Dividendenausschüttungen festgesetzt werden auf:

- (i) Nettokapitalerträge, die aus Zinsen und Dividenden abzüglich Aufwendungen bestehen.
- (ii) Realisierte Gewinne aus der Veräußerung von Anlagen abzüglich realisierter und nicht realisierter Verluste (einschließlich Gebühren und Aufwendungen). Für den Fall, dass die bei der Veräußerung von Anlagen realisierten Gewinne abzüglich der realisierten und nicht realisierten Verluste negativ sind, können die Fonds dennoch Dividenden aus den Nettokapitalerträgen und/oder Kapital bezahlen.
- (iii) Andere Mittel (einschließlich Kapital), die nach dem Gesetz aus dem betreffenden Fonds bzw. der betreffenden Anteilsklasse des betreffenden Fonds ausgeschüttet werden können.

Verwaltungsgebühren und andere Gebühren oder ein Teil davon können dem Kapital belastet werden. Das kann dazu führen, dass das Kapital sinkt und Erträge mit einem verminderten Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erwirtschaftet werden. Dieser Zyklus kann sich solange fortsetzen, bis das Kapital aufgezehrt ist. Der Grund für die Belastung des Kapitals ist, den an die Anteilinhaber ausschüttbaren Betrag zu maximieren.

Für die Klasse Income II kann der Verwaltungsrat in seinem Ermessen entscheiden, die Gebühren aus dem Kapital zu bezahlen und das Renditedifferenzial zwischen den jeweiligen abgesicherten Anteilsklassen und den grundlegenden Anteilsklassen zu berücksichtigen (was einer Ausschüttung aus dem Kapital entspricht). Das Renditedifferenzial kann positiv oder negativ sein und wird unter Berücksichtigung des Beitrags der Anteilsklassenbesicherung aus den besicherten Klassen berechnet.

Bei den Klassen M Retail, PIMCO Asia High Yield Bond Fund, Asia Strategic Interest Bond Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Short-Term Fund, Income Fund, Low Duration Income Fund, Mortgage Opportunities Fund und US Short-Term Fund, außer den Klassen G Institutional, G Retail, E Class ausschüttend und Q, E Class ausschüttend II Q und Investor ausschüttend A (sofern zutreffend), Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Anteile der Administrative-Klassen des Diversified Income Fund, BE Retail, BM Retail, BN Retail, M Retail und N Retail Share werden Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Anteilsklassen G Institutional, G Retail und Investor ausschüttend A werden Dividendenausschüttungen jährlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers jährlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Im Falle aller anderen Fonds mit ausschüttenden Anteilsklassen werden Ausschüttungen vierteljährlich festgesetzt und werden, abhängig von der Entscheidung des Anteilinhabers, in bar ausgezahlt oder nach der Erklärung in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Dividendenausschüttungen an Inhaber rückgabeberechtigter Anteile werden in der Betriebsergebnisrechnung als Finanzierungskosten klassifiziert. Die auf die thesaurierenden Anteile entfallenden Erträge oder Kapitalzuwachs werden weder festgesetzt noch ausgeschüttet. Statt dessen wird der NIW je Anteil der thesaurierenden Anteile entsprechend dieser Erträge oder dieses Wertzuwachses erhöht. Dividendenausschüttungen, die nicht in Anteile reinvestiert werden, werden den Anteilinhabern per Banküberweisung ausgezahlt. Dividendenausschüttungen, die nach Ablauf von sechs Jahren ab dem Datum ihrer Erklärung nicht eingefordert werden, verfallen und fließen an den jeweiligen Fonds zurück. Die Anteilinhaber können sich entscheiden, die Dividendenausschüttungen in zusätzliche Anteile zu reinvestieren oder sich die Dividendenausschüttungen bar auszahlen zu lassen, indem sie das entsprechende Kästchen im Antragsformular auswählen.

Für die nachfolgenden Fonds wurde ein Teil der Dividendenausschüttungen gemäß der Betriebsergebnisrechnung aus dem Kapital gezahlt (Angaben in Tausend):

Fonds	Zwischenabschluss 30. Juni 2023	Zwischenabschluss 30. Juni 2022
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 0	\$ 50
PIMCO Capital Securities Fund	311	32
PIMCO Climate Bond Fund	94	1
Diversified Income Fund	2.113	6.698
Diversified Income Duration Hedged Fund	1.240	1.317
Dynamic Bond Fund	811	331
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 725	€ 2.994
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	\$ 2	\$ 0
Global Bond Fund	549	944
Global Bond ESG Fund	209	0
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	729	1.533
Global High Yield Bond Fund	501	1.504
Global Investment Grade Credit Fund	1.892	0
Global Investment Grade Credit ESG Fund	461	0
Global Low Duration Real Return Fund	1.172	21
Global Real Return Fund	5.083	883
Income Fund	5.888	191
Low Average Duration Fund	15	115
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	13	0
Low Duration Income Fund	3	0
Low Duration Opportunities Fund	1.716	772
Strategic Income Fund	1	0
Total Return Bond Fund	0	123
UK Corporate Bond Fund	£ 363	£ 319
UK Long Term Corporate Bond Fund	9	67
US High Yield Bond Fund	\$ 1	\$ 0

#### 6. SOFT COMMISSIONS

Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann Transaktionen im Namen der Fonds über oder mit Unterstützung von Ausführungsmaklern durchführen, die zusätzlich zur routinemäßigen Order-Ausführung gelegentlich Güter, Dienstleistungen oder andere Vorteile wie etwa Research- und Beratungsdienste für die Gesellschaft oder ihre Beauftragten bereitstellen oder beschaffen können. Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann diesen Brokern Full-Service-Provisionsätze zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen verwendet werden können. Diejenigen Anlageberatungsgesellschaften, bei denen es sich um Anlagegesellschaften gemäß der Verordnung über Märkte für Finanzinstrumente (Markets in Financial Instruments Directive, „MiFID“) handelt oder die gleichwertigen aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterliegen, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Fonds kaufen, direkt aus ihren eigenen Mitteln bezahlen.

#### 7. GETRENNTE HAFTUNG

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und Haftungstrennung zwischen ihren Teilfonds. Dementsprechend sind etwaige Verbindlichkeiten, die im Namen eines Fonds der Gesellschaft entstanden oder diesem zuzuordnen sind, ausschließlich aus den Vermögenswerten des betreffenden Fonds zu begleichen, und weder die Gesellschaft noch ein Verwaltungsratsmitglied, Revisor, Insolvenzverwalter, kommissarischer Insolvenzverwalter oder sonstige Personen dürfen

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Personen dürfen die Vermögenswerte dieses Fonds zum Ausgleich von Verbindlichkeiten im Namen eines anderen Fonds der Gesellschaft verwenden oder sind verpflichtet, sie hierzu zu verwenden, unabhängig davon, wann diese Verbindlichkeit entstanden ist.

### 8. ÄNDERUNGEN AM PROSPEKT, AN DER GRÜNDUNGSURKUNDE UND DER SATZUNG

Am 03. Januar 2023 wurden die Ergänzungen für den Low Duration Income Fund und den Income Fund II aktualisiert, um den Verzicht auf die Verwaltungsgebühr zu ändern.

Am selben Tag wurden die Ergänzungen für den Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, PIMCO Capital Securities Fund, PIMCO Global Core Asset Allocation Fund, UK Corporate Bond Fund, UK Long Term Corporate Bond Fund und Dynamic Multi Asset Fund aktualisiert, um die Handelstage zu ändern.

Am 18. Januar 2023 wurden die Ergänzungen für die Fonds Euro Short-Term Fund und PIMCO European Short-Term Opportunities Fund aktualisiert, um den Verzicht auf die Verwaltungsgebühr zu ändern.

Am 19. April 2023 wurden die Ergänzungen für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund, Inflation Multi-Asset Fund und PIMCO Global Core Asset Allocation Fund aktualisiert, um die Anlagepolitik dahingehend zu ändern, dass die Fonds bis zu 20 % ihres Nettovermögens in strukturierte Schuldverschreibungen anlegen können, wie in den Ergänzungen näher beschrieben. Die strukturierten Schuldverschreibungen ändern die Anlagepolitik nicht wesentlich und werden verwendet, um ein Engagement in Sektoren zu erzielen, die bereits in der Anlagepolitik berücksichtigt wurden.

Am 16. Mai 2023 wurde der Nachtrag für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund aktualisiert, um zu präzisieren, dass nicht alle Energiesektoren Teil des Rohstoffengagement-Universums des Fonds sind. Diese Präzisierung wurde vom Anlageberater als Verbesserung des gesamten Anlageprozesses des Fonds empfohlen und stellt in keiner Weise eine wesentliche Änderung der Anlagepolitik des Fonds dar.

Am 16. Mai wurde die Ergänzung für den StocksPLUS™ Fund aktualisiert, um die Anlagerichtlinie zu entfernen, die besagt, dass der Fonds mindestens 50 % in festverzinslichen Wertpapieren mit derselben Abrechnung halten muss. Diese spezielle (historische) selbstauferlegte Anlagerichtlinie muss aus aufsichtsrechtlicher Sicht nicht in die Ergänzung aufgenommen werden, und unabhängig von dieser Offenlegung wird der Teilfonds in Übereinstimmung mit seinen OGAW-Liquiditätsverpflichtungen verwaltet. Durch die Änderung wird die Ergänzung mit anderen ähnlichen Strategien in Einklang gebracht und stellt in keiner Weise eine wesentliche Änderung der Anlagepolitik dar.

Am 02. Juni 2023 wurden die Ergänzungen für den PIMCO Climate Bond Fund aktualisiert, um den Verzicht auf Verwaltungsgebühren zu ändern.

Am 30. Juni 2023 wurde die Ergänzung für den Euro Credit Fund aktualisiert, um den Verzicht auf die Verwaltungsgebühr in Höhe von 25 BPS für die Anteilsklasse H Institutional um ein Jahr auf den 30. Juni 2024 zu verlängern.

An der Gründungsurkunde und der Satzung der Gesellschaft wurden während des Berichtszeitraums keine Änderungen vorgenommen.

### 9. GEBÜHREN UND KOSTEN

#### (a) An die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Gebühren

Mit Ausnahme der BN Retail Shares, BM Retail Shares und BE Retail Shares, wie in der entsprechenden Ergänzung für den Fonds angegeben, darf die einheitliche Gebühr 2,50 % p. a. des NIW jedes Fonds nicht übersteigen.

#### (b) Verwaltungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder liefert für jeden Fonds, wie im Prospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste, für die jeder Fonds eine einzige Verwaltungsgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Verwaltungsgebühr (wie im Verkaufsprospekt definiert) für jeden Fonds läuft an jedem Handelstag (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die

Verwaltungsgesellschaft kann die Verwaltungsgebühr vollständig oder teilweise an die Anlageberatungsgesellschaften entrichten, um die von diesen erbrachten Anlageberatungs- und anderen Dienste zu bezahlen und damit die Anlageberatungsgesellschaften die Kosten für die Administrations-, Verwahr- und anderen Dienste begleichen können, die die Verwaltungsgesellschaft für die Fonds erbracht hat. Die Verwaltungsgebühr für die einzelnen Klassen der einzelnen Fonds (angegeben in Prozent pro Jahr ihres NIW) lautet wie folgt:

Klassen Inst'1, G Inst'1, Inv, Admin (%)	H Inst'1 (%)	T Class (%)	BE Retail BM Retail BN Retail E Class, G Retail, M Retail, N Retail, R Class (%)			W Class (%)
			R			
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	0,65	0,82	1,55	k. A.	k. A.	
Asia Strategic Interest Bond Fund	0,65	k. A.	1,50	k. A.	k. A.	
PIMCO Capital Securities Fund	0,79	k. A.	1,69	0,93	k. A.	
PIMCO Climate Bond Fund <sup>(1)</sup>	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.	
Commodity Real Return Fund	0,74	0,91	1,64	k. A.	k. A.	
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	0,90	k. A.	1,80	k. A.	k. A.	
Diversified Income Fund	0,69	0,86	1,59	k. A.	0,55	
Diversified Income Duration Hedged Fund	0,69	k. A.	1,59	k. A.	k. A.	
Diversified Income ESG Fund	0,72	k. A.	1,62	k. A.	k. A.	
Dynamic Bond Fund	0,90	1,07	1,80	0,99	k. A.	
Dynamic Multi-Asset Fund	0,85	1,02	1,85	k. A.	k. A.	
Emerging Local Bond Fund	0,89	1,06	1,89	k. A.	k. A.	
Emerging Local Bond ESG Fund	0,92	k. A.	1,92	k. A.	k. A.	
Emerging Markets Bond Fund	0,79	0,96	1,69	k. A.	k. A.	
Emerging Markets Bond ESG Fund	0,89	k. A.	1,74	k. A.	k. A.	
Emerging Markets Corporate Bond Fund	0,95	k. A.	1,85	k. A.	k. A.	
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund <sup>(2)</sup>	0,95	k. A.	1,85	k. A.	k. A.	
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	0,85	k. A.	1,75	k. A.	k. A.	
PIMCO ESG Income Fund	0,59	k. A.	1,49	0,82	k. A.	
Euro Bond Fund	0,46	k. A.	1,36	k. A.	k. A.	
Euro Credit Fund <sup>(3)</sup>	0,46	0,38	1,36	k. A.	k. A.	
Euro Income Bond Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.	
Euro Long Average Duration Fund	0,46	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	
Euro Short-Term Fund <sup>(4)</sup>	0,29	k. A.	1,04	k. A.	k. A.	
PIMCO European High Yield Bond Fund	0,55	k. A.	1,45	k. A.	k. A.	
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund <sup>(5)</sup>	0,32	0,49	0,82	k. A.	k. A.	
Global Advantage Fund	0,70	k. A.	1,70	k. A.	k. A.	
Global Bond Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	0,39	
Global Bond ESG Fund	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.	
Global Bond Ex-US Fund	0,49	0,66	1,39	k. A.	k. A.	
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	0,95	1,12	2,15	k. A.	k. A.	
Global High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.	
Global Investment Grade Credit Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	0,39	
Global Investment Grade Credit ESG Fund	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.	
Global Low Duration Real Return Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.	
Global Real Return Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	k. A.	
Income Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.	
Income Fund II	0,59	k. A.	1,49	k. A.	k. A.	
Inflation Multi-Asset Fund	0,79	0,96	1,69	k. A.	k. A.	

	Klassen Inst'l, G Inst'l, Inv, Admin (%)		BE Retail, BM Retail, BN Retail, E Class, G Retail, M Retail, N Retail, T Class (%)		R Class (%)		W Class (%)	
		H Inst'l (%)						
Low Average Duration Fund	0,46	0,63	1,36		0,75			k. A.
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	0,49	k. A.	1,39		k. A.			k. A.
Low Duration Income Fund <sup>(6)</sup>	0,55	0,72	1,45		k. A.			k. A.
Low Duration Opportunities Fund	0,49	k. A.	1,20		k. A.			k. A.
Low Duration Opportunities ESG Fund	0,52	k. A.	k. A.		k. A.			k. A.
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	0,99	k. A.	1,89		k. A.			k. A.
Mortgage Opportunities Fund	0,69	0,86	1,59		k. A.			k. A.
StocksPLUS™ Fund	0,55	0,72	1,45		k. A.			k. A.
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	0,69	k. A.	k. A.		k. A.			k. A.
Strategic Income Fund	0,79	k. A.	1,69		k. A.			k. A.
Total Return Bond Fund	0,50	0,67	1,40		0,77			k. A.
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	1,40	1,57	2,50		k. A.			k. A.
UK Corporate Bond Fund	0,46	k. A.	k. A.		k. A.			k. A.
UK Long Term Corporate Bond Fund	0,46	k. A.	k. A.		k. A.			k. A.
US High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45		0,80			k. A.
US Investment Grade Corporate Bond Fund	0,49	0,66	1,39		k. A.			k. A.
US Short-Term Fund <sup>(7)</sup>	0,45	0,62	0,85		k. A.			k. A.

<sup>(1)</sup> Diese Zahl berücksichtigt einen Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsstelle mit einem Satz von 0,05 % in Bezug auf die Investor Class vom 31. Mai 2021 bis zum 31. Mai 2023. Der Gebührenverzicht endete am 1. Juni 2023.

<sup>(2)</sup> Bei allen Klassen wird bei dieser Zahl ein Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsstelle in Höhe von 0,15 % p. a. berücksichtigt. (Vor dem 1. Juni 2023 betrug der Verzicht auf die Gebühr 0,30 % p. a.) Der Verzicht auf die Gebühr läuft zum 1. Juni 2024 ab und kann bis zu dem Zeitpunkt verlängert werden, zu dem die Verwaltungsstelle durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilhaber des Fonds entscheidet, diese Gebühr aufzuheben oder künftig nicht mehr anzuwenden.

<sup>(3)</sup> Bei der Klasse H Institutional wird ein Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,25 % p. a. berücksichtigt. Der Verzicht auf die Gebühr wird bis zum 30. Juni 2024 verlängert und läuft zum 1. Juli 2024 ab.

<sup>(4)</sup> In den Gebühren der Klassen Institutional Class und E Class wird ein Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsstelle in Höhe von 0,11 % p. a. bis zum 31. Mai 2021 berücksichtigt. Der Gebührenverzicht endet am 19. Januar 2024.

<sup>(5)</sup> Bei den Klassen Institutional und H Institutional Class wird bei dieser Zahl ein Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsstelle in Höhe von 0,14 % p. a. berücksichtigt. Bei der Klasse E wird ein Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsstelle in Höhe von 0,54 % p. a. berücksichtigt. Der Verzicht auf die Gebühr läuft am 18. Januar 2024 ab.

<sup>(6)</sup> Bei allen Klassen wird bei der Zahl der Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsstelle in Höhe von 0,05 % p. a. berücksichtigt. Der Verzicht wird bis zu dem Zeitpunkt verlängert, zu dem die Verwaltungsstelle durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilhaber des Fonds entscheidet, diese Gebühr künftig nicht mehr erheben oder zu reduzieren.

<sup>(7)</sup> In den Gebühren für die Anteilsklassen E Class, G Retail und M Retail wird ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,30 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht wird bis zu dem Zeitpunkt verlängert, zu dem die Verwaltungsgesellschaft durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilhaber des Fonds entscheidet, diese Gebühr künftig nicht mehr zu erheben oder zu reduzieren.

Die Verwaltungsgebühren für alle Fonds (mit Ausnahme der Fonds Inflation Multi-Asset Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund und Strategic Income Fund) blieben während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 unverändert, mit Ausnahme der vorstehend aufgeführten Änderungen bezüglich des Verzichts auf die Gebühr.

Die Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen H Institutional, BE Retail, BM Retail, BN Retail, E Class, G Retail, M Retail, N Retail und T Class fällt allgemein höher aus als die Verwaltungsgebühr für die anderen Anteilsklassen. Aus dieser höheren Gebühr kann die Verwaltungsgesellschaft die Kosten für Vertriebs-, Mittler- oder andere Dienste begleichen, die Vertriebsstellen, Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder andere Intermediäre den Anteilhabern dieser Anteilsklassen der Fonds direkt oder indirekt erbringen. Da es sich bei der Verwaltungsgebühr um einen festen Betrag handelt, wird das Risiko von Preiserhöhungen bei den Kosten für durch die Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste von der Verwaltungsgesellschaft und nicht von den Anteilhabern getragen. Die

Verwaltungsgesellschaft trägt darüber hinaus das Risiko, dass das Ausgabenniveau für diese Dienste aufgrund eines sinkenden Nettovermögens die Höhe der Verwaltungsgebühr übersteigt. Auf der anderen Seite können alle Preissenkungen für von der Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste der Verwaltungsgesellschaft und nicht den Anteilhabern zugute. Dies betrifft u.a. geringere Kosten (in Prozent des Nettovermögens) aufgrund eines steigenden Nettovermögens.

Aufgrund der Art der Emission von Z Class wird in der Betriebsergebnisrechnung keine Verwaltungsgebühr ausgewiesen (die Class Z werden primär für andere Fonds der Gesellschaft oder für Direktanlagen durch institutionelle Anleger angeboten, die mit den Anlageberatungsgesellschaften oder einem verbundenen Unternehmen von PIMCO eine Anlageverwaltungsvereinbarung oder sonstige Vereinbarung abgeschlossen haben). Um doppelte Gebühren zu vermeiden, wird die Verwaltungsgebühr für die Z Class auf 0,00 % pro Jahr festgesetzt.

#### (c) Anlageberatungsdienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Anlageberatungsdienstleistungen. Zu diesen Dienstleistungen gehören die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte jedes Fonds. Die Gebühren der Anlageberatungsgesellschaften (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr beglichen.

#### (d) Administrations-, Verwahr- sowie sonstige Dienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste. Diese Dienste beinhalten Administrations-, Übertragungsstellen-, Fondsbuchhaltungs-, Verwahr- und Unterverwahrstellen für die jeweiligen Fonds. Die Gebühren und Aufwendungen des Administrators und der Verwahrstelle (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr bzw. von den Anlageberatungsgesellschaften gezahlt.

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft bestimmte sonstige Dienste. Diese können enthalten: Dienste von Notierungsmaklern, Zahlstellen und anderen Vertretern vor Ort sowie Buchhaltungs-, Prüf-, Rechts- sowie sonstige Dienste qualifizierter Berater, Gesellschaftssekretärsdienste, Druck-, Veröffentlichungs- und Übersetzungsdienste sowie die Erbringung und Koordination bestimmter Aufsichts-, Administrations- und Anteilhaberdienste, die für den Betrieb der Fonds erforderlich sind. Gebühren und ordentliche Aufwendungen für diese Dienste (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften für die Verwaltungsgebühr gezahlt.

Die Fonds übernehmen sonstige Aufwendungen im Zusammenhang mit ihrem Betrieb, die nicht von der Verwaltungsgebühr abgedeckt werden und die variieren und die Gesamthöhe der Aufwendungen der Fonds beeinflussen können. Hierzu zählen unter anderem Steuern und staatliche Abgaben, Maklergebühren, Provisionen und sonstige Transaktionskosten (einschließlich u. a. Gebühren und Aufwendungen im Zusammenhang mit Due-Diligence-Prüfungen von Anlagen und potenziellen Anlagen und/oder im Zusammenhang mit Verhandlungen über solche Transaktionen), Fremdfinanzierungskosten einschließlich Zinsaufwand, Gründungskosten, außerordentliche Aufwendungen (wie Prozesskosten und Schadenersatzleistungen) sowie die Gebühren und Aufwendungen der unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sowie ihrer Berater.

Die Gesellschaft bezahlte den unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2023 Honorare in Höhe von 90.000 EUR (30. Juni 2022: 90.000 EUR). Darüber hinaus werden jedem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied alle angemessenen Auslagen erstattet. Nicht unabhängige Verwaltungsratsmitglieder haben keinen Anspruch auf eine separate Vergütung für ihre Verwaltungsmandate der Gesellschaft. Die Verwaltungsratsgehälter sind in den „Sonstigen Aufwendungen“ der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

**Servicegebühr** Die Servicegebühr, die ausschließlich für die Investor Classes anfällt, ist an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen und darf verwendet werden, um Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu vergüten, die Dienste im Zusammenhang mit dem Vertrieb und der Vermarktung von Anteilen erbringen und/oder für die Erbringung bestimmter Anteilhaberdienstleistungen oder für die Verwaltung von Plänen oder Programmen, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, und um sonstige verbundene Aufwendungen (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) zu erstatten. Die Verwaltungsgesellschaft erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Anteilhaber der Investor Classes. Alle Anteilhaber der Investor Classes erhalten identische Dienstleistungen für die erhobenen Gebühren. Diese Dienste können beinhalten: die Beantwortung von



Anteilinhaber anfragen zu den Fonds und ihrer Wertentwicklung, die Unterstützung von Anteilhabern beim Erwerb, der Rücknahme und dem Tausch von Anteilen, die Führung von individueller Kontoinformationen und die Bereitstellung von Kontoauszügen an die Anteilhaber sowie die Führung sonstiger Unterlagen, die für die Anlage der Anteilhaber im Fonds relevant sind.

Pläne oder Programme, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, können fondsgebundene Versicherungsprodukte sowie Pensions-, Altersversorgungs- oder Sparpläne von Arbeitgebern beinhalten. Alle Anteilhaber der Investor Classes erhalten Dienstleistungen entsprechend der Vereinbarungen mit den Finanzintermediären, mit denen die Anteilhaber ein Dienstleistungsverhältnis unterhalten. Die Servicegebühr errechnet sich jährlich aus 0,35 % des NIW des jeweiligen Fonds, der auf die Investor Classes entfällt. Die Servicegebühren bleiben während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 unverändert. Die Servicegebühr wird aus dem NIW gezahlt, der auf den NIW der Investor Classes dieser Fonds entfällt. Die Servicegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Servicegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

**Bestandspflegegebühr:** Die Bestandspflegegebühr für Administrative-Klassen ist zahlbar an die Vertriebsstelle für persönliche Dienste, die sie den Anteilhabern der Fonds erbringt, und für die Führung der Anteilhaberkonten, einschließlich der Vergütung und der Aufwendungen (einschließlich Telefon- und Gemeinkosten) von Finanzberatern und sonstigen Mitarbeitern beteiligter oder involvierter Händler, bestimmter Banken oder anderer Finanzintermediäre, die bei der Abwicklung von Kauf- oder Rücknahmeanträgen oder der Abwicklung von Dividendenzahlungen unterstützend tätig sind, den Anteilhabern regelmäßig Informationen über ihre Beteiligung an den Fondsanteilen liefern, Informationen von der Gesellschaft an die Anteilhaber weitergeben, laufende Beratungsleistungen in Bezug auf die Eignung bestimmter vom Fonds angebotener Anlagemöglichkeiten vor dem Hintergrund der Anteilhaberanforderungen erbringen, Anfragen der Anteilhaber zu diesen Diensten beantworten und Mitarbeiter für die Erbringung derartiger Dienste schulen.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Administrative-Klassen. Die Bestandspflegegebühr wird auf der Grundlage von jährlich 0,50 % des NIW jedes Fonds berechnet, mit Ausnahme des StocksPLUS™ Fund, dessen Berechnung auf der Grundlage von jährlich 0,75 % erfolgt und der den Administrative-Klassen zuzuordnen ist. Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Bestandspflegegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Die Bestandspflegegebühren blieben während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 unverändert.

### (e) Vertriebsgebühr

Die Vertriebsgebühr, die für die Klassen T Class Shares, BN Retail Shares, BM Retail Shares und BE Retail Share anwendbar ist, wird an die Vertriebsstelle für Dienste bezahlt, die diese Anteilhabern des Fonds erbracht hat.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Anteilklassen der T Class. Die Vertriebsgebühr errechnet sich aus 0,40 % p. a. des NIW des jeweiligen Fonds, der auf die Klassen der T Class entfällt, außer in Bezug auf den PIMCO Asia High Yield Bond Fund, PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, Dynamic Bond Fund, Euro Bond Fund, Global Bond Fund, Global Bond ESG Fund, Global Bond Ex-US Fund, Global Low Duration Real Return Fund, Global Real Return Fund, Low Duration Opportunities Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund und Total Return Bond Fund. Für diese Fonds wird eine Vertriebsgebühr in Höhe von 0,30 % p. a. auf den NIW der Anteile der T Class dieser Fonds bezahlt.

Nur in Bezug auf die Anteilklassen BE Retail, BM Retail und BN Retail kann die Vertriebsgebühr, sofern in der entsprechenden Ergänzung angegeben, bis zu 1 % des NIW betragen. Daher kann die Vertriebsgebühr 2,50 % des NIW übersteigen.

Die Vertriebsgebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Vertriebsgebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

### (f) Ausgabenbegrenzung (einschließlich Verzicht auf und Nachzahlung von Verwaltungsgebühren)

Gemäß der geltenden Fassung des Verwaltungsvertrags zwischen der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft vom 28. Januar 1998 ist die Verwaltungsgesellschaft mit der Gesellschaft übereingekommen, die gesamten jährlichen Betriebskosten eines Fonds für alle Klassen des Fonds zu verwalten, wobei sie auf ihre Verwaltungsgebühr ganz oder teilweise verzichtet bzw. diese ganz oder teilweise reduziert oder erstattet, falls (und für den Zeitraum, in dem) diese Betriebskosten aufgrund gezahlter Gründungskosten sowie anteiliger Verwaltungsrats honorare die Summe aus der Verwaltungsgebühr der Klasse dieses Fonds (vor Anrechnung eines etwa anwendbaren Verzichts auf die Verwaltungsgebühr) aus etwa anfallenden Dienste- und Bestandspflegegebühren sowie aus sonstigen von dieser Fondsklasse zu tragenden Kosten, die die oben beschriebene Verwaltungsgebühr nicht abdeckt (ausgenommen Gründungskosten und anteilige Verwaltungsrats honorare) zzgl. 0,0049 % p. a. (täglich auf Basis des Fonds-NIW berechnet) überschreiten.

In jedem Monat, in dem der Verwaltungsvertrag gilt, darf die Verwaltungsgesellschaft von einem Fonds einen beliebigen Anteil der Verwaltungsgebühr wiedererlangen, auf die sie verzichtet, die sie reduziert oder erstattet hat, und dies gemäß dem Verwaltungsvertrag (der „Erstattungsbetrag“) während der vorangegangenen 36 Monate, vorausgesetzt dieser an die Verwaltungsgesellschaft gezahlte Betrag erfüllt folgende Bedingungen: 1) er darf 0,0049 % p. a. vom durchschnittlichen (täglich berechneten) Nettovermögen der Klasse des betreffenden Fonds nicht überschreiten; 2) er liegt nicht über dem Gesamterstattungsbetrag; 3) enthält keine der Verwaltungsgesellschaft zuvor erstatteten Beträge; bzw. 4) führt nicht dazu, dass eine Klasse eines Fonds einen negativen Ertrag behält.

Die in der Betriebsergebnisrechnung angegebene Verwaltungsgebühr wird vor Berücksichtigung des jeweils gegebenenfalls gewährten Verzichts auf Verwaltungsgebühren angegeben. Die Verzichte auf Verwaltungsgebühren werden in der Betriebsergebnisrechnung unter Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen. Die Verwaltungsgebühr wird der Verwaltungsgesellschaft nach Berücksichtigung des Verzichts gezahlt.

## 10. TRANSAKTIONEN ZWISCHEN VERBUNDENEN PARTEIEN

Bei der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften, den Vertriebsstellen und den Verwaltungsratsmitgliedern handelt es sich um verbundene Parteien der Gesellschaft. An diese Parteien gegebenenfalls zahlbare Gebühren werden in Erläuterung 9 offengelegt.

Zum 30. Juni 2023 hielt die Verwaltungsgesellschaft 1.162.694 (31. Dezember 2022: 1.786.291) Anteile des US Short-Term Fund.

Jeder Fonds kann in anderen Fonds der Gesellschaft und/oder anderen Organismen für gemeinsame Anlagen anlegen, die von der Vertriebsstelle oder von mit der Vertriebsstelle verbundenen Entitäten verwaltet werden („verbundener Fonds“).

Die folgenden Fonds hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Fonds der Gesellschaft eliminiert.

	30. Jun. 2023
<b>Fonds</b>	<b>Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds</b>
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Local Bond Fund	Emerging Local Bond ESG Fund

30. Jun. 2023	
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Low Duration Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Low Duration Opportunities Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Die folgenden Fonds hielten zum 31. Dezember 2022 Umbrella-fonds-interne Überkreuzinvestitionen. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft im vergleichenden Finanzstatus der Fonds eliminiert.

31. Dez. 2022	
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Local Bond Fund	Emerging Local Bond ESG Fund
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund

31. Dez. 2022	
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Low Duration Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Low Duration Opportunities Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Die folgenden Fonds hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft in der vergleichenden Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen der Fonds eliminiert.

30. Jun. 2022	
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Emerging Markets Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Euro Income Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Libor Plus Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Libor Plus Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund

Einige Fonds legen in die Z Class des PIMCO China Bond Fund (ein Teilfonds von PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c.) und PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (ein Teilfonds von PIMCO Select Funds plc), die als verbundene Fonds gelten. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Z Class und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Z Class beider Fonds 0,00 % pro Jahr.



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Einige Fonds legen in die Teilfonds von PIMCO ETFs plc an: PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF, PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF und PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF; diese gelten als verbundene Fonds. Da diese Fonds keine gebührenfreien Anteilsklassen haben, wird die Verwaltungsgebühr vom anliegenden Fonds und dem zugrunde liegenden verbundenen Zielfonds bezahlt. Ein Verzicht auf die Anlageberatungsgebühr wird daher vor der Zahlung durch den Fonds an die Verwaltungsgesellschaft ausgeglichen, was in der Betriebsergebnisrechnung innerhalb der Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen wird.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 kauften und verkauften die unten angegebenen Fonds Wertpapiere verbundener Fonds und tätigten Käufe und Verkäufe in Bezug auf Überkreuzinvestitionen sowie Käufe und Verkäufe von Anlagen in verbundenen Fonds (Angaben in Tausend):

Fonds	30. Jun. 2023	
	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 423.569	\$ 391.337
Asia Strategic Interest Bond Fund	92.981	99.053
PIMCO Capital Securities Fund	115.634	34.102
PIMCO Climate Bond Fund	294	5.057
Commodity Real Return Fund	549	0
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	6.342	6.452
Diversified Income Fund	262.747	405.020
Diversified Income Duration Hedged Fund	9.813	20.783
Diversified Income ESG Fund	5.821	833
Dynamic Bond Fund	78.348	82.000
Dynamic Multi-Asset Fund	5.681	97.503
Emerging Local Bond Fund	1.053.732	924.477
Emerging Markets Bond Fund	925.922	895.848
Emerging Markets Bond ESG Fund	12.330	11.043
Emerging Markets Corporate Bond Fund	35.549	35.460
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	112.961	116.241
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	101	199
Euro Bond Fund	53.170	107.866
Euro Credit Fund	3.412	416
Euro Income Bond Fund	3.560	25.568
Euro Long Average Duration Fund	22.448	12.114
Euro Short-Term Fund	0	19.129
PIMCO European High Yield Bond Fund	17.655	3.018
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	16.916	38.750
Global Advantage Fund	89.176	85.406
Global Bond Fund	611.120	554.590
Global Bond ESG Fund	11.942	7.052
Global Bond Ex-US Fund	230.398	227.009
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	125.641	140.601
Global High Yield Bond Fund	240.825	313.197
Global Investment Grade Credit Fund	291.803	313.554
Global Investment Grade Credit ESG Fund	106.586	14.830
Global Low Duration Real Return Fund	264.567	276.800
Global Real Return Fund	253.215	250.100
Income Fund	1.014.864	682.726
Income Fund II	60.466	54.600
Inflation Multi-Asset Fund	52.735	59.781
Low Average Duration Fund	161.690	201.129
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	159.590	142.383
Low Duration Income Fund	62.826	24.129
Low Duration Opportunities Fund	176.229	206.029
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	1.116	3.600
Mortgage Opportunities Fund	0	665
StocksPLUS™ Fund	78.848	8.600
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	412	200
Strategic Income Fund	110.199	116.600
Total Return Bond Fund	705.326	744.063
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	141.935	153.703
UK Corporate Bond Fund	13.291	7.714

Fonds	30. Jun. 2023	
	Käufe	Verkäufe
UK Long Term Corporate Bond Fund	\$ 12.962	\$ 1.046
US High Yield Bond Fund	441.483	425.114
US Investment Grade Corporate Bond Fund	9.748	4.779
US Short-Term Fund	51.202	103.402

Fonds	30. Jun. 2022	
	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 450.898	\$ 528.533
Asia Strategic Interest Bond Fund	82.359	82.711
PIMCO Capital Securities Fund	80.074	524.621
PIMCO Climate Bond Fund	449	17.338
Commodity Real Return Fund	79.289	0
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	3.412	5.157
Diversified Income Fund	303.492	1.096.849
Diversified Income Duration Hedged Fund	30.777	86.520
Dynamic Bond Fund	105.264	171.389
Dynamic Multi-Asset Fund	647	0
Emerging Local Bond Fund	886.434	905.374
Emerging Markets Bond Fund	476.521	763.429
Emerging Markets Bond ESG Fund	185.351	65.552
Emerging Markets Corporate Bond Fund	50.466	53.126
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	72.028	68.693
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	796	952
Euro Bond Fund	255.645	189.222
Euro Credit Fund	80.048	111.228
Euro Income Bond Fund	209.995	297.005
Euro Long Average Duration Fund	5.104	4.123
Euro Short-Term Fund	30.546	42.154
PIMCO European High Yield Bond Fund	4.107	6.694
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	34.936	36.870
Global Advantage Fund	91.947	77.527
Global Bond Fund	785.238	769.426
Global Bond ESG Fund	3.729	730
Global Bond Ex-US Fund	330.925	295.371
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	526.757	648.111
Global High Yield Bond Fund	634.659	964.028
Global Investment Grade Credit Fund	1.864.705	2.994.709
Global Investment Grade Credit ESG Fund	59.019	63.891
Global Low Duration Real Return Fund	114.718	122.898
Global Real Return Fund	352.063	281.345
Income Fund	632.501	1.884.444
Income Fund II	3.404	3.000
Inflation Multi-Asset Fund	47.808	9.500
Low Average Duration Fund	315.626	247.122
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	182.053	155.605
Low Duration Income Fund	115.594	151.082
Low Duration Opportunities Fund	83.207	71.406
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	16.121	13.400
Mortgage Opportunities Fund	826.458	912.334
StocksPLUS™ Fund	30.955	317.619
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	201	400
Strategic Income Fund	139.264	118.155
Total Return Bond Fund	363.416	571.790
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	28.707	21.000
UK Corporate Bond Fund	7.714	6.714
UK Long Term Corporate Bond Fund	6.832	10.266
US High Yield Bond Fund	720.899	966.445
US Investment Grade Corporate Bond Fund	151.908	163.585
US Short-Term Fund	415.891	385.870

In der folgenden Tabelle ist Wert der umlaufenden Anteile im Besitz der Allianz-Gruppe, von Fonds der Gesellschaft, von verbundenen Fonds und von Mitarbeitern der Anlageberatungsgesellschaften in ihrer Eigenschaft als verbundene Parteien der Gesellschaft angegeben. Dabei handelt es sich zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 um über 20 % des Nettovermögens des Fonds.

Fonds	30. Juni 2023 % gehalten	31. Dez. 2022 % gehalten
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	k. A.	21,53
Asia Strategic Interest Bond Fund	50,72	49,24
PIMCO Capital Securities Fund	23,13	23,94
PIMCO Climate Bond Fund	k. A.	21,78
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	23,15	25,65
Diversified Income ESG Fund	100,00	100,00
Dynamic Multi-Asset Fund	25,09	25,10
Emerging Local Bond ESG Fund	94,33	100,00
Emerging Markets Bond Fund	23,64	22,87
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	51,79	57,57
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	27,64	26,22
Euro Credit Fund	30,97	30,16
Euro Income Bond Fund	24,12	21,29
PIMCO European High Yield Bond Fund	68,63	98,78
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	24,76	31,55
Global Bond Ex-US Fund	20,34	k. A.
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	61,38	65,44
Income Fund II	24,31	40,67
Inflation Multi-Asset Fund	25,80	29,48
Low Duration Opportunities ESG Fund	100,00	100,00
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	53,38	50,65
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	83,32	84,86
Strategic Income Fund	46,61	47,13
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	20,69	k. A.
US Short-Term Fund	32,29	31,95

Zum 30. Juni 2023 hielt der Income Fund 9.694 Schuldverschreibungen (31. Dezember 2022: 9.694 Schuldverschreibungen) von BNP Paribas Issuance BV, die durch Schuldverschreibungen besichert ist, die von der Repack Bond Collateral Ltd. (die „Körperschaft“) ausgegeben werden., eine nach dem Recht der Kaimaninseln gegründete befreite Gesellschaft mit beschränkter Haftung, die eine verbundene Partei der Anlageberatungsgesellschaft ist. Es wurden keine Gebühren von der Körperschaft an die Anlageberatungsgesellschaft gezahlt.

#### Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs an Anteilen und Verträgen

Zum 30. Juni 2023 hielt V. Mangala Ananthanarayanan 8.187,77 (31. Dezember 2022: 8.187,77) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 5.319,15 (31. Dezember 2022: 5.319,15) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 8.757,87 (31. Dezember 2022: 8.757,87) Anteile des Dynamic Multi-Asset Fund, 3.619,69 (31. Dezember 2022: 3.619,69) Anteile des Global Bond Fund und 27.543,65 (31. Dezember 2022: 27.543,65) Anteile des Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2023 hielt Ryan P. Blute 5.387,93 (31. Dezember 2022: 5.387,93) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 105.514,79 (31. Dezember 2022: 24.131,27) Anteile des Low Average Duration Fund und 215.070,39 (31. Dezember 2022: 82.494,63) Anteile des Low Duration Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2023 hielt Craig A. Dawson 18.118,23 (31. Dezember 2022: 18.118,23) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 97.370,98 (31. Dezember 2022: 97.370,98) Anteile des Low Duration Income Fund und 92.850,51 (31. Dezember 2022: 92.850,51) Anteile des Low Duration Opportunities Fund; bei allen Fonds handelt es sich um Fonds der Gesellschaft.

Zum 30. Juni 2023 hielt David M. Kennedy 4.316,08 (31. Dezember 2022: 4.449,56) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 16.786,79 (31. Dezember 2022: 16.786,79) Anteile des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund. Beide sind Fonds der Gesellschaft.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 oder 30. Juni 2022 hielt kein anderes Verwaltungsratsmitglied eine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 oder 30. Juni 2022 hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 oder zum 30. Juni 2022 beschäftigte die Gesellschaft keine Mitarbeiter.

## 11. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Transaktionen, die mit der Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle eines OGAW, den Beauftragten oder Unterbeauftragten einer solchen Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle (unter Ausschluss von konzernfremden, von einer Verwahrstelle bestellten Unterverwahrstellen) oder angeschlossenen Unternehmen oder Konzerngesellschaften einer solchen Verwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle oder von entsprechenden Beauftragten oder Unterbeauftragten („verbundene Personen“) durchgeführt werden, müssen so durchgeführt werden, als wären sie sie unter gewöhnlichen geschäftlichen Bedingungen ausgehandelt worden, und nur dann, wenn sie im besten Interesse der Anteilhaber sind. Der Verwaltungsrat ist davon überzeugt, dass Vorkehrungen (durch schriftliche Verfahren nachgewiesen) getroffen wurden, um sicherzustellen, dass Transaktionen mit verbundenen Parteien wie oben beschrieben durchgeführt werden, und dass diese Vorkehrungen während des Berichtszeitraums eingehalten wurden.

## 12. WECHSELKURSE

Um einen gemeinsamen Abschluss für die Fonds und Finanzdaten für die Gesellschaft zu erhalten (was nach irischem Gesellschaftsrecht erforderlich ist), wurden die Beträge in der Aufstellung der Aktiva und Passiva zu dem am 30. Juni 2023 geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/0,91659 EUR) (31. Dezember 2022: USD/0,93699 EUR) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/0,78657 GBP) (31. Dezember 2022: USD/0,83132 GBP) umgerechnet. Die Beträge in der Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen wurden zu einem durchschnittlichen, für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/0,92567 EUR) (30. Juni 2022: USD/0,91527 EUR) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/0,81121 GBP) (30. Juni 2022: USD/0,77097 GBP) umgerechnet.

In der folgenden Tabelle sind die Wechselkurse angegeben, die zur Umrechnung der Anlagen und sonstigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf von der Funktionswährung des jeweiligen Fonds abweichende Währungen lauten, in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar (die Funktionswährungen von Fonds der Gesellschaft) verwendet wurden.

Der Wechselkurs für den Argentinischen Peso („ARS“) zum 30. Juni 2023 enthält einen 97%igen Abschlag (31. Dezember 2022: 83 %) aufgrund der Abweichung zwischen dem offiziellen und dem inoffiziellen Wechselkurs Argentiniens.

Fremd- währung	30. Juni 2023 Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67305
ARS	280,08777	k. A.	256,72565
AUD	1,63900	1,90994	1,50229
BRL	5,26299	k. A.	4,82400
CAD	1,44367	1,68231	1,32325
CHF	0,97606	k. A.	0,89465
CLP	875,14592	k. A.	802,15000
CNH	7,93681	9,24882	7,27480
CNY	7,92508	k. A.	7,26405
COP	4555,77194	k. A.	4175,77500
CZK	23,75855	k. A.	21,77685
DKK	7,44591	8,67678	6,82485
DOP	k. A.	k. A.	55,09000
EGP	k. A.	k. A.	30,90000
EUR (or €)	k. A.	1,16531	0,91659
GBP (or £)	0,85814	1,00000	0,78657
GHS	k. A.	k. A.	11,37500
HKD	8,54973	k. A.	7,83660
HUF	373,00014	k. A.	341,88820
IDR	16356,82257	k. A.	14992,50000
ILS	4,04865	k. A.	3,71095
INR	89,50158	k. A.	82,03625
JPY (or ¥)	157,68773	183,75468	144,53500
KES	k. A.	k. A.	140,60000
KRW	1437,55660	k. A.	1317,65000
KZT	k. A.	k. A.	450,85500
MXN	18,71120	21,80430	17,15050

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fremd- währung	30. Juni 2023		
	Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
MYR	k. A.	k. A.	4,66750
NGN	k. A.	k. A.	765,50000
NOK	11,68849	13,62068	10,71355
NZD	1,78079	2,07517	1,63225
PEN	3,95466	k. A.	3,62480
PHP	k. A.	k. A.	55,19950
PLN	4,43268	k. A.	4,06295
RON	k. A.	k. A.	4,54560
RSD	k. A.	k. A.	107,50000
RUB	97,64453	k. A.	89,50000
SEK	11,78422	13,73224	10,80130
SGD	1,47651	1,72058	1,35335
THB	k. A.	k. A.	35,45500
TRY	28,44238	33,14411	26,07000
TWD	33,97866	k. A.	31,14450
UGX	k. A.	k. A.	3675,00000
USD (or \$)	1,09100	1,27135	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	37,37500
VND	k. A.	k. A.	23585,00000
ZAR	20,61036	24,01740	18,89125
ZMW	k. A.	k. A.	17,57500

Fremd- währung	31. Dez. 2022		
	Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67265
ARS	346,74937	k. A.	324,90000
AUD	1,57377	1,77380	1,47460
BRL	5,63481	k. A.	5,27975
CAD	1,44607	1,62987	1,35495
CHF	0,98742	k. A.	0,92520
CLP	909,24323	k. A.	851,95000
CNH	7,38414	8,32269	6,91885
CNY	7,41920	8,36220	6,95170
COP	5.174,97022	k. A.	4.848,88500
CZK	24,15399	k. A.	22,63200
DKK	7,43643	8,38163	6,96785
DOP	k. A.	k. A.	56,22000
EGP	k. A.	k. A.	24,75500
EUR (or €)	1,00000	1,12710	0,93699
GBP (or £)	0,88723	1,00000	0,83132
GHS	k. A.	k. A.	10,20000
HKD	8,32983	k. A.	7,80495
HUF	400,44985	k. A.	375,21670
IDR	16.614,40701	k. A.	15.567,50000
ILS	3,76579	k. A.	3,52850
INR	88,29355	k. A.	82,73000
JPY (or ¥)	140,81824	158,71670	131,94500
KES	k. A.	k. A.	123,40000
KRW	1.349,53703	k. A.	1.264,50000
KZT	k. A.	k. A.	462,72000
MXN	20,79776	23,44122	19,48725
MYR	k. A.	k. A.	4,40500
NGN	k. A.	k. A.	460,75000
NOK	10,51348	11,84977	9,85100
NZD	1,68748	1,90197	1,58115
PEN	4,06996	k. A.	3,81350
PHP	k. A.	k. A.	55,72750
PLN	4,68122	k. A.	4,38625
RON	k. A.	k. A.	4,63605
RSD	k. A.	k. A.	109,92500
RUB	77,90922	k. A.	73,00000
SEK	11,12021	12,53362	10,41950
SGD	1,43140	1,61333	1,34120

Fremd- währung	31. Dez. 2022		
	Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
THB	k. A.	k. A.	34,63500
TRY	19,97838	22,51769	18,71950
TWD	32,80245	k. A.	30,73550
UGX	k. A.	k. A.	3.720,00000
USD (or \$)	1,06725	1,20290	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	39,76500
VND	k. A.	k. A.	23.575,00000
ZAR	18,15925	k. A.	17,01500
ZMW	k. A.	k. A.	18,07500

### 13. FINANZIELLE RISIKEN

Durch ihre Aktivitäten sind die Fonds verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt, z. B. dem Marktrisiko (einschließlich Preisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), dem Kreditrisiko und dem Liquiditätsrisiko.

Der allgemeine Risikomanagementprozess für die Fonds konzentriert sich auf die Unvorhersehbarkeit der Finanzmärkte und versucht, potenziell nachteilige Effekte auf die finanzielle Entwicklung der Fonds zu minimieren. Weitere Einzelheiten zu den verschiedenen Risiken, denen der Fonds ausgesetzt sein kann, finden Sie im Prospekt.

Die Zielsetzungen und Richtlinien des Finanzrisikomanagements der Gesellschaft entsprechen auch weiterhin denjenigen, die im geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 angegeben sind.

### 14. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN FÜR DIE IN HONGKONG VERTRIEBENEN FONDS

Verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind jene, die im Code on Unit Trusts and Mutual Funds der Securities and Futures Commission of Hong Kong (der „SFC-Code“) definiert sind. Alle Transaktionen, die während des Geschäftsjahres zwischen den durch die SFC zugelassenen Fonds („durch die SFC zugelassene Fonds“), wie im Abschnitt zu den allgemeinen Merkmalen des Halbjahresberichts beschrieben, und der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften und/oder den Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und den Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft sowie deren jeweiligen verbundenen Personen eingegangen wurden, wurden im Rahmen der normalen Geschäftstätigkeit und zu den üblichen Geschäftsbedingungen abgeschlossen.

Die folgenden Transaktionen wurden in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 über einen Broker ausgeführt, bei dem es sich um eine verbundene Person der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft handelt:

Fonds	30. Jun. 2023		30. Jun. 2022	
	Summe Käufe und Verkäufe ('000)	% der Summe Käufe und Verkäufe	Summe Käufe und Verkäufe ('000)	% der Summe Käufe und Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 6.172.015	30,52	\$ 14.107.219	32,23
Asia Strategic Interest Bond Fund	153.280	12,91	416.002	20,01
Commodity Real Return Fund	528.194	2,04	1.806.911	5,27
Diversified Income Fund	11.268.415	3,34	9.713.714	6,03
Emerging Local Bond Fund	863.206	2,11	1.380.942	3,20
Emerging Markets Bond Fund	844.035	5,55	1.558.214	7,00
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	53.663	2,76	40.078	5,17
Global Bond Fund	6.877.936	2,10	2.405.893	1,08
Global High Yield Bond Fund	903.931	4,69	791.283	2,95
Global Investment Grade Credit Fund	5.551.222	3,04	1.014.463	0,97
Global Real Return Fund	356.843	0,81	569.391	0,71

Fonds	30. Jun. 2023		30. Jun. 2022	
	Summe Käufe und Verkäufe ('000)	% der Summe Käufe und Verkäufe	Summe Käufe und Verkäufe ('000)	% der Summe Käufe und Verkäufe
Income Fund	\$ 248.076.525	12,74	\$ 12.902.695	1,00
Income Fund II	3.030	0,41	214	0,07
Low Average Duration Fund	689.689	4,27	1.304.128	2,66
Total Return Bond Fund	1.936.170	3,62	1.095.290	1,49
US High Yield Bond Fund	886.047	16,59	705.505	6,87

In der folgenden Tabelle wurde in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 keine Provision für die Transaktionen erhoben.

Weitere Einzelheiten zu Aktien zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 durch Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft in durch die SFC zugelassenen Fonds gehalten wurden, finden Sie in Erläuterung 10. Weitere Einzelheiten zu den Gebühren, die in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 an Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft gezahlt wurden, finden Sie in Erläuterung 9.

Einzelheiten zum Wert der umlaufenden Anteile, die in den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 durch verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften gehalten wurden und über 20 % des Nettovermögens von durch die SFC zugelassenen Fonds betragen, sind Erläuterung 10 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die an die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften gezahlt wurden, sind Erläuterung 9 und der Betriebsergebnisrechnung zu entnehmen.

Verwaltungsratsmitglieder und leitende Angestellte der Verwahrstelle hielten in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 keine Anteile der durch die SFC zugelassenen Fonds. Wie in Erläuterung 9 angegeben, wurden die Gebühren und Aufwendungen der Verwahrstelle durch die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr oder durch die Anlageberatungsgesellschaften gezahlt. Alle Bankguthaben der durch die SFC zugelassenen Fonds werden entweder von State Street Bank and Trust Co. als Beauftragte der Verwahrstelle oder direkt bei einer Unterverwahrstelle gehalten. Gegebenenfalls wurden den durch die SFC zugelassenen Fonds durch die Verwahrstelle Zinsen auf diese Barsalden gezahlt oder berechnet.

## 15. GRUNDKAPITAL

### (a) Genehmigte Anteile

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft beträgt 38.092 EUR und ist in 30.000 Zeichneranteile zu je 1,27 EUR und 500.000.000.000 gewinnberechtigten Aktien ohne Nennwert aufgeteilt, die ursprünglich als „nicht klassifizierte Anteile“ bezeichnet wurden.

### (b) Zeichneranteile

Bis auf sieben sind die ursprünglichen 30.000 Zeichneranteile zurückgenommen worden. Die Zeichneranteile sind nicht Bestandteil des NIW der Gesellschaft und werden daher im Abschluss nur in Form dieser Erläuterung erwähnt. Nach Ansicht des Verwaltungsrates geben diese Offenlegungen die Art des Geschäftes der Gesellschaft als Investmentfonds wieder.

### (c) Rückgabe- und gewinnberechtigten Anteile

Das ausgegebene gewinnberechtigte Grundkapital entspricht jederzeit dem NIW der Fonds. Rückgabe- und gewinnberechtigten Anteile werden auf Antrag des Anteilinhabers zurückgenommen und sind als Finanzverbindlichkeiten klassifiziert.

## 16. NETTOINVENTARWERTE

Im Folgenden sind das rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhabern zuzuschreibende Nettovermögen der einzelnen Fonds, die ausgegebenen und umlaufenden Anteile und der Nettoinventarwert (NIW) je Anteil der letzten drei Jahre (Angaben in Tausend, ausgenommen Beträge je Anteil) aufgeführt. Der in diesem Abschluss angegebene NIW je Anteil kann gemäß FRS 102 erforderliche Anpassungen enthalten. Diese können dazu führen, dass die NIW oder Gesamtrenditen der Anteilinhaber von denjenigen abweichen, die in diesem Abschluss angegeben sind. Das Nettovermögen geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen und umlaufenden Anteile kann vom NIW aufgrund gerundeter Werte abweichen:

	Zum 30. Jun. 2023		Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021	
	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund</b>						
Nettovermögen	\$ 2.796.171	\$ 2.981.392	\$ 3.411.923			
Institutional:						
thesaurierend	\$ 1.649.343	\$ 1.552.047	\$ 1.221.240			
ausgegebene und umlaufende Anteile	186.773	174.453	117.953			
NIW je Anteil	\$ 8,83	\$ 8,90	\$ 10,35			
Erträge	\$ 113.417	\$ 113.734	\$ 248.734			
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.783	16.032	28.125			
NIW je Anteil	\$ 6,76	\$ 7,09	\$ 8,84			
Institutional AUD (Hedged):						
Erträge	AUD 2.594	AUD 203.422	AUD 12			
ausgegebene und umlaufende Anteile	385	28.372	1			
NIW je Anteil	AUD 6,74	AUD 7,17	AUD 9,00			
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 3.602	CHF 4.094	CHF 35.166			
ausgegebene und umlaufende Anteile	477	527	3.797			
NIW je Anteil	CHF 7,55	CHF 7,77	CHF 9,26			
Erträge	CHF 1.773	CHF 1.912	CHF 5.135			
ausgegebene und umlaufende Anteile	279	281	591			
NIW je Anteil	CHF 6,35	CHF 6,81	CHF 8,69			
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 384.379	€ 498.977	€ 653.189			
ausgegebene und umlaufende Anteile	50.131	63.739	70.200			
NIW je Anteil	€ 7,67	€ 7,83	€ 9,30			
Erträge	€ 21.934	€ 27.728	€ 75.650			
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.413	4.056	8.695			
NIW je Anteil	€ 6,43	€ 6,84	€ 8,70			
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 14.268	£ 14.369	£ 18.246			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.845	1.836	1.996			
NIW je Anteil	£ 7,73	£ 7,83	£ 9,14			
Erträge	£ 17.753	£ 20.785	£ 59.979			
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.764	3.068	7.061			
NIW je Anteil	£ 6,42	£ 6,77	£ 8,50			
Institutional RMB (Hedged):						
Erträge	k. A.	k. A.	CNH 61			
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1			
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CNH 91,17			
Institutional SGD (Hedged):						
Erträge	SGD 2.479	SGD 385	SGD 85			
ausgegebene und umlaufende Anteile	363	53	9			
NIW je Anteil	SGD 6,84	SGD 7,23	SGD 9,01			
Investor:						
thesaurierend	\$ 6.300	\$ 8.727	\$ 19.282			
ausgegebene und umlaufende Anteile	848	1.164	2.201			
NIW je Anteil	\$ 7,43	\$ 7,50	\$ 8,76			
Erträge	\$ 54.081	\$ 71.688	\$ 273.632			
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.161	10.304	31.566			
NIW je Anteil	\$ 6,63	\$ 6,96	\$ 8,67			
Investor AUD (Hedged):						
Erträge	AUD 3.720	AUD 3.889	AUD 5.081			
ausgegebene und umlaufende Anteile	567	557	579			
NIW je Anteil	AUD 6,57	AUD 6,99	AUD 8,77			

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum			Zum			Zum		
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)</b>									
Investor EUR (Hedged):									
Erträge	€	1.013	€	873	€	935			
ausgegebene und umlaufende Anteile		161		130		110			
NIW je Anteil	€	6,29	€	6,69	€	8,52			
Investor RMB (Hedged):									
Erträge	CNH	10.329	CNH	13.234	CNH	24.873			
ausgegebene und umlaufende Anteile		151		182		275			
NIW je Anteil	CNH	68,20	CNH	72,74	CNH	90,46			
Investor SGD (Hedged):									
Erträge	SGD	4.259	SGD	4.112	SGD	6.528			
ausgegebene und umlaufende Anteile		647		591		753			
NIW je Anteil	SGD	6,58	SGD	6,96	SGD	8,67			
Administrative:									
Erträge	\$	25.777	\$	28.245	\$	41.320			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.813		3.980		4.672			
NIW je Anteil	\$	6,76	\$	7,10	\$	8,84			
E Class:									
thesaurierend	\$	57.852	\$	61.585	\$	78.405			
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.168		7.540		8.175			
NIW je Anteil	\$	8,07	\$	8,17	\$	9,59			
Erträge	\$	56.607	\$	56.633	\$	100.159			
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.375		7.981		11.325			
NIW je Anteil	\$	6,76	\$	7,10	\$	8,84			
E Class CHF (Hedged):									
thesaurierend	CHF	913	CHF	1.012	CHF	1.263			
ausgegebene und umlaufende Anteile		124		133		138			
NIW je Anteil	CHF	7,37	CHF	7,63	CHF	9,16			
Erträge	CHF	206	CHF	245	CHF	280			
ausgegebene und umlaufende Anteile		33		36		32			
NIW je Anteil	CHF	6,35	CHF	6,81	CHF	8,69			
E Class EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	45.006	€	48.877	€	61.580			
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.010		6.365		6.687			
NIW je Anteil	€	7,49	€	7,68	€	9,21			
Erträge	€	9.724	€	8.314	€	10.041			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.513		1.217		1.154			
NIW je Anteil	€	6,42	€	6,83	€	8,70			
E Class HKD (Unhedged):									
Erträge	HKD	5.515	HKD	6.334	HKD	4.540			
ausgegebene und umlaufende Anteile		816		897		516			
NIW je Anteil	HKD	6,76	HKD	7,06	HKD	8,79			
E Class SGD (Hedged):									
Erträge	SGD	14.008	SGD	15.239	SGD	25.623			
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.106		2.168		2.924			
NIW je Anteil	SGD	6,65	SGD	7,03	SGD	8,76			
H Institutional:									
thesaurierend	\$	1.312	\$	1.323	\$	182			
ausgegebene und umlaufende Anteile		172		172		20			
NIW je Anteil	\$	7,62	\$	7,69	\$	8,96			
Erträge	\$	534	\$	547	\$	686			
ausgegebene und umlaufende Anteile		81		79		80			
NIW je Anteil	\$	6,57	\$	6,90	\$	8,60			
M Retail:									
ausschüttend II	\$	21.565	\$	17.613	\$	22.700			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.415		2.637		2.684			
NIW je Anteil	\$	6,32	\$	6,68	\$	8,46			
M Retail HKD (Unhedged):									
ausschüttend II	HKD	3.879	HKD	1.797	HKD	6.482			
ausgegebene und umlaufende Anteile		615		270		771			
NIW je Anteil	HKD	6,30	HKD	6,65	HKD	8,41			

	Zum			Zum			Zum		
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)</b>									
M Retail SGD (Hedged):									
ausschüttend II	SGD	8.109	SGD	8.881	SGD	11.492			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.305		1.342		1.372			
NIW je Anteil	SGD	6,21	SGD	6,62	SGD	8,38			
Z Class:									
thesaurierend	\$	229.170	\$	230.136	\$	300.885			
ausgegebene und umlaufende Anteile		25.207		25.207		28.503			
NIW je Anteil	\$	9,09	\$	9,13	\$	10,56			
<b>Asia Strategic Interest Bond Fund</b>									
Nettovermögen	\$	319.819	\$	313.987	\$	361.011			
Institutional:									
thesaurierend	\$	11	k. A.		k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	\$	9,95		k. A.		k. A.			
Erträge	\$	53.839	\$	54.459	\$	64.997			
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.797		6.776		6.958			
NIW je Anteil	\$	7,92	\$	8,04	\$	9,34			
Institutional EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	9	k. A.		k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	€	9,91		k. A.		k. A.			
Erträge	€	98.102	€	97.916	€	102.975			
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.864		12.495		11.068			
NIW je Anteil	€	7,63	€	7,84	€	9,30			
Institutional GBP (Hedged):									
Erträge	£	315	£	205	£	174			
ausgegebene und umlaufende Anteile		40		26		19			
NIW je Anteil	£	7,88	£	8,04	£	9,41			
Institutional SGD (Hedged):									
Erträge	SGD	7.861	SGD	3.799	SGD	5.354			
ausgegebene und umlaufende Anteile		987		467		566			
NIW je Anteil	SGD	7,96	SGD	8,13	SGD	9,46			
Investor:									
thesaurierend	\$	10	k. A.		k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	\$	9,95		k. A.		k. A.			
Investor EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	9	k. A.		k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	€	9,90		k. A.		k. A.			
E Class:									
thesaurierend	\$	2.846	\$	806	\$	12			
ausgegebene und umlaufende Anteile		327		94		1			
NIW je Anteil	\$	8,69	\$	8,62	\$	9,69			
Erträge	\$	21.585	\$	24.409	\$	24.934			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.098		3.450		3.015			
NIW je Anteil	\$	6,97	\$	7,08	\$	8,27			
E Class EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	6.035	€	5.640	€	5.060			
ausgegebene und umlaufende Anteile		731		680		532			
NIW je Anteil	€	8,26	€	8,29	€	9,51			
E Class EUR (Unhedged):									
thesaurierend	€	19.906	€	21.244	€	25.443			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.425		1.500		1.703			
NIW je Anteil	€	13,97	€	14,17	€	14,94			
E Class HKD (Unhedged):									
Erträge	HKD	2.970	HKD	2.973	HKD	3.401			
ausgegebene und umlaufende Anteile		372		367		362			
NIW je Anteil	HKD	7,99	HKD	8,09	HKD	9,40			



	Asia Strategic Interest Bond Fund (Fortsetzung)		
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
E Class SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 2.948	SGD 300	SGD 337
ausgegebene und umlaufende Anteile	371	37	36
NIW je Anteil	SGD 7,95	SGD 8,13	SGD 9,46
M Retail HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 29.970	HKD 31.879	HKD 39.857
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.921	5.174	5.540
NIW je Anteil	HKD 6,09	HKD 6,16	HKD 7,19
Z Class:			
thesaurierend	\$ 93.585	\$ 93.351	\$ 109.270
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.471	10.610	11.219
NIW je Anteil	\$ 8,94	\$ 8,80	\$ 9,74
Nettovermögen	\$ 5.450.002	\$ 5.721.591	\$ 9.110.409
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.300.577	\$ 1.352.729	\$ 2.296.596
ausgegebene und umlaufende Anteile	67.278	69.143	103.846
NIW je Anteil	\$ 19,33	\$ 19,56	\$ 22,12
Erträge	\$ 271.371	\$ 393.584	\$ 728.260
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.509	39.825	62.402
NIW je Anteil	\$ 9,52	\$ 9,88	\$ 11,67
Institutional AUD (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	AUD 14
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	AUD 9,90
Institutional BRL (Hedged):			
thesaurierend	\$ 12.281	\$ 25.163	\$ 47.342
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.326	3.040	5.855
NIW je Anteil	\$ 9,26	\$ 8,28	\$ 8,09
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 37.804	CHF 52.485	CHF 120.911
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.588	3.478	6.908
NIW je Anteil	CHF 14,61	CHF 15,09	CHF 17,50
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.176.914	€ 1.198.101	€ 1.868.333
ausgegebene und umlaufende Anteile	88.625	88.171	118.946
NIW je Anteil	€ 13,28	€ 13,59	€ 15,71
Erträge	€ 415.915	€ 383.951	€ 481.884
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.983	36.928	38.373
NIW je Anteil	€ 9,91	€ 10,40	€ 12,56
ausschüttend II	€ 5.762	€ 31.417	€ 41.671
ausgegebene und umlaufende Anteile	769	3.979	4.334
NIW je Anteil	€ 7,49	€ 7,89	€ 9,61
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 53.481	£ 35.494	£ 43.301
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.852	2.518	2.696
NIW je Anteil	£ 13,89	£ 14,10	£ 16,06
Erträge	£ 66.500	£ 67.663	£ 106.976
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.300	6.132	8.135
NIW je Anteil	£ 10,56	£ 11,03	£ 13,15

	PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)		
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Institutional RMB (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	CNH 66
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CNH 100,31
Institutional SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 1.030	SGD 178	SGD 39
ausgegebene und umlaufende Anteile	128	21	4
NIW je Anteil	SGD 8,03	SGD 8,38	SGD 9,91
Investor:			
thesaurierend	\$ 192.193	\$ 215.127	\$ 345.234
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.647	16.173	22.879
NIW je Anteil	\$ 13,12	\$ 13,30	\$ 15,09
Erträge	\$ 47.976	\$ 72.649	\$ 245.968
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.063	7.387	21.180
NIW je Anteil	\$ 9,47	\$ 9,84	\$ 11,61
Investor AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 13.846	AUD 12.971	AUD 26.915
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.605	1.437	2.496
NIW je Anteil	AUD 8,63	AUD 9,03	AUD 10,79
Investor CAD (Hedged):			
Erträge	CAD 3.961	CAD 4.043	CAD 4.771
ausgegebene und umlaufende Anteile	441	432	431
NIW je Anteil	CAD 8,99	CAD 9,35	CAD 11,08
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 21.230	€ 23.367	€ 49.337
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.842	1.978	3.601
NIW je Anteil	€ 11,53	€ 11,81	€ 13,70
Investor GBP (Hedged):			
Erträge	£ 2.992	£ 2.695	£ 3.470
ausgegebene und umlaufende Anteile	368	319	344
NIW je Anteil	£ 8,13	£ 8,46	£ 10,08
Investor RMB (Hedged):			
Erträge	k. A.	CNH 31.763	CNH 39.482
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	313	330
NIW je Anteil	k. A.	CNH 101,51	CNH 119,51
Investor SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 5.179	SGD 5.849	SGD 5.321
ausgegebene und umlaufende Anteile	582	630	484
NIW je Anteil	SGD 8,90	SGD 9,29	SGD 10,99
Administrative:			
thesaurierend	\$ 136.237	\$ 141.400	\$ 149.168
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.428	7.599	7.057
NIW je Anteil	\$ 18,34	\$ 18,61	\$ 21,14
Erträge	\$ 79.749	\$ 98.383	\$ 140.861
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.230	7.402	8.978
NIW je Anteil	\$ 12,80	\$ 13,29	\$ 15,69
ausschüttend II	\$ 10	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,19	\$ 9,60	k. A.
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 13.978	€ 13.449	€ 18.966
ausgegebene und umlaufende Anteile	899	843	1.024
NIW je Anteil	€ 15,55	€ 15,95	€ 18,53
Administrative SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 13	SGD 14	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,13	SGD 9,59	k. A.
E Class:			
thesaurierend	\$ 322.450	\$ 352.622	\$ 452.418
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.981	25.798	29.018
NIW je Anteil	\$ 13,45	\$ 13,67	\$ 15,59

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum			Zum			Zum		
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
<b>PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)</b>									
Erträge	\$	60.793	\$	64.556	\$	99.264			
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.408		6.556		8.539			
NIW je Anteil	\$	9,49	\$	9,85	\$	11,62			
E Class CHF (Hedged):									
thesaurierend	CHF	7.449	CHF	8.252	CHF	11.446			
ausgegebene und umlaufende Anteile		743		793		940			
NIW je Anteil	CHF	10,03	CHF	10,41	CHF	12,18			
E Class EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	418.303	€	402.295	€	497.935			
ausgegebene und umlaufende Anteile		36.492		34.146		36.232			
NIW je Anteil	€	11,46	€	11,78	€	13,74			
Erträge	€	62.231	€	62.789	€	73.090			
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.625		7.332		7.069			
NIW je Anteil	€	8,16	€	8,56	€	10,34			
M Retail:									
ausschüttend II	\$	202.342	\$	218.883	\$	306.306			
ausgegebene und umlaufende Anteile		24.108		24.922		29.067			
NIW je Anteil	\$	8,39	\$	8,78	\$	10,54			
M Retail HKD (Unhedged):									
Erträge	HKD	2.710	HKD	2.801	HKD	24.499			
ausgegebene und umlaufende Anteile		298		298		2.211			
NIW je Anteil	HKD	9,10	HKD	9,40	HKD	11,08			
M Retail SGD (Hedged):									
ausschüttend II	SGD	90.625	SGD	100.715	SGD	145.278			
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.028		11.653		13.981			
NIW je Anteil	SGD	8,22	SGD	8,64	SGD	10,39			
R Class:									
Erträge	\$	4.322	\$	4.980	\$	6.177			
ausgegebene und umlaufende Anteile		452		501		526			
NIW je Anteil	\$	9,57	\$	9,94	\$	11,73			
R Class EUR (Hedged):									
Erträge	€	3.129	€	3.708	€	12.422			
ausgegebene und umlaufende Anteile		394		445		1.233			
NIW je Anteil	€	7,94	€	8,33	€	10,07			
R Class GBP (Hedged):									
Erträge	£	2.450	£	2.795	£	5.957			
ausgegebene und umlaufende Anteile		288		315		564			
NIW je Anteil	£	8,51	£	8,86	£	10,56			
T Class:									
Erträge	\$	7.991	\$	8.517	\$	11.570			
ausgegebene und umlaufende Anteile		817		839		966			
NIW je Anteil	\$	9,78	\$	10,15	\$	11,98			
T Class EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	62.881	€	65.092	€	84.896			
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.075		6.106		6.800			
NIW je Anteil	€	10,35	€	10,66	€	12,48			
Z Class:									
Erträge	\$	88.523	\$	78.203	\$	124.585			
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.463		7.202		9.705			
NIW je Anteil	\$	10,46	\$	10,86	\$	12,84			
Z Class AUD (Hedged):									
Erträge	AUD	75.526	AUD	104.790	AUD	127.724			
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.302		11.002		11.223			
NIW je Anteil	AUD	9,10	AUD	9,52	AUD	11,38			
<b>PIMCO Climate Bond Fund</b>									
Nettovermögen	\$	289.524	\$	292.655	\$	328.081			
Institutional:									
thesaurierend	\$	24.922	\$	27.502	\$	21.317			
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.764		3.116		2.108			
NIW je Anteil	\$	9,02	\$	8,83	\$	10,11			
<b>PIMCO Climate Bond Fund (Fortsetzung)</b>									
Institutional AUD (Hedged):									
Erträge	AUD	375	k. A.		k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		38		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	AUD	9,89		k. A.		k. A.			
Institutional CHF (Hedged):									
thesaurierend	CHF	743	CHF	940	CHF	1.103			
ausgegebene und umlaufende Anteile		88		112		111			
NIW je Anteil	CHF	8,43	CHF	8,42	CHF	9,91			
Institutional EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	43.163	€	62.757	€	80.658			
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.003		7.351		8.066			
NIW je Anteil	€	8,63	€	8,54	€	10,00			
Erträge	€	103.157	€	73.780	€	101.819			
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.550		8.951		10.361			
NIW je Anteil	€	8,22	€	8,24	€	9,83			
Institutional GBP (Hedged):									
thesaurierend	£	29.465	£	32.441	£	28.217			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.323		3.720		2.799			
NIW je Anteil	£	8,87	£	8,72	£	10,08			
Erträge	£	34.174	£	25.204	£	715			
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.035		2.978		72			
NIW je Anteil	£	8,47	£	8,46	£	9,97			
Institutional SEK (Hedged):									
thesaurierend	SEK	17.101	SEK	290.215	SEK	292.047			
ausgegebene und umlaufende Anteile		198		3.406		2.939			
NIW je Anteil	SEK	86,16	SEK	85,22	SEK	99,36			
Institutional SGD (Hedged):									
thesaurierend	SGD	5.460	SGD	5.576	SGD	5.453			
ausgegebene und umlaufende Anteile		612		635		541			
NIW je Anteil	SGD	8,92	SGD	8,78	SGD	10,08			
Investor:									
thesaurierend	\$	10	k. A.		\$	3.214			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		321			
NIW je Anteil	\$	10,11		k. A.		10,00			
Investor EUR (Hedged):									
thesaurierend		k. A.		k. A.	€	8			
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		1			
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	€	9,92			
Administrative SEK (Hedged):									
thesaurierend	SEK	74	SEK	73	SEK	86			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1			
NIW je Anteil	SEK	85,55	SEK	84,84	SEK	99,39			
E Class EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	15.890	€	15.976	€	16.979			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.888		1.909		1.718			
NIW je Anteil	€	8,42	€	8,37	€	9,88			
Z Class:									
thesaurierend	\$	9	\$	9	\$	10			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1			
NIW je Anteil	\$	9,15	\$	8,93	\$	10,18			
<b>Commodity Real Return Fund</b>									
Nettovermögen	\$	973.166	\$	1.369.877	\$	1.444.182			
Institutional:									
thesaurierend	\$	332.647	\$	397.781	\$	587.333			
ausgegebene und umlaufende Anteile		37.836		41.220		67.481			
NIW je Anteil	\$	8,79	\$	9,65	\$	8,70			
Institutional EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	129.132	€	225.302	€	144.220			
ausgegebene und umlaufende Anteile		15.315		23.996		16.678			
NIW je Anteil	€	8,43	€	9,39	€	8,65			



	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021		Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	<b>Commodity Real Return Fund (Fortsetzung)</b>				<b>Diversified Income Fund</b>		
Institutional EUR (Unhedged):				Nettvermögen	\$ 7.942.717	\$ 8.751.796	\$ 16.447.733
thesaurierend	€ 70.554	€ 87.086	€ 48.990	Institutional:			
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.933	6.527	4.337	thesaurierend	\$ 660.058	\$ 824.847	\$ 1.243.637
NIW je Anteil	€ 11,89	€ 13,34	€ 11,29	ausgegebene und umlaufende Anteile	27.223	35.047	44.236
Institutional GBP (Hedged):				NIW je Anteil	\$ 24,25	\$ 23,54	\$ 28,11
thesaurierend	£ 21.791	£ 39.019	£ 36.172	Erträge	\$ 290.580	\$ 352.231	\$ 692.397
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.827	2.963	3.012	ausgegebene und umlaufende Anteile	22.875	27.897	44.132
NIW je Anteil	£ 11,93	£ 13,17	£ 12,01	NIW je Anteil	\$ 12,70	\$ 12,63	\$ 15,69
Institutional GBP (Unhedged):				Institutional CAD (Hedged):			
Erträge	£ 18.858	£ 17.587	k. A.	thesaurierend	CAD 433.652	CAD 441.412	CAD 571.190
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.399	1.881	k. A.	ausgegebene und umlaufende Anteile	43.275	45.218	48.824
NIW je Anteil	£ 7,86	£ 9,35	k. A.	NIW je Anteil	CAD 10,02	CAD 9,76	CAD 11,70
Investor:				Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	\$ 29.792	\$ 50.111	\$ 64.377	thesaurierend	CHF 13.343	CHF 15.646	CHF 20.277
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.936	6.022	8.546	ausgegebene und umlaufende Anteile	1.099	1.299	1.371
NIW je Anteil	\$ 7,57	\$ 8,32	\$ 7,53	NIW je Anteil	CHF 12,14	CHF 12,04	CHF 14,79
E Class:				Erträge	CHF 5.675	CHF 8.022	CHF 13.028
thesaurierend	\$ 184.950	\$ 260.353	\$ 256.747	ausgegebene und umlaufende Anteile	798	1.111	1.412
ausgegebene und umlaufende Anteile	26.419	33.734	36.552	NIW je Anteil	CHF 7,11	CHF 7,22	CHF 9,23
NIW je Anteil	\$ 7,00	\$ 7,72	\$ 7,02	Institutional EUR (Hedged):			
E Class EUR (Hedged):				thesaurierend	€ 990.830	€ 998.452	€ 1.703.682
thesaurierend	€ 139.271	€ 238.920	€ 234.570	ausgegebene und umlaufende Anteile	63.613	65.216	90.940
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.684	33.254	35.127	NIW je Anteil	€ 15,58	€ 15,31	€ 18,73
NIW je Anteil	€ 6,42	€ 7,18	€ 6,68	Erträge	€ 274.970	€ 330.342	€ 852.032
E Class SGD (Hedged):				ausgegebene und umlaufende Anteile	35.726	42.647	86.306
thesaurierend	SGD 1.240	SGD 2.069	SGD 352	NIW je Anteil	€ 7,70	€ 7,75	€ 9,87
ausgegebene und umlaufende Anteile	122	183	34	Institutional GBP (Hedged):			
NIW je Anteil	SGD 10,19	SGD 11,30	SGD 10,32	thesaurierend	£ 506.486	£ 572.158	£ 1.248.141
H Institutional:				ausgegebene und umlaufende Anteile	38.852	44.993	81.268
thesaurierend	\$ 3.379	\$ 3.614	k. A.	NIW je Anteil	£ 13,04	£ 12,72	£ 15,36
ausgegebene und umlaufende Anteile	439	427	k. A.	Erträge	£ 357.074	£ 391.080	£ 601.893
NIW je Anteil	\$ 7,70	\$ 8,46	k. A.	ausgegebene und umlaufende Anteile	61.740	67.375	81.620
				NIW je Anteil	£ 5,78	£ 5,80	£ 7,37
	<b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>			Institutional MXN (Hedged):			
Nettvermögen	\$ 99.796	\$ 97.153	\$ 139.704	thesaurierend	MXN 454.939	MXN 270.310	MXN 299.232
Institutional:				ausgegebene und umlaufende Anteile	4.515	2.863	2.831
thesaurierend	\$ 47.267	\$ 44.986	\$ 47.099	NIW je Anteil	MXN 100,76	MXN 94,40	MXN 105,70
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.372	3.318	3.345	Institutional SEK (Hedged):			
NIW je Anteil	\$ 14,02	\$ 13,56	\$ 14,07	thesaurierend	SEK 168.763	SEK 168.340	SEK 205.009
Institutional CHF (Hedged):				ausgegebene und umlaufende Anteile	1.041	1.058	1.057
thesaurierend	CHF 13.196	CHF 15.367	CHF 22.488	NIW je Anteil	SEK 162,09	SEK 159,10	SEK 193,88
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.272	1.500	2.060	Institutional SGD (Hedged):			
NIW je Anteil	CHF 10,37	CHF 10,24	CHF 10,92	Erträge	SGD 42.224	SGD 43.716	SGD 79.938
Institutional EUR (Hedged):				ausgegebene und umlaufende Anteile	5.185	5.366	7.873
thesaurierend	€ 16.955	€ 15.443	€ 39.139	NIW je Anteil	SGD 8,14	SGD 8,15	SGD 10,15
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.410	1.312	3.136	Investor:			
NIW je Anteil	€ 12,02	€ 11,77	€ 12,48	thesaurierend	\$ 41.904	\$ 53.597	\$ 83.045
E Class:				ausgegebene und umlaufende Anteile	3.415	4.492	5.806
thesaurierend	\$ 8.613	\$ 8.985	\$ 9.740	NIW je Anteil	\$ 12,27	\$ 11,93	\$ 14,30
ausgegebene und umlaufende Anteile	748	803	831				
NIW je Anteil	\$ 11,52	\$ 11,20	\$ 11,73				
E Class EUR (Hedged):							
thesaurierend	€ 9.778	€ 9.455	€ 12.026				
ausgegebene und umlaufende Anteile	987	971	1.154				
NIW je Anteil	€ 9,91	€ 9,74	€ 10,42				

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum			Zum			Zum		
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
<b>Diversified Income Fund (Fortsetzung)</b>									
Erträge	\$ 95.900	\$ 89.559	\$ 69.026						
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.171	10.495	6.522						
NIW je Anteil	\$ 8,59	\$ 8,53	\$ 10,58						
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 19.159	€ 21.418	€ 34.903						
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.301	1.477	1.960						
NIW je Anteil	€ 14,73	€ 14,50	€ 17,81						
Erträge	€ 9.462	€ 10.066	€ 11.743						
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.300	1.375	1.260						
NIW je Anteil	€ 7,28	€ 7,32	€ 9,32						
Administrative: Erträge	\$ 85.505	\$ 87.885	\$ 143.334						
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.121	9.431	12.385						
NIW je Anteil	\$ 9,37	\$ 9,32	\$ 11,57						
Administrative AUD (Hedged): Erträge	k. A.	AUD 2.794	AUD 3.812						
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	341	370						
NIW je Anteil	k. A.	AUD 8,18	AUD 10,30						
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend	€ 3.818	€ 4.330	€ 10.014						
ausgegebene und umlaufende Anteile	266	306	575						
NIW je Anteil	€ 14,37	€ 14,16	€ 17,42						
Administrative GBP (Hedged): Erträge	£ 7.732	£ 8.358	£ 12.610						
ausgegebene und umlaufende Anteile	898	972	1.168						
NIW je Anteil	£ 8,61	£ 8,60	£ 10,80						
Administrative JPY (Hedged): thesaurierend	¥ 354.765	¥ 354.957	¥ 47.222						
ausgegebene und umlaufende Anteile	438	438	47						
NIW je Anteil	¥ 811,00	¥ 811,00	¥ 1.002,00						
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 70	SEK 78	SEK 84						
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1						
NIW je Anteil	SEK 82,08	SEK 80,78	SEK 98,94						
Administrative SGD (Hedged): Erträge	SGD 58.934	SGD 55.693	SGD 101.850						
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.030	6.640	9.757						
NIW je Anteil	SGD 8,38	SGD 8,39	SGD 10,44						
BM Retail: ausschüttend II	\$ 11.256	\$ 9	k. A.						
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.236	1	k. A.						
NIW je Anteil	\$ 9,11	\$ 9,17	k. A.						
BN Retail: ausschüttend II	\$ 10	\$ 9	k. A.						
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.						
NIW je Anteil	\$ 9,10	\$ 9,17	k. A.						
E Class: thesaurierend	\$ 600.086	\$ 655.637	\$ 1.113.069						
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.862	32.342	45.554						
NIW je Anteil	\$ 20,79	\$ 20,27	\$ 24,43						
Erträge	\$ 317.720	\$ 372.507	\$ 630.798						
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.007	33.038	45.041						
NIW je Anteil	\$ 11,34	\$ 11,28	\$ 14,01						
E Class CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 6.066	CHF 7.655	CHF 9.701						
ausgegebene und umlaufende Anteile	725	918	939						
NIW je Anteil	CHF 8,37	CHF 8,34	CHF 10,33						
E Class EUR (Hedged): thesaurierend	€ 983.703	€ 1.292.425	€ 1.880.735						
ausgegebene und umlaufende Anteile	72.415	96.369	113.579						
NIW je Anteil	€ 13,58	€ 13,41	€ 16,56						
Erträge	€ 678.307	€ 781.155	€ 1.366.978						
ausgegebene und umlaufende Anteile	77.231	88.377	121.500						
NIW je Anteil	€ 8,78	€ 8,84	€ 11,25						
<b>Diversified Income Fund (Fortsetzung)</b>									
E Class SGD (Hedged): Erträge	SGD 19.184	SGD 22.377	SGD 47.272						
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.364	2.757	4.674						
NIW je Anteil	SGD 8,12	SGD 8,12	SGD 10,11						
H Institutional: thesaurierend	\$ 515.828	\$ 385.630	\$ 1.501.526						
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.222	21.717	70.674						
NIW je Anteil	\$ 18,28	\$ 17,76	\$ 21,25						
Erträge	\$ 170	\$ 118	\$ 26						
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	14	2						
NIW je Anteil	\$ 8,66	\$ 8,61	\$ 10,70						
M Retail: Erträge	\$ 139.867	\$ 150.260	\$ 246.412						
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.412	15.573	20.577						
NIW je Anteil	\$ 9,70	\$ 9,65	\$ 11,98						
ausschüttend II	\$ 174.305	\$ 183.635	\$ 311.977						
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.557	23.717	31.930						
NIW je Anteil	\$ 7,73	\$ 7,74	\$ 9,77						
M Retail AUD (Hedged): Erträge	AUD 47.073	AUD 49.591	AUD 83.307						
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.309	5.574	7.442						
NIW je Anteil	AUD 8,87	AUD 8,90	AUD 11,19						
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II	k. A.	k. A.	SGD 13						
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1						
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SGD 9,82						
N Retail: ausschüttend II	\$ 9	\$ 9	\$ 10						
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1						
NIW je Anteil	\$ 8,83	\$ 8,61	\$ 10,38						
T Class: thesaurierend	\$ 24.245	\$ 25.356	\$ 40.854						
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.165	2.318	3.086						
NIW je Anteil	\$ 11,20	\$ 10,94	\$ 13,24						
Erträge	\$ 6.556	\$ 6.829	\$ 9.630						
ausgegebene und umlaufende Anteile	736	771	876						
NIW je Anteil	\$ 8,91	\$ 8,85	\$ 11,00						
T Class EUR (Hedged): thesaurierend	€ 36.624	€ 36.445	€ 53.705						
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.861	3.883	4.616						
NIW je Anteil	€ 9,49	€ 9,38	€ 11,63						
Erträge	€ 19.186	€ 19.507	€ 28.295						
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.550	2.576	2.937						
NIW je Anteil	€ 7,52	€ 7,57	€ 9,63						
W Class: thesaurierend	\$ 31.798	\$ 64.400	\$ 120.525						
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.535	7.380	11.579						
NIW je Anteil	\$ 9,00	\$ 8,73	\$ 10,41						
Erträge	\$ 13.371	\$ 45.458	\$ 137.527						
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.659	5.672	13.806						
NIW je Anteil	\$ 8,06	\$ 8,01	\$ 9,96						
W Class CAD (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	CAD 14						
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1						
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CAD 10,38						
W Class CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 3.197	CHF 10.994	CHF 13.719						
ausgegebene und umlaufende Anteile	380	1.317	1.339						
NIW je Anteil	CHF 8,42	CHF 8,35	CHF 10,24						
Erträge	CHF 422	CHF 699	CHF 1.588						
ausgegebene und umlaufende Anteile	56	91	162						
NIW je Anteil	CHF 7,56	CHF 7,67	CHF 9,80						

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Diversified Income Fund (Fortsetzung)</b>			
W Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 6.262	€ 11.937	€ 15.286
ausgegebene und umlaufende Anteile	732	1.420	1.488
NIW je Anteil	€ 8,56	€ 8,40	€ 10,27
Erträge	€ 1.414	€ 3.382	€ 6.737
ausgegebene und umlaufende Anteile	184	438	685
NIW je Anteil	€ 7,67	€ 7,72	€ 9,83
W Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 570	£ 2.089	£ 2.371
ausgegebene und umlaufende Anteile	65	243	229
NIW je Anteil	£ 8,81	£ 8,59	£ 10,36
Erträge	£ 323	£ 2.895	£ 3.547
ausgegebene und umlaufende Anteile	41	367	358
NIW je Anteil	£ 7,90	£ 7,89	£ 9,92
W Class SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 1.533	SGD 3.079	SGD 4.762
ausgegebene und umlaufende Anteile	192	385	477
NIW je Anteil	SGD 8,00	SGD 8,00	SGD 9,97
<b>Diversified Income Duration Hedged Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 521.567	\$ 564.684	\$ 1.305.365
Institutional:			
thesaurierend	\$ 20.919	\$ 23.243	\$ 64.311
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.401	1.617	4.288
NIW je Anteil	\$ 14,93	\$ 14,38	\$ 15,00
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 3.462
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	326
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,63
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 73.149	€ 87.225	€ 165.664
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.603	6.863	12.228
NIW je Anteil	€ 13,05	€ 12,71	€ 13,55
ausschüttend II	€ 9.698	€ 9.995	€ 40.816
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.340	1.372	5.012
NIW je Anteil	€ 7,24	€ 7,29	€ 8,14
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 184.957	£ 182.935	£ 312.905
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.832	13.134	21.396
NIW je Anteil	£ 14,42	£ 13,93	£ 14,62
Erträge	£ 42.282	£ 63.760	£ 176.678
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.315	7.894	19.855
NIW je Anteil	£ 7,96	£ 8,08	£ 8,90
Investor:			
thesaurierend	\$ 5.129	\$ 5.125	\$ 11.010
ausgegebene und umlaufende Anteile	413	428	878
NIW je Anteil	\$ 12,42	\$ 11,98	\$ 12,54
E Class:			
thesaurierend	\$ 18.726	\$ 24.033	\$ 46.891
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.547	2.054	3.805
NIW je Anteil	\$ 12,10	\$ 11,70	\$ 12,32
Erträge	\$ 31.528	\$ 33.306	\$ 38.488
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.362	3.579	3.808
NIW je Anteil	\$ 9,38	\$ 9,30	\$ 10,11
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 43.302	€ 54.593	€ 184.920
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.642	4.696	14.788
NIW je Anteil	€ 11,89	€ 11,63	€ 12,50
Erträge	€ 17.174	€ 18.931	€ 29.006
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.285	2.511	3.466
NIW je Anteil	€ 7,51	€ 7,54	€ 8,37

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Diversified Income ESG Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 57.989	\$ 9.854	
Institutional:			
thesaurierend	\$ 9.677	\$ 9.367	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	947	947	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,22	\$ 9,89	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 44.038	€ 226	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.418	23	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,97	€ 9,76	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 194	£ 188	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	19	19	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,11	£ 9,83	k. A.
E Class:			
thesaurierend	\$ 10	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,14	\$ 9,85	k. A.
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,88	€ 9,73	k. A.
<b>Dynamic Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 3.367.293	\$ 3.483.601	\$ 3.277.997
Institutional:			
thesaurierend	\$ 311.552	\$ 470.460	\$ 626.628
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.406	34.671	42.473
NIW je Anteil	\$ 13,90	\$ 13,57	\$ 14,75
Erträge	\$ 83.077	\$ 81.771	\$ 100.397
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.135	8.057	8.882
NIW je Anteil	\$ 10,21	\$ 10,15	\$ 11,30
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 11.508	CAD 11.952	CAD 15.351
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.117	1.186	1.398
NIW je Anteil	CAD 10,30	CAD 10,08	CAD 10,98
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 55.726	CHF 70.173	CHF 87.168
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.594	7.073	7.873
NIW je Anteil	CHF 9,96	CHF 9,92	CHF 11,07
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 104.271	€ 187.622	€ 348.406
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.689	15.837	26.481
NIW je Anteil	€ 12,00	€ 11,85	€ 13,16
Erträge	€ 6.326	€ 11.318	€ 12.768
ausgegebene und umlaufende Anteile	721	1.283	1.272
NIW je Anteil	€ 8,78	€ 8,82	€ 10,04
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 1.873.362	£ 1.840.373	£ 887.562
ausgegebene und umlaufende Anteile	152.222	152.611	67.216
NIW je Anteil	£ 12,31	£ 12,06	£ 13,20

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum		
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
	Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)		
	£	£	£
Erträge			
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.514	10.906	26.086
NIW je Anteil	£ 8,61	£ 8,63	£ 9,71
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 3.375	NOK 4.066	NOK 131.604
ausgegebene und umlaufende Anteile	276	337	9.965
NIW je Anteil	NOK 12,25	NOK 12,07	NOK 13,21
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	SEK 24.943
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	237
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SEK 105,17
Investor:			
thesaurierend	\$ 42.841	\$ 46.677	\$ 56.790
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.651	4.069	4.537
NIW je Anteil	\$ 11,73	\$ 11,47	\$ 12,52
Erträge	\$ 1.442	\$ 2.830	\$ 3.932
ausgegebene und umlaufende Anteile	158	312	389
NIW je Anteil	\$ 9,14	\$ 9,08	\$ 10,11
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.036	€ 2.013	€ 5.744
ausgegebene und umlaufende Anteile	200	200	512
NIW je Anteil	€ 10,19	€ 10,08	€ 11,23
Administrative:			
thesaurierend	\$ 16.282	\$ 21.094	\$ 29.563
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.253	1.659	2.128
NIW je Anteil	\$ 13,00	\$ 12,72	\$ 13,90
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 640	€ 1.170	€ 3.659
ausgegebene und umlaufende Anteile	57	105	295
NIW je Anteil	€ 11,22	€ 11,11	€ 12,40
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 58.609	SEK 61.257	SEK 81.744
ausgegebene und umlaufende Anteile	565	597	718
NIW je Anteil	SEK 103,78	SEK 102,58	SEK 113,88
E Class:			
thesaurierend	\$ 69.275	\$ 69.989	\$ 92.812
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.165	6.354	7.680
NIW je Anteil	\$ 11,24	\$ 11,01	\$ 12,08
Erträge	\$ 14.849	\$ 14.979	\$ 19.242
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.590	1.615	1.862
NIW je Anteil	\$ 9,34	\$ 9,28	\$ 10,33
E Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 8.002	CHF 8.868	CHF 10.761
ausgegebene und umlaufende Anteile	903	1.000	1.078
NIW je Anteil	CHF 8,86	CHF 8,86	CHF 9,98
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 70.270	€ 73.068	€ 138.697
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.614	6.936	11.750
NIW je Anteil	€ 10,62	€ 10,54	€ 11,80
E Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 2.845	£ 3.354	£ 3.820
ausgegebene und umlaufende Anteile	265	318	328
NIW je Anteil	£ 10,72	£ 10,55	£ 11,65
G Retail EUR (Hedged):			
Erträge	€ 6.677	€ 7.061	€ 8.905
ausgegebene und umlaufende Anteile	840	896	992
NIW je Anteil	€ 7,95	€ 7,88	€ 8,98
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 7.808	\$ 11.541	\$ 18.571
ausgegebene und umlaufende Anteile	750	1.135	1.677
NIW je Anteil	\$ 10,42	\$ 10,17	\$ 11,08

	Zum		
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
	Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)		
	\$	\$	\$
Erträge			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 9,18	\$ 9,12	\$ 10,16
R Class:			
thesaurierend	\$ 5.881	\$ 6.385	\$ 7.736
ausgegebene und umlaufende Anteile	519	577	642
NIW je Anteil	\$ 11,34	\$ 11,07	\$ 12,05
Z Class:			
thesaurierend	\$ 6.879	\$ 6.683	\$ 9.940
ausgegebene und umlaufende Anteile	725	725	1.001
NIW je Anteil	\$ 9,49	\$ 9,22	\$ 9,93
Z Class AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 20.723	AUD 27.023	AUD 36.313
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.256	2.938	3.513
NIW je Anteil	AUD 9,19	AUD 9,20	AUD 10,34
	Dynamic Multi-Asset Fund		
Nettovermögen	€ 4.258.211	€ 5.115.170	€ 7.635.950
Institutional:			
thesaurierend	€ 1.378.749	€ 1.644.656	€ 2.765.020
ausgegebene und umlaufende Anteile	117.482	137.719	198.997
NIW je Anteil	€ 11,74	€ 11,94	€ 13,89
ausschüttend II	€ 150.789	€ 158.729	€ 238.007
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.079	14.419	18.212
NIW je Anteil	€ 10,71	€ 11,01	€ 13,07
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 2.653	CHF 3.063	CHF 5.282
ausgegebene und umlaufende Anteile	264	297	438
NIW je Anteil	CHF 10,04	CHF 10,31	CHF 12,06
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 491.171	£ 552.226	£ 576.557
ausgegebene und umlaufende Anteile	39.313	43.745	39.733
NIW je Anteil	£ 12,49	£ 12,62	£ 14,51
Erträge	£ 22.493	£ 33.675	£ 17.109
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.083	3.025	1.337
NIW je Anteil	£ 10,80	£ 11,13	£ 12,79
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	ILS 17.381	ILS 4.206	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.768	423	k. A.
NIW je Anteil	ILS 9,83	ILS 9,93	k. A.
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 108.401	SGD 109.428	SGD 27.017
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.511	12.486	2.702
NIW je Anteil	SGD 8,66	SGD 8,76	SGD 10,00
Institutional USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 137.175	\$ 156.343	\$ 281.670
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.077	11.438	18.087
NIW je Anteil	\$ 13,61	\$ 13,67	\$ 15,57
ausschüttend II	\$ 4.367	\$ 4.450	\$ 5.074
ausgegebene und umlaufende Anteile	531	531	512
NIW je Anteil	\$ 8,22	\$ 8,38	\$ 9,92

	Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Investor:			
thesaurierend	€ 10.506	€ 10.626	€ 11.030
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.149	1.140	1.013
NIW je Anteil	€ 9,15	€ 9,32	€ 10,89
Investor USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 9	\$ 9	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 8,89	\$ 8,94	\$ 10,22
BM Retail AUD (Hedged):			
ausschüttend II	AUD 82	AUD 12	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	9	1	k. A.
NIW je Anteil	AUD 8,83	AUD 9,19	k. A.
BM Retail USD (Hedged):			
ausschüttend II	\$ 444	\$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	50	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,97	\$ 9,25	k. A.
E Class:			
thesaurierend	€ 1.491.335	€ 1.913.579	€ 2.955.626
ausgegebene und umlaufende Anteile	137.037	171.934	225.981
NIW je Anteil	€ 10,88	€ 11,13	€ 13,08
Erträge	€ 3.967	€ 4.679	€ 5.627
ausgegebene und umlaufende Anteile	440	506	517
NIW je Anteil	€ 9,02	€ 9,25	€ 10,87
E Class USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 161.299	\$ 192.230	\$ 275.658
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.104	16.657	20.756
NIW je Anteil	\$ 11,44	\$ 11,54	\$ 13,28
Erträge	\$ 32	\$ 32	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	4	1
NIW je Anteil	\$ 8,73	\$ 8,84	\$ 10,18
ausschüttend II	\$ 8	\$ 9	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 8,08	\$ 8,27	\$ 9,80
H Institutional USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 1.990	\$ 2.298	\$ 8.850
ausgegebene und umlaufende Anteile	209	240	810
NIW je Anteil	\$ 9,53	\$ 9,58	\$ 10,93
M Retail AUD (Hedged):			
ausschüttend II	AUD 448	AUD 321	AUD 563
ausgegebene und umlaufende Anteile	57	39	57
NIW je Anteil	AUD 7,89	AUD 8,17	AUD 9,87
M Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 11.098	SGD 12.812	SGD 16.539
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.377	1.538	1.673
NIW je Anteil	SGD 8,06	SGD 8,33	SGD 9,89
M Retail USD (Hedged):			
ausschüttend II	\$ 54.997	\$ 65.622	\$ 120.842
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.186	7.183	11.077
NIW je Anteil	\$ 8,89	\$ 9,14	\$ 10,91
T Class:			
thesaurierend	€ 77.169	€ 83.511	€ 118.172
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.698	8.130	9.750
NIW je Anteil	€ 10,02	€ 10,27	€ 12,12

	Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
T Class USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 3.426	\$ 3.396	\$ 618
ausgegebene und umlaufende Anteile	407	399	63
NIW je Anteil	\$ 8,42	\$ 8,51	\$ 9,83
Z Class:			
thesaurierend	€ 125.444	€ 151.534	€ 192.397
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.817	14.087	15.504
NIW je Anteil	€ 10,62	€ 10,76	€ 12,41
Nettvermögen			
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.606.951	\$ 1.294.872	\$ 1.416.960
ausgegebene und umlaufende Anteile	116.296	102.499	104.910
NIW je Anteil	\$ 13,82	\$ 12,63	\$ 13,51
Erträge	\$ 71.236	\$ 67.598	\$ 77.715
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.948	11.061	11.365
NIW je Anteil	\$ 6,51	\$ 6,11	\$ 6,84
Institutional CHF (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	CHF 397
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	44
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CHF 9,06
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 394.731	€ 172.081	€ 250.076
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.260	13.181	19.088
NIW je Anteil	€ 13,97	€ 13,06	€ 13,10
Erträge	€ 160.526	€ 132.910	€ 123.817
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.361	20.143	17.869
NIW je Anteil	€ 6,87	€ 6,60	€ 6,93
Institutional GBP (Unhedged):			
thesaurierend	£ 4.577	£ 3.789	£ 2.364
ausgegebene und umlaufende Anteile	213	183	120
NIW je Anteil	£ 21,47	£ 20,74	£ 19,70
Investor:			
thesaurierend	\$ 6.492	\$ 19.062	\$ 38.617
ausgegebene und umlaufende Anteile	624	2.001	3.779
NIW je Anteil	\$ 10,40	\$ 9,53	\$ 10,22
Investor EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 745	€ 698	€ 3.081
ausgegebene und umlaufende Anteile	75	75	330
NIW je Anteil	€ 9,90	€ 9,27	€ 9,33
E Class:			
thesaurierend	\$ 50.073	\$ 35.711	\$ 39.398
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.185	3.249	3.319
NIW je Anteil	\$ 11,96	\$ 10,99	\$ 11,87
Erträge	\$ 13.319	\$ 12.976	\$ 15.964
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.185	2.266	2.492
NIW je Anteil	\$ 6,10	\$ 5,73	\$ 6,41
E Class EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 80.099	€ 64.970	€ 77.057
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.303	4.579	5.359
NIW je Anteil	€ 15,10	€ 14,19	€ 14,38
Erträge	€ 1.516	€ 1.509	€ 1.782
ausgegebene und umlaufende Anteile	162	168	189
NIW je Anteil	€ 9,33	€ 8,96	€ 9,41
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 307.491	\$ 48.177	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.625	5.416	1
NIW je Anteil	\$ 9,72	\$ 8,90	\$ 9,52

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Emerging Local Bond Fund (Fortsetzung)		
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Z Class:			
Erträge	\$ 28.420	\$ 38.202	\$ 40.482
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.646	5.218	4.941
NIW je Anteil	\$ 7,79	\$ 7,32	\$ 8,19
Nettovermögen	\$ 7.692	\$ 6.609	\$
Institutional:			
thesaurierend	\$ 5.662	\$ 5.169	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	489	489	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,58	\$ 10,57	k. A.
Erträge	\$ 12	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,00	\$ 10,34	k. A.
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 409	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	38	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,74	€ 10,02	k. A.
Erträge	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,20	€ 9,81	k. A.
Institutional GBP (Unhedged):			
Erträge	£ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,93	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 12	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,54	\$ 10,56	k. A.
Erträge	\$ 12	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,00	\$ 10,34	k. A.
Investor EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,70	€ 10,01	k. A.
Erträge	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,20	€ 9,81	k. A.
E Class:			
thesaurierend	\$ 11	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,47	\$ 10,53	k. A.
Erträge	\$ 11	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,00	\$ 10,34	k. A.
E Class EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,64	€ 9,98	k. A.
Erträge	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,20	€ 9,80	k. A.
Z Class:			
thesaurierend	\$ 1.462	\$ 1.329	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	123	123	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,85	\$ 10,77	k. A.

  

	Emerging Markets Bond Fund		
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Nettovermögen	\$ 3.389.647	\$ 3.305.979	\$ 4.714.744
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.133.970	\$ 1.097.175	\$ 1.578.727
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.102	24.303	28.997
NIW je Anteil	\$ 47,05	\$ 45,15	\$ 54,45
Erträge	\$ 57.871	\$ 56.849	\$ 92.620
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.880	3.860	4.961
NIW je Anteil	\$ 14,91	\$ 14,73	\$ 18,67
Institutional CHF (Hedged):			
Erträge	CHF 74.259	CHF 77.505	CHF 97.681
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.209	5.390	5.215
NIW je Anteil	CHF 14,26	CHF 14,38	CHF 18,73
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 708.917	€ 694.951	€ 695.028
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.469	19.643	15.897
NIW je Anteil	€ 36,41	€ 35,38	€ 43,72
Erträge	€ 401.045	€ 401.157	€ 847.991
ausgegebene und umlaufende Anteile	58.809	58.854	95.747
NIW je Anteil	€ 6,82	€ 6,82	€ 8,86
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 180.989	€ 135.251	€ 164.246
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.788	12.028	12.905
NIW je Anteil	€ 11,46	€ 11,24	€ 12,73
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 20.148	£ 23.424	£ 26.418
ausgegebene und umlaufende Anteile	827	997	922
NIW je Anteil	£ 24,37	£ 23,50	£ 28,67
Erträge	£ 25.312	£ 28.487	£ 41.458
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.197	8.167	9.258
NIW je Anteil	£ 3,52	£ 3,49	£ 4,48
Institutional PLN (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	PLN 95.531
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	9.927
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	PLN 9,62
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 25.251	SGD 31.394	SGD 32.296
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.468	3.178	2.703
NIW je Anteil	SGD 10,23	SGD 9,88	SGD 11,95
Investor:			
thesaurierend	\$ 3.855	\$ 3.988	\$ 7.210
ausgegebene und umlaufende Anteile	88	95	142
NIW je Anteil	\$ 43,70	\$ 42,01	\$ 50,84
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 3.337	€ 3.248	€ 4.103
ausgegebene und umlaufende Anteile	398	398	406
NIW je Anteil	€ 8,38	€ 8,16	€ 10,11
Administrative:			
thesaurierend	\$ 24.780	\$ 22.981	\$ 34.503
ausgegebene und umlaufende Anteile	581	560	693
NIW je Anteil	\$ 42,69	\$ 41,06	\$ 49,77



	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021		Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	
<b>Emerging Markets Bond Fund (Fortsetzung)</b>					<b>Emerging Markets Bond ESG Fund (Fortsetzung)</b>			
BM Retail:								
ausschüttend II	\$ 354	\$ 9		k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile	39	1		k. A.	CHF 57.114	CHF 53.384	CHF 50.716	
NIW je Anteil	\$ 9,10	\$ 9,11		k. A.	7.146	6.825	5.067	
E Class:					CHF 7,99	CHF 7,82	CHF 10,01	
thesaurierend	\$ 111.695	\$ 114.186	\$ 165.453		€ 918.789	€ 1.011.465	€ 999.329	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.765	2.933	3.492		91.704	104.063	80.567	
NIW je Anteil	\$ 40,39	\$ 38,93	\$ 47,38		€ 10,02	€ 9,72	€ 12,40	
Erträge	\$ 53.595	\$ 61.547	\$ 109.051		€ 161.385	€ 132.184	€ 192.797	
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.960	6.932	9.691		24.171	19.921	21.737	
NIW je Anteil	\$ 8,99	\$ 8,88	\$ 11,25		€ 6,68	€ 6,64	€ 8,87	
E Class EUR (Hedged):					£ 111.994	£ 162.630	£ 80.974	
thesaurierend	€ 123.511	€ 125.229	€ 187.716		ausgegebene und umlaufende Anteile	15.259	22.478	8.479
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.958	4.112	4.943		NIW je Anteil	£ 7,34	£ 7,24	£ 9,55
NIW je Anteil	€ 31,21	€ 30,46	€ 37,98		Institutional GBP (Unhedged):			
E Class SGD (Hedged):					Erträge	£ 4.817	£ 3.960	£ 3.657
thesaurierend	SGD 10.517	SGD 10.020	SGD 11.604		ausgegebene und umlaufende Anteile	629	499	398
ausgegebene und umlaufende Anteile	185	181	172		NIW je Anteil	£ 7,66	£ 7,94	£ 9,19
NIW je Anteil	SGD 56,96	SGD 55,23	SGD 67,40		Investor NOK (Hedged):			
H Institutional:					thesaurierend	NOK 5.387	NOK 5.222	NOK 6.610
thesaurierend	\$ 264.425	\$ 302.479	\$ 284.247		ausgegebene und umlaufende Anteile	50	50	50
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.773	6.875	5.348		NIW je Anteil	NOK 107,24	NOK 103,95	NOK 131,59
NIW je Anteil	\$ 45,81	\$ 44,00	\$ 53,15		Investor SEK (Hedged):			
Erträge	\$ 220	\$ 217	\$ 275		thesaurierend	SEK 25.694	SEK 27.736	SEK 10.725
ausgegebene und umlaufende Anteile	29	29	29		ausgegebene und umlaufende Anteile	262	292	89
NIW je Anteil	\$ 7,64	\$ 7,55	\$ 9,57		NIW je Anteil	SEK 97,97	SEK 95,02	SEK 121,06
M Retail:					Administrative:			
Erträge	\$ 8.535	\$ 8.675	\$ 12.295		thesaurierend	\$ 327	\$ 314	\$ 632
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.054	1.085	1.214		ausgegebene und umlaufende Anteile	37	37	59
NIW je Anteil	\$ 8,10	\$ 8,00	\$ 10,13		NIW je Anteil	\$ 8,88	\$ 8,53	\$ 10,67
ausschüttend II	\$ 4.105	\$ 3.190	\$ 3.720		Erträge	\$ 732	\$ 718	\$ 992
ausgegebene und umlaufende Anteile	606	473	428		ausgegebene und umlaufende Anteile	95	95	101
NIW je Anteil	\$ 6,78	\$ 6,75	\$ 8,68		NIW je Anteil	\$ 7,67	\$ 7,53	\$ 9,81
M Retail AUD (Hedged):					Administrative SEK (Hedged):			
Erträge	AUD 2.087	AUD 1.510	AUD 7.264		thesaurierend	SEK 203	SEK 105	SEK 85
ausgegebene und umlaufende Anteile	288	209	784		ausgegebene und umlaufende Anteile	3	1	1
NIW je Anteil	AUD 7,24	AUD 7,22	AUD 9,27		NIW je Anteil	SEK 79,95	SEK 77,61	SEK 99,05
Z Class:					E Class:			
Erträge	\$ 10.803	\$ 5.279	\$ 6.317		thesaurierend	\$ 749	\$ 924	\$ 1.531
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.090	540	509		ausgegebene und umlaufende Anteile	93	120	158
NIW je Anteil	\$ 9,91	\$ 9,78	\$ 12,41		NIW je Anteil	\$ 8,02	\$ 7,71	\$ 9,68
Nettovermögen	\$ 2.372.964	\$ 2.492.475	\$ 2.635.769		Erträge	\$ 542	\$ 676	\$ 868
Institutional:					ausgegebene und umlaufende Anteile	74	94	92
thesaurierend	\$ 663.705	\$ 640.128	\$ 650.604		NIW je Anteil	\$ 7,36	\$ 7,23	\$ 9,41
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.995	45.303	37.005		E Class EUR (Hedged):			
NIW je Anteil	\$ 14,75	\$ 14,13	\$ 17,58		thesaurierend	€ 55.074	€ 57.844	€ 129.837
Erträge	\$ 249.514	\$ 306.128	\$ 305.572		ausgegebene und umlaufende Anteile	6.328	6.822	11.895
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.543	40.679	31.166		NIW je Anteil	€ 8,70	€ 8,48	€ 10,92
NIW je Anteil	\$ 7,67	\$ 7,53	\$ 9,80		Z Class:			
					thesaurierend	\$ 3.592	k. A.	k. A.
					ausgegebene und umlaufende Anteile	346	k. A.	k. A.
					NIW je Anteil	\$ 10,39	k. A.	k. A.
					<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 159.733	\$ 168.986	\$ 212.894					
Institutional:								
thesaurierend	\$ 10.965	\$ 8.279	\$ 9.507					
ausgegebene und umlaufende Anteile	696	535	532					
NIW je Anteil	\$ 15,76	\$ 15,48	\$ 17,88					



Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021		Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	
				<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund (Fortsetzung)</b>	<b>PIMCO ESG Income Fund</b>			
Institutional EUR (Hedged):					\$	\$	\$	
thesaurierend	€ 92.098	€ 102.077	€ 113.058	Nettovermögen	254.692	237.961	125.087	
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.070	7.881	7.392	Institutional:				
NIW je Anteil	€ 13,03	€ 12,95	€ 15,29	thesaurierend	\$ 46.808	\$ 23.414	\$ 5.465	
E Class:				ausgegebene und umlaufende Anteile	4.897	2.486	541	
thesaurierend	\$ 12.776	\$ 15.703	\$ 22.756	NIW je Anteil	\$ 9,56	\$ 9,42	\$ 10,10	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.077	1.342	1.668	Erträge	\$ 78	\$ 3.575	\$ 3.756	
NIW je Anteil	\$ 11,86	\$ 11,70	\$ 13,64	ausgegebene und umlaufende Anteile	9	393	375	
E Class CHF (Hedged):				NIW je Anteil	\$ 9,08	\$ 9,10	\$ 10,02	
thesaurierend	CHF 9.528	CHF 10.121	CHF 14.255	Institutional AUD (Hedged):				
ausgegebene und umlaufende Anteile	994	1.048	1.235	Erträge	AUD 67.951	AUD 57.036	AUD 14	
NIW je Anteil	CHF 9,58	CHF 9,66	CHF 11,54	ausgegebene und umlaufende Anteile	7.637	6.338	1	
E Class EUR (Hedged):				NIW je Anteil	AUD 8,90	AUD 9,00	AUD 10,00	
thesaurierend	€ 22.789	€ 23.540	€ 32.022	Institutional CHF (Hedged):				
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.004	2.072	2.365	thesaurierend	CHF 2.353	CHF 7.316	CHF 692	
NIW je Anteil	€ 11,38	€ 11,36	€ 13,54	ausgegebene und umlaufende Anteile	260	803	69	
				NIW je Anteil	CHF 9,05	CHF 9,11	CHF 10,02	
				Institutional EUR (Hedged):				
				thesaurierend	€ 87.068	€ 105.509	€ 72.025	
				ausgegebene und umlaufende Anteile	9.472	11.509	7.175	
				NIW je Anteil	€ 9,19	€ 9,17	€ 10,04	
				Erträge	€ 2.450	€ 1.925	€ 223	
				ausgegebene und umlaufende Anteile	281	217	22	
				NIW je Anteil	€ 8,72	€ 8,85	€ 9,95	
				Institutional GBP (Hedged):				
				Erträge	£ 400	£ 405	£ 482	
				ausgegebene und umlaufende Anteile	45	44	48	
				NIW je Anteil	£ 8,94	£ 9,00	£ 9,98	
				Institutional NOK (Hedged):				
				thesaurierend	NOK 93.795	k. A.	k. A.	
				ausgegebene und umlaufende Anteile	935	k. A.	k. A.	
				NIW je Anteil	NOK 100,29	k. A.	k. A.	
				Institutional SEK (Hedged):				
				thesaurierend	SEK 142.648	SEK 122.486	SEK 77.208	
				ausgegebene und umlaufende Anteile	1.549	1.335	772	
				NIW je Anteil	SEK 92,08	SEK 91,73	SEK 99,96	
				Institutional SGD (Hedged):				
				Erträge	SGD 378	SGD 367	SGD 366	
				ausgegebene und umlaufende Anteile	42	40	36	
				NIW je Anteil	SGD 9,02	SGD 9,09	SGD 10,02	
				Administrative SEK (Hedged):				
				thesaurierend	SEK 94.159	SEK 79.369	k. A.	
				ausgegebene und umlaufende Anteile	967	816	k. A.	
				NIW je Anteil	SEK 97,34	SEK 97,22	k. A.	
				E Class:				
				thesaurierend	\$ 2.136	\$ 1.433	\$ 285	
				ausgegebene und umlaufende Anteile	228	155	28	
				NIW je Anteil	\$ 9,38	\$ 9,28	\$ 10,04	
				Erträge	\$ 478	\$ 387	\$ 20	
				ausgegebene und umlaufende Anteile	53	43	2	
				NIW je Anteil	\$ 9,08	\$ 9,10	\$ 10,01	
				E Class CHF (Hedged):				
				Erträge	CHF 33	CHF 9	CHF 9	
				ausgegebene und umlaufende Anteile	4	1	1	
				NIW je Anteil	CHF 8,60	CHF 8,81	CHF 9,94	
				E Class EUR (Hedged):				
				thesaurierend	€ 5.878	€ 4.811	€ 1.113	
				ausgegebene und umlaufende Anteile	655	535	112	
				NIW je Anteil	€ 8,98	€ 8,99	€ 9,94	
				Erträge	€ 1.640	€ 1.016	€ 256	
				ausgegebene und umlaufende Anteile	188	115	26	
				NIW je Anteil	€ 8,73	€ 8,86	€ 9,96	

		Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>PIMCO ESG Income Fund (Fortsetzung)</b>				
R Class AUD (Hedged):				
Erträge	AUD	29.989	AUD 31.770	AUD 29.726
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.370	3.530	2.973
NIW je Anteil	AUD	8,90	AUD 9,00	AUD 10,00
<b>Euro Bond Fund</b>				
Nettovermögen	€	1.753.561	€ 1.913.275	€ 2.574.129
Institutional:				
thesaurierend	€	1.249.288	€ 1.386.127	€ 1.926.406
ausgegebene und umlaufende Anteile		56.667	64.252	73.731
NIW je Anteil	€	22,05	€ 21,57	€ 26,13
Erträge	€	40.452	€ 68.589	€ 92.872
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.884	4.956	5.474
NIW je Anteil	€	14,02	€ 13,84	€ 16,97
Institutional CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	311.440	CHF 313.292	CHF 351.467
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.434	10.631	9.789
NIW je Anteil	CHF	29,85	CHF 29,47	CHF 35,91
Investor:				
thesaurierend	€	17.505	€ 16.885	€ 23.320
ausgegebene und umlaufende Anteile		854	841	956
NIW je Anteil	€	20,49	€ 20,08	€ 24,41
Erträge		k. A.	k. A.	€ 236
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	k. A.	15
NIW je Anteil		k. A.	k. A.	€ 16,28
Administrative:				
thesaurierend		k. A.	k. A.	€ 2.579
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	k. A.	110
NIW je Anteil		k. A.	k. A.	€ 23,48
E Class:				
thesaurierend	€	104.052	€ 101.050	€ 151.006
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.517	5.451	6.666
NIW je Anteil	€	18,86	€ 18,54	€ 22,65
Erträge	€	23.186	€ 23.340	€ 38.508
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.291	2.337	3.146
NIW je Anteil	€	10,12	€ 9,99	€ 12,24
<b>Euro Credit Fund</b>				
Nettovermögen	€	609.939	€ 610.008	€ 1.017.163
Institutional:				
thesaurierend	€	321.840	€ 348.784	€ 743.335
ausgegebene und umlaufende Anteile		21.969	24.516	43.513
NIW je Anteil	€	14,65	€ 14,23	€ 17,08
ausschüttend II	€	13.728	€ 16.940	€ 80.562
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.499	1.879	7.303
NIW je Anteil	€	9,16	€ 9,02	€ 11,03
E Class:				
thesaurierend	€	39.190	€ 11.194	€ 18.325
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.420	1.001	1.353
NIW je Anteil	€	11,46	€ 11,18	€ 13,54

		Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Euro Credit Fund (Fortsetzung)</b>				
H Institutional:				
thesaurierend	€	235.086	€ 232.926	€ 173.091
ausgegebene und umlaufende Anteile		26.606	27.156	16.823
NIW je Anteil	€	8,84	€ 8,58	€ 10,29
ausschüttend II	€	95	€ 164	€ 1.850
ausgegebene und umlaufende Anteile		11	20	186
NIW je Anteil	€	8,28	€ 8,14	€ 9,93
<b>Euro Income Bond Fund</b>				
Nettovermögen	€	1.262.170	€ 1.352.980	€ 2.482.304
Institutional:				
thesaurierend	€	268.786	€ 332.727	€ 895.043
ausgegebene und umlaufende Anteile		18.780	23.944	56.691
NIW je Anteil	€	14,31	€ 13,90	€ 15,79
Erträge	€	63.189	€ 79.523	€ 128.548
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.688	8.533	11.833
NIW je Anteil	€	9,45	€ 9,32	€ 10,86
Investor:				
thesaurierend	€	11.955	€ 10.138	€ 14.129
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.302	1.136	1.388
NIW je Anteil	€	9,18	€ 8,93	€ 10,18
Erträge	€	7.961	€ 8.520	€ 10.907
ausgegebene und umlaufende Anteile		867	939	1.027
NIW je Anteil	€	9,19	€ 9,08	€ 10,62
E Class:				
thesaurierend	€	532.110	€ 540.713	€ 856.874
ausgegebene und umlaufende Anteile		41.541	43.285	59.839
NIW je Anteil	€	12,81	€ 12,49	€ 14,32
Erträge	€	344.813	€ 347.514	€ 527.452
ausgegebene und umlaufende Anteile		41.063	41.763	53.871
NIW je Anteil	€	8,40	€ 8,32	€ 9,79
Ausschüttend Q		k. A.	k. A.	€ 3.868
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	k. A.	406
NIW je Anteil		k. A.	k. A.	€ 9,53
T Class:				
thesaurierend	€	24.126	€ 24.746	€ 32.571
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.452	2.573	2.943
NIW je Anteil	€	9,84	€ 9,62	€ 11,07
Erträge	€	9.230	€ 9.099	€ 12.914
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.242	1.234	1.482
NIW je Anteil	€	7,43	€ 7,38	€ 8,72
<b>Euro Long Average Duration Fund</b>				
Nettovermögen	€	449.965	€ 110.048	€ 160.601
Institutional:				
thesaurierend	€	449.965	€ 110.048	€ 160.601
ausgegebene und umlaufende Anteile		22.644	5.786	5.426
NIW je Anteil	€	19,87	€ 19,02	€ 29,60
<b>Euro Short-Term Fund</b>				
Nettovermögen	€	213.359	€ 353.095	€ 629.859
Institutional:				
thesaurierend	€	199.267	€ 339.031	€ 616.693
ausgegebene und umlaufende Anteile		16.588	28.689	51.558
NIW je Anteil	€	12,01	€ 11,82	€ 11,96
E Class:				
thesaurierend	€	14.092	€ 14.064	€ 13.166
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.335	1.350	1.239
NIW je Anteil	€	10,55	€ 10,42	€ 10,63

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>PIMCO European High Yield Bond Fund</b>			
Nettovermögen	€ 224.673	€ 174.162	€ 170.489
Institutional:			
thesaurierend	€ 113.197	€ 32.875	€ 12.500
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.107	3.379	1.159
NIW je Anteil	€ 10,19	€ 9,73	€ 10,79
E Class:			
thesaurierend	€ 807	€ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	77	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,42	€ 10,00	k. A.
Erträge	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,04	k. A.	k. A.
Z Class:			
thesaurierend	€ 110.660	€ 141.277	€ 157.989
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.663	14.301	14.501
NIW je Anteil	€ 10,38	€ 9,88	€ 10,90
<b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b>			
Nettovermögen	€ 147.878	€ 211.172	€ 395.491
Institutional:			
thesaurierend	€ 79.010	€ 127.942	€ 254.925
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.148	11.637	22.466
NIW je Anteil	€ 11,05	€ 10,99	€ 11,35
E Class:			
thesaurierend	€ 9.635	€ 7.775	€ 4.368
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.020	826	447
NIW je Anteil	€ 9,45	€ 9,42	€ 9,77
H Institutional:			
thesaurierend	€ 59.233	€ 75.455	€ 136.198
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.179	7.907	13.806
NIW je Anteil	€ 9,59	€ 9,54	€ 9,87
<b>Global Advantage Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 411.615	\$ 410.459	\$ 521.067
Institutional:			
thesaurierend	\$ 8.132	\$ 7.716	\$ 24.968
ausgegebene und umlaufende Anteile	601	582	1.630
NIW je Anteil	\$ 13,52	\$ 13,28	\$ 15,32
Institutional CHF (Partially Hedged):			
Erträge	CHF 108.436	CHF 111.046	CHF 132.681
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.443	12.487	12.823
NIW je Anteil	CHF 8,71	CHF 8,89	CHF 10,35
Institutional EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 201.137	€ 203.446	€ 237.602
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.529	15.828	16.656
NIW je Anteil	€ 12,95	€ 12,85	€ 14,26
Institutional GBP (Partially Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	£ 182
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	14
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 13,42
Institutional NOK (Partially Hedged):			
thesaurierend	NOK 600.953	NOK 577.381	NOK 625.501
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.103	4.099	4.093
NIW je Anteil	NOK 146,48	NOK 140,84	NOK 152,81
E Class EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 6.182	€ 6.540	€ 8.002
ausgegebene und umlaufende Anteile	543	576	629
NIW je Anteil	€ 11,39	€ 11,36	€ 12,73

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Global Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 12.611.710	\$ 11.420.112	\$ 14.038.846
Institutional:			
thesaurierend	\$ 3.966.129	\$ 3.410.090	\$ 3.999.850
ausgegebene und umlaufende Anteile	121.631	107.593	111.904
NIW je Anteil	\$ 32,61	\$ 31,69	\$ 35,74
Erträge	\$ 200.181	\$ 172.513	\$ 203.191
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.278	9.898	10.136
NIW je Anteil	\$ 17,75	\$ 17,43	\$ 20,05
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 435.322	\$ 326.665	\$ 328.710
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.802	11.261	9.512
NIW je Anteil	\$ 29,41	\$ 29,01	\$ 34,56
Erträge	\$ 19.508	\$ 19.875	\$ 26.341
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.056	1.080	1.178
NIW je Anteil	\$ 18,47	\$ 18,41	\$ 22,37
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 53.605	CAD 54.563	CAD 72.089
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.169	5.395	6.309
NIW je Anteil	CAD 10,37	CAD 10,11	CAD 11,43
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 408.918	CHF 440.925	CHF 552.547
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.541	14.706	15.928
NIW je Anteil	CHF 30,20	CHF 29,98	CHF 34,69
Erträge	CHF 141.629	CHF 175.781	CHF 218.701
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.158	10.095	10.645
NIW je Anteil	CHF 17,36	CHF 17,41	CHF 20,54
Institutional EUR (Currency Exposure):			
thesaurierend	€ 221.278	€ 190.480	€ 139.337
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.347	14.810	9.692
NIW je Anteil	€ 12,76	€ 12,86	€ 14,38
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.003.719	€ 1.974.600	€ 2.453.258
ausgegebene und umlaufende Anteile	78.173	78.287	84.453
NIW je Anteil	€ 25,63	€ 25,22	€ 29,05
Erträge	€ 654.475	€ 512.652	€ 628.774
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.060	32.355	33.781
NIW je Anteil	€ 15,94	€ 15,84	€ 18,61
Institutional GBP (Currency Exposure):			
thesaurierend	£ 3.398	£ 3.343	£ 3.600
ausgegebene und umlaufende Anteile	332	313	319
NIW je Anteil	£ 10,24	£ 10,68	£ 11,30
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 152.551	£ 162.896	£ 198.000
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.207	7.879	8.429
NIW je Anteil	£ 21,17	£ 20,68	£ 23,49
Erträge	£ 124.770	£ 132.242	£ 191.729
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.180	10.904	13.574
NIW je Anteil	£ 12,26	£ 12,13	£ 14,13

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022
<b>Global Bond Fund (Fortsetzung)</b>						
Institutional ILS (Hedged): thesaurierend		k. A.		k. A.	ILS	304
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		18
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	ILS	16,75
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend	NOK	2.304.436	NOK	2.918.045	NOK	4.130.842
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.023		14.215		17.688
NIW je Anteil	NOK	209,05	NOK	205,28	NOK	233,55
Institutional NZD (Hedged): Erträge	NZD	171.963	NZD	167.929	NZD	309.397
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.194		4.162		6.643
NIW je Anteil	NZD	41,00	NZD	40,35	NZD	46,57
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend	SEK	1.153.251	SEK	1.120.588	SEK	1.219.998
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.778		5.712		5.426
NIW je Anteil	SEK	199,58	SEK	196,17	SEK	224,86
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend	SGD	250.973	SGD	217.237	SGD	174.944
ausgegebene und umlaufende Anteile		14.307		12.665		9.030
NIW je Anteil	SGD	17,54	SGD	17,15	SGD	19,37
Erträge	SGD	17		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		2		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	SGD	10,03		k. A.		k. A.
Investor: thesaurierend	\$	194.564	\$	94.643	\$	135.136
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.492		3.244		4.092
NIW je Anteil	\$	29,97	\$	29,18	\$	33,02
Erträge	\$	51.329	\$	28.517	\$	7.773
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.442		1.948		462
NIW je Anteil	\$	14,91	\$	14,64	\$	16,84
Investor (Currency Exposure): thesaurierend		k. A.		k. A.	\$	2.315
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		71
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	\$	32,58
Investor CHF (Hedged): thesaurierend	CHF	137.926	CHF	145.814	CHF	188.770
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.893		12.641		14.095
NIW je Anteil	CHF	11,60	CHF	11,53	CHF	13,39
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€	78.996	€	75.495	€	92.541
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.289		3.189		3.382
NIW je Anteil	€	24,02	€	23,68	€	27,36
Investor GBP (Hedged): thesaurierend	£	6.531	£	5.437	£	5.846
ausgegebene und umlaufende Anteile		329		280		264
NIW je Anteil	£	19,88	£	19,45	£	22,17
Investor NOK (Hedged): thesaurierend	NOK	44.393	NOK	23.662	NOK	28.765
ausgegebene und umlaufende Anteile		225		122		130
NIW je Anteil	NOK	196,93	NOK	193,71	NOK	221,16

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022
<b>Global Bond Fund (Fortsetzung)</b>						
Administrative: thesaurierend	\$	11.114	\$	9.565	\$	15.922
ausgegebene und umlaufende Anteile		382		337		495
NIW je Anteil	\$	29,12	\$	28,38	\$	32,16
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK	143.527	SEK	114.069	SEK	1.941
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.643		1.325		20
NIW je Anteil	SEK	87,36	SEK	86,08	SEK	99,17
E Class: thesaurierend	\$	364.774	\$	326.703	\$	463.700
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.087		12.006		14.974
NIW je Anteil	\$	27,87	\$	27,21	\$	30,97
Erträge	\$	154.008	\$	101.393	\$	117.421
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.012		8.054		8.111
NIW je Anteil	\$	12,82	\$	12,59	\$	14,48
E Class (Currency Exposure): thesaurierend	\$	41.771	\$	34.705	\$	61.145
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.570		2.994		4.389
NIW je Anteil	\$	11,70	\$	11,59	\$	13,93
Erträge	\$	20.543	\$	13.040	\$	16.440
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.078		1.324		1.374
NIW je Anteil	\$	9,89	\$	9,85	\$	11,97
E Class CHF (Hedged): thesaurierend	CHF	3.008	CHF	1.921	CHF	2.358
ausgegebene und umlaufende Anteile		336		215		226
NIW je Anteil	CHF	8,94	CHF	8,92	CHF	10,41
E Class EUR (Hedged): thesaurierend	€	713.262	€	685.427	€	959.543
ausgegebene und umlaufende Anteile		32.545		31.641		38.117
NIW je Anteil	€	21,92	€	21,66	€	25,17
Erträge	€	38.410	€	31.423	€	41.846
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.390		3.613		4.097
NIW je Anteil	€	8,75	€	8,70	€	10,22
E Class NOK (Hedged): thesaurierend		k. A.		k. A.	NOK	85
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		1
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	NOK	99,69
G Retail EUR (Hedged): Erträge	€	63.243	€	66.161	€	123.034
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.127		7.543		11.955
NIW je Anteil	€	8,87	€	8,77	€	10,29
H Institutional: thesaurierend	\$	881.595	\$	752.379	\$	835.136
ausgegebene und umlaufende Anteile		27.984		24.551		24.124
NIW je Anteil	\$	31,50	\$	30,65	\$	34,62
Erträge	\$	2.143	\$	2.035	\$	2.643
ausgegebene und umlaufende Anteile		239		231		261
NIW je Anteil	\$	8,95	\$	8,79	\$	10,11
H Institutional (Currency Exposure): thesaurierend	\$	66.028	\$	309.569	\$	756
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.975		37.885		78
NIW je Anteil	\$	8,28	\$	8,17	\$	9,75
M Retail: ausschüttend II	\$	1.554	\$	1.358	\$	1.742
ausgegebene und umlaufende Anteile		173		153		168
NIW je Anteil	\$	8,99	\$	8,89	\$	10,34
M Retail HKD (Unhedged): ausschüttend II	HKD	13.199	HKD	5.118	HKD	8.307
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.459		575		802
NIW je Anteil	HKD	9,05	HKD	8,91	HKD	10,35
M Retail SEK (Hedged): thesaurierend		k. A.		k. A.	SEK	90
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		1
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	SEK	99,56

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

		Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Global Bond Fund (Fortsetzung)</b>				
M Retail SGD (Hedged):				
ausschüttend II	SGD	8.238	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		825	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD	9,98	k. A.	k. A.
R Class EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	6.030	€ 5.591	€ 6.442
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		563	530	528
NIW je Anteil	€	10,71	€ 10,56	€ 12,19
T Class:				
thesaurierend	\$	16.756	\$ 15.814	\$ 26.245
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		1.541	1.487	2.163
NIW je Anteil	\$	10,87	\$ 10,63	\$ 12,14
Erträge	\$	3.056	\$ 3.040	\$ 4.183
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		299	303	362
NIW je Anteil	\$	10,22	\$ 10,04	\$ 11,54
T Class EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	19.604	€ 14.560	€ 19.104
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		2.088	1.567	1.764
NIW je Anteil	€	9,39	€ 9,29	€ 10,83
W Class:				
thesaurierend	\$	87.738	\$ 24.415	\$ 29.951
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		9.498	2.721	2.962
NIW je Anteil	\$	9,24	\$ 8,97	\$ 10,11
Erträge	\$	44.217	\$ 9.498	\$ 9.066
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		5.057	1.106	919
NIW je Anteil	\$	8,74	\$ 8,59	\$ 9,87
ausschüttend II	\$	10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$	10,06	k. A.	k. A.
W Class (Currency Exposure):				
thesaurierend		k. A.	k. A.	\$ 10
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil		k. A.	k. A.	\$ 10,00
Erträge		k. A.	k. A.	\$ 10
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil		k. A.	k. A.	\$ 9,77
W Class CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	27.948	CHF 24.828	CHF 33.361
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		3.222	2.884	3.352
NIW je Anteil	CHF	8,68	CHF 8,61	CHF 9,95
Erträge	CHF	2.888	CHF 705	CHF 740
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		352	86	76
NIW je Anteil	CHF	8,21	CHF 8,24	CHF 9,72
W Class EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	16.592	€ 9.594	€ 14.976
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		1.881	1.106	1.500
NIW je Anteil	€	8,82	€ 8,68	€ 9,98
Erträge	€	3.775	€ 2.352	€ 2.251
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		452	283	231
NIW je Anteil	€	8,35	€ 8,30	€ 9,75
W Class GBP (Hedged):				
thesaurierend	£	10.991	£ 2.383	£ 1.265
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		1.209	268	126
NIW je Anteil	£	9,09	£ 8,88	£ 10,08
Erträge	£	8.358	£ 5.877	£ 9.060
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		971	692	921
NIW je Anteil	£	8,61	£ 8,49	£ 9,84
W Class NOK (Hedged):				
thesaurierend	NOK	6.347	NOK 4.083	NOK 3.799
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		71	46	38
NIW je Anteil	NOK	90,02	NOK 88,35	NOK 100,41

		Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Global Bond Fund (Fortsetzung)</b>				
W Class SEK (Hedged):				
thesaurierend		k. A.	k. A.	SEK 89
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil		k. A.	k. A.	SEK 100,33
W Class SGD (Hedged):				
ausschüttend II	SGD	8.489	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		847	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD	10,02	k. A.	k. A.
<b>Global Bond ESG Fund</b>				
Nettovermögen	\$	3.344.834	\$ 3.106.190	\$ 2.302.966
Institutional:				
thesaurierend	\$	306.549	\$ 366.227	\$ 300.944
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		28.199	34.584	25.077
NIW je Anteil	\$	10,87	\$ 10,59	\$ 12,00
Erträge	\$	48.694	\$ 65.549	\$ 25.309
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		5.270	7.213	2.428
NIW je Anteil	\$	9,24	\$ 9,09	\$ 10,43
Institutional CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	586.386	CHF 454.679	CHF 22.579
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		63.579	49.550	2.115
NIW je Anteil	CHF	9,22	CHF 9,18	CHF 10,67
Institutional EUR (Currency Exposure):				
thesaurierend	€	753	€ 3.933	€ 856
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		86	444	86
NIW je Anteil	€	8,76	€ 8,85	€ 9,96
Institutional EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	866.995	€ 957.548	€ 623.870
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		91.026	101.940	57.390
NIW je Anteil	€	9,52	€ 9,39	€ 10,87
Erträge	€	68.746	€ 92.352	€ 111.407
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		7.928	10.695	11.012
NIW je Anteil	€	8,67	€ 8,63	€ 10,12
Institutional GBP (Currency Exposure):				
Erträge	£	8	£ 8	k. A.
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		1	1	k. A.
NIW je Anteil	£	9,03	£ 9,55	k. A.
Institutional GBP (Hedged):				
thesaurierend	£	2.345	£ 2.394	£ 16.849
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		254	266	1.634
NIW je Anteil	£	9,22	£ 9,03	£ 10,31
Erträge	£	280.534	£ 84.397	£ 75.165
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		30.396	9.242	7.117
NIW je Anteil	£	9,23	£ 9,13	£ 10,56
Institutional GBP (Unhedged):				
Erträge	£	23.988	£ 20.996	£ 23.387
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		2.664	2.240	2.448
NIW je Anteil	£	9,01	£ 9,37	£ 9,55
Institutional NOK (Hedged):				
thesaurierend	NOK	5.924.379	NOK 5.366.868	NOK 5.205.593
ausgegebene und umlaufende				
Anteile		576.649	531.175	450.696
NIW je Anteil	NOK	10,27	NOK 10,10	NOK 11,55

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	30. Jun. 2022	31. Dez. 2021	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020
<b>Global Bond ESG Fund (Fortsetzung)</b>						
Institutional NZD (Hedged):	NZD	66.272	NZD	64.722	NZD	74.299
Erträge						
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.817		6.755		6.732
NIW je Anteil	NZD	9,72	NZD	9,58	NZD	11,04
Institutional SEK (Hedged):	SEK	149.958	SEK	504.943	SEK	568.764
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.699		5.807		5.678
NIW je Anteil	SEK	88,28	SEK	86,95	SEK	100,17
Investor:						
thesaurierend	\$	11.112	\$	8.195	\$	12.127
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.073		811		1.055
NIW je Anteil	\$	10,35	\$	10,10	\$	11,49
Administrative:						
thesaurierend		k. A.		k. A.		2.318
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		208
NIW je Anteil		k. A.		k. A.		11,12
Erträge		k. A.		k. A.		11
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		1
NIW je Anteil		k. A.		k. A.		10,82
Administrative SEK (Hedged):	SEK	103		k. A.		k. A.
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	SEK	99,81		k. A.		k. A.
E Class:						
Erträge	\$	4.262	\$	3.846	\$	2.115
ausgegebene und umlaufende Anteile		445		408		196
NIW je Anteil	\$	9,58	\$	9,42	\$	10,81
E Class CHF (Hedged):	CHF	750	CHF	77		k. A.
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		78		8		k. A.
NIW je Anteil	CHF	9,67	CHF	9,66		k. A.
E Class EUR (Hedged):	€	41.034	€	38.263	€	48.847
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.556		4.288		4.688
NIW je Anteil	€	9,01	€	8,92	€	10,42
Z Class AUD (Hedged):	AUD	381.343	AUD	356.037	AUD	250.833
Erträge						
ausgegebene und umlaufende Anteile		39.825		37.495		22.777
NIW je Anteil	AUD	9,58	AUD	9,50	AUD	11,01
Nettovermögen	\$	730.576	\$	716.022	\$	911.707
Institutional:						
thesaurierend	\$	431.110	\$	420.156	\$	527.915
ausgegebene und umlaufende Anteile		18.628		18.790		21.249
NIW je Anteil	\$	23,14	\$	22,36	\$	24,84
Erträge	\$	33.473	\$	32.820	\$	52.506
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.200		2.206		3.117
NIW je Anteil	\$	15,21	\$	14,88	\$	16,85
Institutional EUR (Hedged):	€	22.664	€	45.032	€	23.841
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.385		2.816		1.315
NIW je Anteil	€	16,37	€	15,99	€	18,13
Investor:						
thesaurierend	\$	6.695	\$	6.657	\$	17.194
ausgegebene und umlaufende Anteile		308		316		732
NIW je Anteil	\$	21,77	\$	21,07	\$	23,49
Administrative:						
thesaurierend	\$	10.266	\$	10.720	\$	12.451
ausgegebene und umlaufende Anteile		487		525		546
NIW je Anteil	\$	21,07	\$	20,41	\$	22,79

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	30. Jun. 2022	31. Dez. 2021	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020
<b>Global Bond Ex-US Fund (Fortsetzung)</b>						
E Class:						
Erträge	\$	48.103	\$	23.336	\$	54.115
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.255		1.615		3.309
NIW je Anteil	\$	14,78	\$	14,45	\$	16,36
E Class (Currency Exposure):						
Erträge	\$	57.147	\$	62.837	\$	81.361
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.182		7.858		8.142
NIW je Anteil	\$	7,96	\$	8,00	\$	9,99
H Institutional:						
thesaurierend	\$	10.405	\$	6.714	\$	1.160
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.000		667		104
NIW je Anteil	\$	10,40	\$	10,06	\$	11,20
Z Class:						
thesaurierend	\$	108.652	\$	104.722	\$	137.893
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.957		10.957		13.049
NIW je Anteil	\$	9,92	\$	9,56	\$	10,57
Nettovermögen	\$	668.587	\$	750.076	\$	1.035.021
Institutional:						
thesaurierend	\$	29.697	\$	30.140	\$	37.389
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.416		1.526		1.571
NIW je Anteil	\$	20,97	\$	19,74	\$	23,80
Institutional EUR (Hedged):	€	163.646	€	204.979	€	352.099
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.827		11.632		16.474
NIW je Anteil	€	18,54	€	17,62	€	21,37
Institutional GBP (Hedged):	£	3.185	£	3.301	£	4.301
Erträge						
ausgegebene und umlaufende Anteile		307		331		345
NIW je Anteil	£	10,38	£	9,99	£	12,45
Investor:						
thesaurierend	\$	10.783	\$	10.303	\$	10.116
ausgegebene und umlaufende Anteile		695		704		571
NIW je Anteil	\$	15,52	\$	14,63	\$	17,70
E Class:						
thesaurierend	\$	31.973	\$	32.627	\$	40.303
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.802		1.942		1.966
NIW je Anteil	\$	17,74	\$	16,80	\$	20,50
Erträge	\$	12.324	\$	13.011	\$	13.372
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.325		1.448		1.172
NIW je Anteil	\$	9,30	\$	8,98	\$	11,41
E Class EUR (Hedged):	€	219.668	€	217.239	€	230.733
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		14.015		14.494		12.541
NIW je Anteil	€	15,67	€	14,99	€	18,40
Erträge	€	49.132	€	49.389	€	57.708
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.891		6.071		5.551
NIW je Anteil	€	8,34	€	8,14	€	10,40
H Institutional:						
thesaurierend	\$	10	\$	9	\$	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	\$	10,01	\$	9,43	\$	k. A.
Erträge	\$	10	\$	9	\$	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	\$	9,55	\$	9,18	\$	k. A.
Z Class:						
thesaurierend	\$	107.942	\$	156.684	\$	199.594
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.871		10.644		11.355
NIW je Anteil	\$	15,71	\$	14,72	\$	17,58



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Global High Yield Bond Fund		
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Nettovermögen	\$ 3.069.836\$	3.102.868\$	5.169.160
Institutional:			
thesaurierend	\$ 603.637\$	579.939\$	844.967
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.235	22.368	29.240
NIW je Anteil	\$ 27,15\$	25,93\$	28,90
Erträge	\$ 292.557\$	292.202\$	489.734
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.353	29.927	42.937
NIW je Anteil	\$ 9,97\$	9,76\$	11,41
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 23.368CHF	22.915CHF	38.082
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.431	1.439	2.089
NIW je Anteil	CHF 16,33CHF	15,92CHF	18,23
Erträge	CHF 2.775CHF	3.237CHF	16.630
ausgegebene und umlaufende Anteile	374	436	1.863
NIW je Anteil	CHF 7,42CHF	7,43CHF	8,93
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 697.933€	725.182€	1.232.938
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.367	32.640	48.671
NIW je Anteil	€ 22,98€	22,22€	25,33
Erträge	€ 130.874€	155.150€	119.724
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.258	15.853	10.243
NIW je Anteil	€ 9,87€	9,79€	11,69
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 37.494£	31.335£	239.206
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.446	2.130	14.437
NIW je Anteil	£ 15,33£	14,71£	16,57
Erträge	£ 277.935£	292.800£	557.487
ausgegebene und umlaufende Anteile	55.590	59.445	95.775
NIW je Anteil	£ 5,00£	4,93£	5,82
Investor:			
thesaurierend	\$ 1.609\$	1.820\$	12.295
ausgegebene und umlaufende Anteile	126	149	902
NIW je Anteil	\$ 12,74\$	12,19\$	13,64
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 5.598€	12.416€	5.703
ausgegebene und umlaufende Anteile	255	583	234
NIW je Anteil	€ 21,99€	21,30€	24,37
Administrative:			
thesaurierend	\$ 31.001\$	30.795\$	50.855
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.230	1.276	1.881
NIW je Anteil	\$ 25,21\$	24,14\$	27,04
Erträge	\$ 16.535\$	21.259\$	32.985
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.695	2.225	2.956
NIW je Anteil	\$ 9,76\$	9,56\$	11,16
Administrative EUR (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.€	1.908
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	196
NIW je Anteil	k. A.	k. A.€	9,71
Administrative GBP (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.£	1.111
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	106
NIW je Anteil	k. A.	k. A.£	10,44

	Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
BM Retail:			
ausschüttend II	\$ 698	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	74	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,42	\$ 9,34	k. A.
E Class:			
thesaurierend	\$ 132.190	\$ 129.353	\$ 186.558
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.662	5.776	7.407
NIW je Anteil	\$ 23,35	\$ 22,40	\$ 25,19
Erträge	\$ 93.498	\$ 109.532	\$ 151.015
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.523	11.389	13.453
NIW je Anteil	\$ 9,82	\$ 9,62	\$ 11,23
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 228.096	€ 224.727	€ 299.451
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.274	10.424	12.074
NIW je Anteil	€ 22,20	€ 21,56	€ 24,80
Erträge	€ 27.189	€ 27.782	€ 38.159
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.369	3.472	3.992
NIW je Anteil	€ 8,07	€ 8,00	€ 9,56
E Class GBP (Hedged):			
Erträge	£ 4.859	£ 5.932	£ 7.285
ausgegebene und umlaufende Anteile	461	572	595
NIW je Anteil	£ 10,55	£ 10,38	£ 12,25
E Class SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 7.490	SGD 6.387	SGD 11.731
ausgegebene und umlaufende Anteile	822	711	1.116
NIW je Anteil	SGD 9,11	SGD 8,98	SGD 10,52
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 192.953	\$ 218.500	\$ 82.082
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.403	8.771	2.952
NIW je Anteil	\$ 26,07	\$ 24,91	\$ 27,81
Erträge	\$ 14.121	\$ 4.003	\$ 10.759
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.598	462	1.064
NIW je Anteil	\$ 8,84	\$ 8,66	\$ 10,11
M Retail:			
Erträge	\$ 17.428	\$ 17.710	\$ 25.552
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.798	1.865	2.306
NIW je Anteil	\$ 9,69	\$ 9,50	\$ 11,08
ausschüttend II	\$ 32.785	\$ 35.654	\$ 107.627
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.221	4.652	11.857
NIW je Anteil	\$ 7,77	\$ 7,66	\$ 9,08
R Class:			
thesaurierend	\$ 2.607	\$ 2.617	\$ 73.221
ausgegebene und umlaufende Anteile	175	184	4.598
NIW je Anteil	\$ 14,90	\$ 14,25	\$ 15,92
T Class:			
thesaurierend	\$ 5.577	\$ 5.339	\$ 7.458
ausgegebene und umlaufende Anteile	449	448	554
NIW je Anteil	\$ 12,41	\$ 11,93	\$ 13,47
Erträge	\$ 1.833	\$ 1.796	\$ 2.373
ausgegebene und umlaufende Anteile	200	200	227
NIW je Anteil	\$ 9,15	\$ 8,96	\$ 10,46
T Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A. €	1.450
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	130
NIW je Anteil	k. A.	k. A. €	11,14



	Global Investment Grade Credit Fund			Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)			
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	
Nettovermögen	\$ 10.492.851	\$ 10.538.341	\$ 17.154.925	£ 774.234	£ 767.395	£ 1.684.722	
Institutional:							
thesaurierend	\$ 2.487.175	\$ 2.618.560	\$ 3.806.107				
ausgegebene und umlaufende Anteile	129.215	140.682	172.781	69.315	69.403	123.537	
NIW je Anteil	\$ 19,25	\$ 18,61	\$ 22,03	£ 11,17	£ 11,06	£ 13,64	
Erträge	\$ 532.043	\$ 474.941	\$ 705.907				
ausgegebene und umlaufende Anteile	48.764	44.276	53.902				
NIW je Anteil	\$ 10,91	\$ 10,73	\$ 13,10				
Institutional (Currency Exposure):							
thesaurierend	\$ 105.945	\$ 100.855	\$ 86.823	k. A.	k. A.	HUF 9.873.261	
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.520	7.439	5.244	k. A.	k. A.	1.025.701	
NIW je Anteil	\$ 14,09	\$ 13,56	\$ 16,56	k. A.	k. A.	HUF 9,63	
Erträge	\$ 21.149	\$ 22.435	\$ 33.395	k. A.	k. A.	ILS 9,004	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.613	2.833	3.347	k. A.	k. A.	ILS 531	
NIW je Anteil	\$ 8,09	\$ 7,92	\$ 9,98	k. A.	k. A.	ILS 16,96	
Institutional AUD (Hedged):							
Erträge	AUD 6.755	AUD 7.370	AUD 90.155	NOK 262.868	NOK 258.128	NOK 429.061	
ausgegebene und umlaufende Anteile	783	861	8.528	1.921	1.931	2.683	
NIW je Anteil	AUD 8,63	AUD 8,56	AUD 10,57	NOK 136,86	NOK 133,69	NOK 159,90	
Institutional CAD (Hedged):							
Erträge	k. A.	k. A.	CAD 12				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1				
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CAD 9,70				
Institutional CHF (Hedged):							
thesaurierend	CHF 545.661	CHF 656.465	CHF 814.188	PLN 120.869			
ausgegebene und umlaufende Anteile	36.427	44.353	45.260	ausgegebene und umlaufende Anteile			
NIW je Anteil	CHF 14,98	CHF 14,80	CHF 17,99	185.349	176.118	211.649	
Erträge	CHF 32.601	CHF 33.474	CHF 49.517	NIW je Anteil	SEK 14,68	SEK 14,35	SEK 17,28
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.572	4.674	5.516				
NIW je Anteil	CHF 7,13	CHF 7,16	CHF 8,98				
Institutional CZK (Hedged):							
Erträge	CZK 246.708	CZK 339.010	CZK 2.085.033				
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.448	41.499	216.797				
NIW je Anteil	CZK 8,38	CZK 8,17	CZK 9,62				
Institutional EUR (Currency Exposure):							
thesaurierend	€ 47.121	€ 43.714	€ 39.844				
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.649	3.441	2.737				
NIW je Anteil	€ 12,91	€ 12,70	€ 14,56				
Institutional EUR (Hedged):							
thesaurierend	€ 1.105.573	€ 1.343.974	€ 2.237.224				
ausgegebene und umlaufende Anteile	64.414	79.965	109.970				
NIW je Anteil	€ 17,16	€ 16,81	€ 20,34				
Erträge	€ 420.978	€ 447.965	€ 803.485				
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.462	47.525	68.258				
NIW je Anteil	€ 9,47	€ 9,43	€ 11,77				
Institutional GBP (Hedged):							
thesaurierend	£ 164.090	£ 112.550	£ 258.867				
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.522	6.014	11.576				
NIW je Anteil	£ 19,26	£ 18,72	£ 22,36				
Erträge							
ausgegebene und umlaufende Anteile							
NIW je Anteil							
Institutional HUF (Hedged):							
thesaurierend							
ausgegebene und umlaufende Anteile							
NIW je Anteil							
Institutional ILS (Hedged):							
thesaurierend							
ausgegebene und umlaufende Anteile							
NIW je Anteil							
Institutional NOK (Hedged):							
thesaurierend							
ausgegebene und umlaufende Anteile							
NIW je Anteil							
Institutional PLN (Hedged):							
thesaurierend							
ausgegebene und umlaufende Anteile							
NIW je Anteil							
Institutional SEK (Hedged):							
thesaurierend							
ausgegebene und umlaufende Anteile							
NIW je Anteil							
Institutional SGD (Hedged):							
thesaurierend							
ausgegebene und umlaufende Anteile							
NIW je Anteil							
Investor:							
thesaurierend	\$ 362.677	\$ 440.714	\$ 988.957				
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.322	21.729	41.056				
NIW je Anteil	\$ 20,94	\$ 20,28	\$ 24,09				
Erträge	\$ 143.514	\$ 131.169	\$ 92.275				
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.360	11.489	6.624				
NIW je Anteil	\$ 11,61	\$ 11,42	\$ 13,93				
Investor AUD (Hedged):							
Erträge	AUD 8.279	AUD 10.542	AUD 5.854				
ausgegebene und umlaufende Anteile	978	1.256	565				
NIW je Anteil	AUD 8,46	AUD 8,39	AUD 10,37				
Investor CAD (Hedged):							
Erträge	k. A.	k. A.	CAD 1.822				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	175				
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CAD 10,44				
Investor CHF (Hedged):							
thesaurierend	CHF 4.990	CHF 5.359	CHF 7.624				
ausgegebene und umlaufende Anteile	456	494	577				
NIW je Anteil	CHF 10,95	CHF 10,84	CHF 13,22				
Erträge	CHF 4.101	CHF 5.334	CHF 8.176				
ausgegebene und umlaufende Anteile	447	578	707				
NIW je Anteil	CHF 9,18	CHF 9,23	CHF 11,56				
Investor EUR (Hedged):							
thesaurierend	€ 24.702	€ 26.086	€ 49.619				
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.529	1.646	2.577				
NIW je Anteil	€ 16,16	€ 15,85	€ 19,25				

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)</b>			
Erträge	€ 10.682	€ 11.379	€ 16.646
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.076	1.151	1.349
NIW je Anteil	€ 9,93	€ 9,88	€ 12,34
Investor GBP (Hedged):			
Erträge	£ 4.161	£ 4.175	£ 5.735
ausgegebene und umlaufende Anteile	383	389	433
NIW je Anteil	£ 10,86	£ 10,73	£ 13,23
Investor RMB (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	CNH 3.345
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	30
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CNH 111,93
Investor SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 8.454	SGD 7.277	SGD 7.473
ausgegebene und umlaufende Anteile	979	852	715
NIW je Anteil	SGD 8,63	SGD 8,54	SGD 10,45
Administrative:			
thesaurierend	\$ 78.873	\$ 76.931	\$ 215.743
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.404	4.431	10.444
NIW je Anteil	\$ 17,91	\$ 17,36	\$ 20,66
Erträge	\$ 72.099	\$ 47.290	\$ 99.369
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.424	4.285	7.378
NIW je Anteil	\$ 11,22	\$ 11,04	\$ 13,47
Administrative CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 168	CHF 391	CHF 629
ausgegebene und umlaufende Anteile	17	41	54
NIW je Anteil	CHF 9,63	CHF 9,54	CHF 11,65
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 11.659	€ 7.522	€ 9.518
ausgegebene und umlaufende Anteile	765	503	523
NIW je Anteil	€ 15,25	€ 14,97	€ 18,21
Erträge	€ 8.889	€ 7.846	€ 9.315
ausgegebene und umlaufende Anteile	927	822	782
NIW je Anteil	€ 9,59	€ 9,54	€ 11,91
Administrative GBP (Hedged):			
Erträge	£ 6.607	£ 4.557	£ 6.985
ausgegebene und umlaufende Anteile	611	427	531
NIW je Anteil	£ 10,81	£ 10,68	£ 13,17
Administrative HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 34.774	HKD 10.505	HKD 12.810
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.033	1.244	1.244
NIW je Anteil	HKD 8,62	HKD 8,44	HKD 10,30
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 309.125	SEK 901.901	SEK 936.226
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.862	88.869	76.221
NIW je Anteil	SEK 10,35	SEK 10,15	SEK 12,28
Administrative SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 14.957	SGD 2.918	SGD 5.459
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.796	354	542
NIW je Anteil	SGD 8,33	SGD 8,24	SGD 10,08
E Class:			
thesaurierend	\$ 715.315	\$ 605.749	\$ 799.659
ausgegebene und umlaufende Anteile	42.330	36.905	40.796
NIW je Anteil	\$ 16,90	\$ 16,41	\$ 19,60
Erträge	\$ 234.329	\$ 216.440	\$ 341.550
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.787	18.589	24.037
NIW je Anteil	\$ 11,84	\$ 11,64	\$ 14,21
E Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 50.739	CHF 52.629	CHF 78.253
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.111	5.342	6.476
NIW je Anteil	CHF 9,93	CHF 9,85	CHF 12,08
E Class EUR (Currency Exposure):			
Erträge	€ 1.339	€ 1.340	€ 3.077
ausgegebene und umlaufende Anteile	148	148	288
NIW je Anteil	€ 9,03	€ 9,03	€ 10,67

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)</b>			
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 350.509	€ 451.796	€ 630.730
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.856	31.264	35.735
NIW je Anteil	€ 14,69	€ 14,45	€ 17,65
Erträge	€ 193.818	€ 197.011	€ 271.438
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.730	24.230	26.741
NIW je Anteil	€ 8,17	€ 8,13	€ 10,15
E Class GBP (Hedged):			
Erträge	£ 23.084	£ 20.979	£ 31.335
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.045	1.881	2.279
NIW je Anteil	£ 11,29	£ 11,15	£ 13,75
E Class SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 39.609	SGD 30.453	SGD 37.343
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.467	3.472	3.481
NIW je Anteil	SGD 8,87	SGD 8,77	SGD 10,73
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 651.396	\$ 282.176	\$ 168.210
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.558	14.572	7.327
NIW je Anteil	\$ 20,01	\$ 19,36	\$ 22,96
Erträge	\$ 15.014	\$ 17.320	\$ 14.287
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.705	2.000	1.351
NIW je Anteil	\$ 8,81	\$ 8,66	\$ 10,57
H Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 10.495	\$ 184.082	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.255	22.850	1
NIW je Anteil	\$ 8,36	\$ 8,06	\$ 9,85
M Retail:			
Erträge	\$ 27.517	\$ 25.037	\$ 49.229
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.069	2.840	4.577
NIW je Anteil	\$ 8,97	\$ 8,82	\$ 10,76
ausschüttend II	\$ 95.460	\$ 86.672	\$ 120.251
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.844	10.861	12.179
NIW je Anteil	\$ 8,06	\$ 7,98	\$ 9,87
M Retail HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 8.840	HKD 8.376	HKD 9.145
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.024	990	887
NIW je Anteil	HKD 8,64	HKD 8,46	HKD 10,31
R Class:			
thesaurierend	\$ 12.877	\$ 16.316	\$ 28.433
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.055	1.381	2.028
NIW je Anteil	\$ 12,20	\$ 11,81	\$ 14,02
Erträge	\$ 5.517	\$ 4.870	\$ 6.925
ausgegebene und umlaufende Anteile	621	558	650
NIW je Anteil	\$ 8,88	\$ 8,73	\$ 10,66
R Class EUR (Hedged):			
Erträge	€ 2.320	€ 2.758	€ 6.026
ausgegebene und umlaufende Anteile	304	364	636
NIW je Anteil	€ 7,62	€ 7,59	€ 9,47
R Class GBP (Hedged):			
Erträge	£ 7.492	£ 8.117	£ 11.449
ausgegebene und umlaufende Anteile	910	998	1.141
NIW je Anteil	£ 8,24	£ 8,14	£ 10,04
T Class:			
thesaurierend	\$ 26.667	\$ 28.595	\$ 42.303
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.529	2.786	3.438
NIW je Anteil	\$ 10,54	\$ 10,26	\$ 12,30
T Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 4.449	€ 3.508	€ 4.875
ausgegebene und umlaufende Anteile	491	393	446
NIW je Anteil	€ 9,05	€ 8,92	€ 10,94

		Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)</b>				
W Class:				
thesaurierend	\$	46.198	\$ 32.822	\$ 66.615
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.185	3.811	6.543
NIW je Anteil	\$	8,91	\$ 8,61	\$ 10,18
Erträge	\$	16.919	\$ 11.533	\$ 20.732
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.072	1.437	2.116
NIW je Anteil	\$	8,16	\$ 8,03	\$ 9,80
W Class CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	20.785	CHF 20.144	CHF 32.864
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.486	2.440	3.278
NIW je Anteil	CHF	8,36	CHF 8,26	CHF 10,03
W Class EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	13.389	€ 14.812	€ 150.079
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.576	1.781	14.925
NIW je Anteil	€	8,49	€ 8,31	€ 10,06
Erträge	€	4.521	€ 2.194	€ 3.545
ausgegebene und umlaufende Anteile		582	283	367
NIW je Anteil	€	7,77	€ 7,74	€ 9,67
W Class GBP (Hedged):				
thesaurierend	£	5.032	£ 3.270	£ 515
ausgegebene und umlaufende Anteile		575	385	51
NIW je Anteil	£	8,75	£ 8,50	£ 10,15
Erträge	£	12.924	£ 6.970	£ 16.284
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.613	881	1.668
NIW je Anteil	£	8,01	£ 7,92	£ 9,76
W Class SGD (Hedged):				
Erträge	SGD	10.224	SGD 4.506	SGD 810
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.263	563	83
NIW je Anteil	SGD	8,09	SGD 8,01	SGD 9,79
<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund</b>				
Nettovermögen	\$	1.819.349	\$ 1.369.890	\$ 1.189.563
Institutional:				
thesaurierend	\$	64.807	\$ 61.632	\$ 39.212
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.067	5.924	3.211
NIW je Anteil	\$	10,68	\$ 10,40	\$ 12,21
Erträge	\$	118.837	\$ 10.347	\$ 19.429
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.246	1.167	1.825
NIW je Anteil	\$	8,97	\$ 8,86	\$ 10,65
Institutional CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	203.051	CHF 190.278	CHF 185.627
ausgegebene und umlaufende Anteile		21.510	20.258	16.381
NIW je Anteil	CHF	9,44	CHF 9,39	CHF 11,33
Erträge	CHF	2.855	CHF 2.020	CHF 3.002
ausgegebene und umlaufende Anteile		360	253	304
NIW je Anteil	CHF	7,93	CHF 8,00	CHF 9,88
Institutional EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	524.026	€ 220.186	€ 229.148
ausgegebene und umlaufende Anteile		54.149	23.072	19.996
NIW je Anteil	€	9,68	€ 9,54	€ 11,46

		Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)</b>				
Erträge	€	232.166	€ 320.757	€ 42.749
ausgegebene und umlaufende Anteile		28.732	39.702	4.306
NIW je Anteil	€	8,08	€ 8,08	€ 9,93
Institutional GBP (Hedged):				
thesaurierend	£	50.989	£ 72.284	£ 83.370
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.028	7.283	7.085
NIW je Anteil	£	10,14	£ 9,92	£ 11,77
Erträge	£	103.888	£ 87.512	£ 155.708
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.782	9.955	14.592
NIW je Anteil	£	8,82	£ 8,79	£ 10,67
Institutional SEK (Hedged):				
thesaurierend	SEK	26.192	SEK 11.028	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		249	106	k. A.
NIW je Anteil	SEK	105,23	SEK 103,64	k. A.
Investor EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€	10,05	k. A.	k. A.
Erträge	€	10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€	9,92	k. A.	k. A.
Investor:				
thesaurierend	\$	223	\$ 217	\$ 141
ausgegebene und umlaufende Anteile		25	25	14
NIW je Anteil	\$	8,78	\$ 8,56	\$ 10,09
Administrative SEK (Hedged):				
thesaurierend	SEK	3.672.748	SEK 3.047.191	SEK 2.293.688
ausgegebene und umlaufende Anteile		41.686	35.030	21.953
NIW je Anteil	SEK	88,10	SEK 86,99	SEK 104,48
E Class:				
thesaurierend	\$	6.254	\$ 1.735	\$ 3.820
ausgegebene und umlaufende Anteile		705	200	372
NIW je Anteil	\$	8,87	\$ 8,68	\$ 10,28
Erträge	\$	3.351	\$ 446	\$ 834
ausgegebene und umlaufende Anteile		392	53	82
NIW je Anteil	\$	8,55	\$ 8,45	\$ 10,15
E Class CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	356	CHF 491	CHF 194
ausgegebene und umlaufende Anteile		43	60	19
NIW je Anteil	CHF	8,22	CHF 8,22	CHF 10,01
Erträge	CHF	24	CHF 24	CHF 30
ausgegebene und umlaufende Anteile		3	3	3
NIW je Anteil	CHF	7,93	CHF 8,00	CHF 9,87
E Class EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	23.016	€ 3.370	€ 7.130
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.748	406	709
NIW je Anteil	€	8,38	€ 8,29	€ 10,05
Erträge	€	568	€ 581	€ 869
ausgegebene und umlaufende Anteile		70	72	88
NIW je Anteil	€	8,07	€ 8,07	€ 9,92

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021		Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	
				<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)</b>				
E Class GBP (Hedged):								
thesaurierend	£ 658	£ 420	£ 503					
ausgegebene und umlaufende Anteile	76	50	50					
NIW je Anteil	£ 8,63	£ 8,49	£ 10,16					
Erträge	k. A.	k. A.	£ 104					
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	10					
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 10,02					
Z Class:								
thesaurierend	\$ 4.349	\$ 19.339	\$ 22.582					
ausgegebene und umlaufende Anteile	434	1.986	1.986					
NIW je Anteil	\$ 10,02	\$ 9,74	\$ 11,37					
Nettovermögen	\$ 1.253.157	\$ 1.364.375	\$ 1.199.076					
				<b>Global Low Duration Real Return Fund</b>				
Institutional:								
thesaurierend	\$ 73.700	\$ 136.292	\$ 150.363					
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.167	11.554	12.580					
NIW je Anteil	\$ 11,95	\$ 11,80	\$ 11,95					
Institutional CHF (Hedged):								
thesaurierend	CHF 13.325	CHF 22.752	CHF 32.711					
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.360	2.303	3.190					
NIW je Anteil	CHF 9,80	CHF 9,88	CHF 10,25					
Institutional EUR (Hedged):								
thesaurierend	€ 338.233	€ 498.384	€ 518.804					
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.950	48.614	48.941					
NIW je Anteil	€ 10,26	€ 10,25	€ 10,60					
Erträge	€ 33.165	€ 34.131	€ 45.289					
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.810	3.856	4.630					
NIW je Anteil	€ 8,70	€ 8,85	€ 9,78					
Institutional GBP (Hedged):								
thesaurierend	£ 35.943	£ 55.816	£ 63.979					
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.274	5.128	5.771					
NIW je Anteil	£ 10,98	£ 10,88	£ 11,09					
Erträge	£ 64.163	£ 62.640	£ 57.902					
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.120	6.761	5.720					
NIW je Anteil	£ 9,01	£ 9,26	£ 10,12					
Institutional SGD (Hedged):								
thesaurierend	SGD 591.060	SGD 351.313	k. A.					
ausgegebene und umlaufende Anteile	58.358	34.943	k. A.					
NIW je Anteil	SGD 10,13	SGD 10,05	k. A.					
Investor:								
thesaurierend	\$ 6.543	\$ 6.751	\$ 5.146					
ausgegebene und umlaufende Anteile	567	591	443					
NIW je Anteil	\$ 11,55	\$ 11,42	\$ 11,61					
E Class:								
thesaurierend	\$ 28.640	\$ 34.924	\$ 26.574					
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.608	3.206	2.386					
NIW je Anteil	\$ 10,98	\$ 10,89	\$ 11,14					
E Class EUR (Hedged):								
thesaurierend	€ 146.816	€ 177.147	€ 153.469					
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.565	18.721	15.545					
NIW je Anteil	€ 9,43	€ 9,46	€ 9,87					
Nettovermögen	\$ 2.510.669	\$ 2.571.862	\$ 3.703.379					
				<b>Global Real Return Fund</b>				
Institutional:								
thesaurierend	\$ 294.010	\$ 272.591	\$ 380.827					
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.397	12.628	14.784					
NIW je Anteil	\$ 21,95	\$ 21,59	\$ 25,76					
Erträge	\$ 6.072	\$ 12.328	\$ 22.531					
ausgegebene und umlaufende Anteile	395	796	1.136					
NIW je Anteil	\$ 15,37	\$ 15,49	\$ 19,84					
Institutional (Currency Exposure):								
thesaurierend	\$ 47.610	\$ 47.075	\$ 68.405					
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.759	4.828	5.543					
NIW je Anteil	\$ 10,00	\$ 9,75	\$ 12,34					
Institutional CHF (Hedged):								
thesaurierend	CHF 61.873	CHF 56.131	CHF 63.005					
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.726	4.267	3.907					
NIW je Anteil	CHF 13,09	CHF 13,15	CHF 16,12					
Erträge	CHF 27.549	CHF 33.615	CHF 38.988					
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.293	3.898	3.438					
NIW je Anteil	CHF 8,37	CHF 8,62	CHF 11,34					
Institutional EUR (Hedged):								
thesaurierend	€ 768.249	€ 824.251	€ 1.075.404					
ausgegebene und umlaufende Anteile	42.301	45.572	48.681					
NIW je Anteil	€ 18,16	€ 18,09	€ 22,09					
Erträge	€ 86.097	€ 98.750	€ 140.728					
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.903	7.750	8.415					
NIW je Anteil	€ 12,47	€ 12,74	€ 16,72					
Institutional GBP (Hedged):								
thesaurierend	£ 37.444	£ 38.820	£ 45.209					
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.144	3.298	3.177					
NIW je Anteil	£ 11,91	£ 11,77	£ 14,23					
Erträge	£ 217.129	£ 205.454	£ 276.097					
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.864	25.531	26.297					
NIW je Anteil	£ 7,79	£ 8,05	£ 10,50					
Institutional SGD (Hedged):								
thesaurierend	SGD 237.375	SGD 236.796	SGD 307.106					
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.864	14.984	16.250					
NIW je Anteil	SGD 15,97	SGD 15,80	SGD 18,90					
Investor:								
thesaurierend	\$ 41.510	\$ 63.935	\$ 92.993					
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.027	3.170	3.850					
NIW je Anteil	\$ 20,47	\$ 20,17	\$ 24,16					
Erträge	\$ 12.164	\$ 9.038	\$ 31.044					
ausgegebene und umlaufende Anteile	909	669	1.795					
NIW je Anteil	\$ 13,39	\$ 13,51	\$ 17,30					
Investor CHF (Hedged):								
Erträge	CHF 2.223	CHF 2.516	CHF 5.139					
ausgegebene und umlaufende Anteile	211	232	360					
NIW je Anteil	CHF 10,54	CHF 10,85	CHF 14,28					
Investor EUR (Hedged):								
thesaurierend	€ 22.062	€ 22.838	€ 36.406					
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.299	1.347	1.752					
NIW je Anteil	€ 16,99	€ 16,95	€ 20,77					
Administrative:								
thesaurierend	\$ 38.210	\$ 43.396	\$ 71.230					
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.910	2.200	3.010					
NIW je Anteil	\$ 20,01	\$ 19,73	\$ 23,66					
E Class:								
thesaurierend	\$ 128.901	\$ 153.574	\$ 231.761					
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.876	8.292	10.391					
NIW je Anteil	\$ 18,75	\$ 18,52	\$ 22,30					
Erträge	\$ 31.116	\$ 38.490	\$ 53.098					
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.414	2.958	3.187					
NIW je Anteil	\$ 12,89	\$ 13,01	\$ 16,66					
E Class EUR (Hedged):								
thesaurierend	€ 232.045	€ 234.441	€ 321.175					
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.941	15.090	16.773					
NIW je Anteil	€ 15,53	€ 15,54	€ 19,15					
E Class GBP (Hedged):								
Erträge	k. A.	k. A.	£ 4.354					
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	282					
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 15,45					

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Global Real Return Fund (Fortsetzung)</b>			
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 89.516	\$ 90.138	\$ 150.924
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.211	4.307	6.032
NIW je Anteil	\$ 21,26	\$ 20,93	\$ 25,02
R Class:			
thesaurierend	\$ 1.472	\$ 1.569	\$ 7.292
ausgegebene und umlaufende Anteile	122	132	514
NIW je Anteil	\$ 12,03	\$ 11,85	\$ 14,18
R Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 7.299	£ 8.283	£ 12.683
ausgegebene und umlaufende Anteile	652	747	944
NIW je Anteil	£ 11,20	£ 11,09	£ 13,44
<b>Income Fund</b>			
Nettvermögen	\$ 64.527.567	\$ 57.980.327	\$ 73.579.726
Institutional:			
thesaurierend	\$ 10.183.487	\$ 9.197.801	\$ 10.989.198
ausgegebene und umlaufende Anteile	624.022	582.256	643.353
NIW je Anteil	\$ 16,32	\$ 15,80	\$ 17,08
Erträge	\$ 4.775.220	\$ 4.597.148	\$ 5.308.194
ausgegebene und umlaufende Anteile	451.613	435.389	442.049
NIW je Anteil	\$ 10,57	\$ 10,56	\$ 12,01
Institutional AUD (Hedged):			
thesaurierend	AUD 90.503	AUD 80.591	AUD 96.588
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.351	7.611	8.329
NIW je Anteil	AUD 10,84	AUD 10,59	AUD 11,60
Erträge	k. A.	k. A.	AUD 14
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	AUD 9,84
Institutional BRL (Hedged):			
thesaurierend	\$ 309.492	\$ 274.136	\$ 561.362
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.367	20.003	43.619
NIW je Anteil	\$ 15,98	\$ 13,70	\$ 12,87
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 78.028	CAD 83.552	CAD 98.436
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.190	6.821	7.406
NIW je Anteil	CAD 12,61	CAD 12,25	CAD 13,29
Erträge	CAD 124.176	CAD 117.940	CAD 138.770
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.674	12.956	13.346
NIW je Anteil	CAD 9,08	CAD 9,10	CAD 10,40
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 307.727	CHF 293.823	CHF 326.885
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.457	26.495	26.540
NIW je Anteil	CHF 11,21	CHF 11,09	CHF 12,32
Erträge	CHF 137.634	CHF 135.996	CHF 178.124
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.840	17.253	19.281
NIW je Anteil	CHF 7,71	CHF 7,88	CHF 9,24
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 5.193.931	€ 4.856.302	€ 6.397.698
ausgegebene und umlaufende Anteile	374.288	356.885	424.812
NIW je Anteil	€ 13,88	€ 13,61	€ 15,06

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Income Fund (Fortsetzung)</b>			
Erträge	€ 816.287	€ 858.841	€ 1.216.992
ausgegebene und umlaufende Anteile	92.957	96.621	117.285
NIW je Anteil	€ 8,78	€ 8,89	€ 10,38
ausschüttend II	€ 21.441	€ 13.739	€ 21.567
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.430	1.555	2.138
NIW je Anteil	€ 8,82	€ 8,84	€ 10,09
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 190.987	£ 179.687	£ 223.422
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.973	17.378	19.797
NIW je Anteil	£ 10,63	£ 10,34	£ 11,29
Erträge	£ 475.213	£ 437.940	£ 465.680
ausgegebene und umlaufende Anteile	52.738	48.401	44.776
NIW je Anteil	£ 9,01	£ 9,05	£ 10,40
Institutional HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 314.876	HKD 448.226	HKD 798.164
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.461	46.468	72.832
NIW je Anteil	HKD 9,70	HKD 9,65	HKD 10,96
Institutional JPY (Hedged):			
thesaurierend	¥ 1.096.657	k. A.	¥ 255.548
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.088	k. A.	229
NIW je Anteil	¥ 1.008,00	k. A.	¥ 1.118,00
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 2.307.266	NOK 2.153.310	NOK 2.187.743
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.880	19.915	18.488
NIW je Anteil	NOK 110,50	NOK 108,13	NOK 118,34
Institutional RMB (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	CNH 66
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CNH 101,42
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 65.749	SGD 57.007	SGD 46.472
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.306	5.614	4.222
NIW je Anteil	SGD 10,43	SGD 10,15	SGD 11,01
Erträge	SGD 279.576	SGD 233.054	SGD 277.493
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.562	24.522	25.607
NIW je Anteil	SGD 9,46	SGD 9,50	SGD 10,84
Investor:			
thesaurierend	\$ 1.886.447	\$ 1.938.128	\$ 2.841.494
ausgegebene und umlaufende Anteile	142.482	150.961	203.964
NIW je Anteil	\$ 13,24	\$ 12,84	\$ 13,93
Erträge	\$ 1.392.843	\$ 1.424.611	\$ 1.709.869
ausgegebene und umlaufende Anteile	149.643	152.992	160.791
NIW je Anteil	\$ 9,31	\$ 9,31	\$ 10,63
Investor AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 75.629	AUD 64.155	AUD 73.714
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.817	7.404	7.348
NIW je Anteil	AUD 8,58	AUD 8,66	AUD 10,03
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 225.120	€ 212.831	€ 508.040
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.470	19.702	42.352
NIW je Anteil	€ 11,00	€ 10,80	€ 12,00

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Income Fund (Fortsetzung)</b>			
Erträge	€ 84.129	€ 75.705	€ 105.743
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.007	9.766	11.634
NIW je Anteil	€ 7,64	€ 7,75	€ 9,09
ausschüttend A	€ 27.482	€ 29.277	€ 37.920
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.386	3.673	4.052
NIW je Anteil	€ 8,12	€ 7,97	€ 9,36
Investor GBP (Hedged):			
Erträge	£ 18.078	£ 16.799	£ 9.219
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.127	1.965	935
NIW je Anteil	£ 8,50	£ 8,55	£ 9,86
Investor JPY (Hedged):			
thesaurierend	¥ 1.352	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	¥ 1.004,00	k. A.	k. A.
Investor RMB (Hedged):			
thesaurierend	CNH 77.857	CNH 66.886	CNH 124.077
ausgegebene und umlaufende Anteile	663	579	994
NIW je Anteil	CNH 117,35	CNH 115,46	CNH 124,87
Investor SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 11.509	SGD 6.150	SGD 1.979
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.142	625	185
NIW je Anteil	SGD 10,08	SGD 9,84	SGD 10,70
Erträge	SGD 49.157	SGD 47.450	SGD 67.208
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.570	5.340	6.605
NIW je Anteil	SGD 8,83	SGD 8,89	SGD 10,18
Administrative:			
thesaurierend	\$ 840.852	\$ 744.526	\$ 912.059
ausgegebene und umlaufende Anteile	71.736	65.457	73.786
NIW je Anteil	\$ 11,72	\$ 11,37	\$ 12,36
Erträge	\$ 3.395.699	\$ 2.930.269	\$ 3.699.459
ausgegebene und umlaufende Anteile	341.794	294.606	325.103
NIW je Anteil	\$ 9,93	\$ 9,95	\$ 11,38
Administrative AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 341.078	AUD 286.887	AUD 316.049
ausgegebene und umlaufende Anteile	38.789	32.273	30.677
NIW je Anteil	AUD 8,79	AUD 8,89	AUD 10,30
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 82.726	€ 96.175	€ 193.792
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.577	8.961	16.228
NIW je Anteil	€ 10,92	€ 10,73	€ 11,94
Erträge	€ 287.515	€ 266.419	€ 308.049
ausgegebene und umlaufende Anteile	37.090	33.865	33.362
NIW je Anteil	€ 7,75	€ 7,87	€ 9,23
Administrative GBP (Hedged):			
Erträge	£ 133.826	£ 112.506	£ 140.149
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.298	13.611	14.660
NIW je Anteil	£ 8,21	£ 8,27	£ 9,56
Administrative HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 4.704.034	HKD 3.221.408	HKD 4.681.912
ausgegebene und umlaufende Anteile	530.871	364.591	463.488
NIW je Anteil	HKD 8,86	HKD 8,84	HKD 10,10

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Income Fund (Fortsetzung)</b>			
Administrative JPY (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	¥ 1.099
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	¥ 999,00
Administrative SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 1.392.280	SGD 971.804	SGD 1.080.475
ausgegebene und umlaufende Anteile	143.166	99.186	96.129
NIW je Anteil	SGD 9,72	SGD 9,80	SGD 11,24
E Class:			
thesaurierend	\$ 5.276.558	\$ 4.837.460	\$ 6.088.898
ausgegebene und umlaufende Anteile	355.373	335.073	386.539
NIW je Anteil	\$ 14,85	\$ 14,44	\$ 15,75
Erträge	\$ 8.009.068	\$ 6.857.888	\$ 8.765.914
ausgegebene und umlaufende Anteile	847.381	723.233	804.221
NIW je Anteil	\$ 9,45	\$ 9,48	\$ 10,90
Ausschüttend Q	k. A.	k. A.	\$ 2.029
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	203
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,01
E Class AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 718.044	AUD 595.621	AUD 699.187
ausgegebene und umlaufende Anteile	87.174	71.382	71.928
NIW je Anteil	AUD 8,24	AUD 8,34	AUD 9,72
E Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 77.758	CHF 80.590	CHF 101.113
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.257	7.568	8.472
NIW je Anteil	CHF 10,171	CHF 10,65	CHF 11,93
Erträge	CHF 103.829	CHF 80.502	CHF 117.164
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.800	11.178	13.731
NIW je Anteil	CHF 7,02	CHF 7,20	CHF 8,53
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 4.810.355	€ 4.356.288	€ 5.062.678
ausgegebene und umlaufende Anteile	381.347	350.614	364.865
NIW je Anteil	€ 12,61	€ 12,42	€ 13,88
Erträge	€ 3.520.179	€ 3.436.223	€ 4.359.865
ausgegebene und umlaufende Anteile	448.518	430.505	462.802
NIW je Anteil	€ 7,85	€ 7,98	€ 9,42
ausschüttend II	€ 138.423	€ 121.587	€ 125.779
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.696	13.705	12.308
NIW je Anteil	€ 8,82	€ 8,87	€ 10,22
Ausschüttend II Q	€ 35.750	€ 38.028	€ 52.706
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.110	4.345	5.208
NIW je Anteil	€ 8,70	€ 8,75	€ 10,12
E Class GBP (Hedged):			
Erträge	£ 245.413	£ 208.926	£ 236.936
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.032	26.188	25.560
NIW je Anteil	£ 7,91	£ 7,98	£ 9,27
E Class HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 4.185.899	HKD 3.442.414	HKD 4.704.540
ausgegebene und umlaufende Anteile	468.748	385.795	459.225
NIW je Anteil	HKD 8,93	HKD 8,92	HKD 10,24



	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Income Fund (Fortsetzung)</b>			
E Class JPY (Hedged): thesaurierend	¥ 8.506.391	¥ 4.076.871	¥ 743.601
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.857	4.248	692
NIW je Anteil	¥ 960,00	¥ 960,00	¥ 1.075,00
Erträge	¥ 1.633.190	¥ 1.381	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.697	1	k. A.
NIW je Anteil	¥ 962,00	¥ 992,00	k. A.
E Class RMB (Hedged): Erträge	CNH 699.958	CNH 490.076	CNH 671.398
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.542	4.497	5.397
NIW je Anteil	CNH 107,00	CNH 108,97	CNH 124,39
E Class SGD (Hedged): Erträge	SGD 3.648.260	SGD 2.537.340	SGD 2.784.269
ausgegebene und umlaufende Anteile	424.620	292.512	278.445
NIW je Anteil	SGD 8,59	SGD 8,67	SGD 10,00
G Retail EUR (Hedged): Erträge	€ 27.873	€ 18.496	€ 29.724
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.552	2.393	3.263
NIW je Anteil	€ 7,85	€ 7,73	€ 9,11
G Retail EUR (Unhedged): Erträge	k. A.	k. A.	€ 518
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	51
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 10,11
H Institutional: thesaurierend	\$ 722.457	\$ 669.952	\$ 770.236
ausgegebene und umlaufende Anteile	63.301	60.591	64.313
NIW je Anteil	\$ 11,41	\$ 11,06	\$ 11,98
Erträge	\$ 345.805	\$ 287.285	\$ 333.808
ausgegebene und umlaufende Anteile	37.875	31.482	32.084
NIW je Anteil	\$ 9,13	\$ 9,13	\$ 10,40
H Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 8.530
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	772
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 11,05
R Class: thesaurierend	\$ 89.368	\$ 82.073	\$ 70.929
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.499	8.054	6.420
NIW je Anteil	\$ 10,51	\$ 10,19	\$ 11,05
Erträge	\$ 58.929	\$ 61.635	\$ 84.900
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.400	6.695	8.082
NIW je Anteil	\$ 9,21	\$ 9,21	\$ 10,50
R Class EUR (Hedged): Erträge	€ 12.270	€ 12.865	€ 16.112
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.515	1.567	1.678
NIW je Anteil	€ 8,10	€ 8,21	€ 9,60
R Class GBP (Hedged): Erträge	£ 25.325	£ 20.954	£ 33.995
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.697	2.220	3.123
NIW je Anteil	£ 9,39	£ 9,44	£ 10,88

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Income Fund (Fortsetzung)</b>			
T Class: thesaurierend	\$ 296.211	\$ 295.923	\$ 371.744
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.351	24.971	28.634
NIW je Anteil	\$ 12,16	\$ 11,85	\$ 12,98
Erträge	\$ 109.271	\$ 102.600	\$ 130.671
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.148	12.279	13.542
NIW je Anteil	\$ 8,31	\$ 8,36	\$ 9,65
T Class EUR (Hedged): ausschüttend	€ 241.934	€ 226.266	€ 268.086
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.272	22.053	23.304
NIW je Anteil	€ 10,40	€ 10,26	€ 11,50
Erträge	€ 171.662	€ 165.117	€ 217.088
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.740	23.351	25.890
NIW je Anteil	€ 6,94	€ 7,07	€ 8,38
Z Class: thesaurierend	\$ 189.355	\$ 219.519	\$ 162.794
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.960	13.161	9.076
NIW je Anteil	\$ 17,28	\$ 16,68	\$ 17,94
Z Class AUD (Hedged): ausschüttend II	AUD 1.304.615	AUD 1.339.063	AUD 1.451.394
ausgegebene und umlaufende Anteile	133.612	136.394	129.096
NIW je Anteil	AUD 9,76	AUD 9,82	AUD 11,24
<b>Income Fund II</b>			
Nettovermögen	\$ 97.717	\$ 56.653	\$ 27.770
Institutional: thesaurierend	\$ 23.146	\$ 22.431	\$ 24.374
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.397	2.396	2.396
NIW je Anteil	\$ 9,66	\$ 9,36	\$ 10,17
Erträge	\$ 10	k. A.	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	1
NIW je Anteil	\$ 10,07	k. A.	\$ 9,94
E Class: Erträge	\$ 25.759	\$ 17.904	\$ 1.730
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.975	2.069	174
NIW je Anteil	\$ 8,66	\$ 8,65	\$ 9,92
E Class AUD (Hedged): Erträge	AUD 9.747	AUD 2.121	AUD 365
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.153	249	37
NIW je Anteil	AUD 8,46	AUD 8,53	AUD 9,90
E Class EUR (Hedged): Erträge	€ 4.874	€ 3.223	€ 494
ausgegebene und umlaufende Anteile	589	385	50
NIW je Anteil	€ 8,27	€ 8,38	€ 9,85
E Class GBP (Hedged): Erträge	£ 10.435	£ 2.811	£ 196
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.225	329	20
NIW je Anteil	£ 8,52	£ 8,55	£ 9,90
E Class HKD (Unhedged): Erträge	HKD 185.961	HKD 62.900	HKD 2.462
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.259	7.226	247
NIW je Anteil	HKD 8,75	HKD 8,70	HKD 9,98



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021		Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021		Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Income Fund II (Fortsetzung)</b>											
E Class SGD (Hedged):											
Erträge		k. A.	k. A.	SGD	333						
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	k. A.		34						
NIW je Anteil		k. A.	k. A.	SGD	9,93						
<b>Inflation Multi-Asset Fund</b>											
Nettovermögen	\$	324.178	\$	403.078	\$	164.345					
Institutional:											
thesaurierend	\$	83.897	\$	83.455	\$	68.012					
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.498		7.503		5.798					
NIW je Anteil	\$	11,19	\$	11,12	\$	11,73					
Institutional EUR (Partially Hedged):											
thesaurierend	€	58.229	€	82.243	€	4.749					
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.229		8.718		477					
NIW je Anteil	€	9,35	€	9,43	€	9,96					
Institutional GBP (Partially Hedged):											
thesaurierend	£	3.788	£	3.543	£	22.843					
ausgegebene und umlaufende Anteile		333		308		1.924					
NIW je Anteil	£	11,37	£	11,50	£	11,87					
Administrative:											
ausschüttend II	\$	2.460	\$	2.961		k. A.					
ausgegebene und umlaufende Anteile		287		338		k. A.					
NIW je Anteil	\$	8,58	\$	8,75		k. A.					
Administrative SGD (Hedged):											
ausschüttend II	SGD	6.518	SGD	10.723		k. A.					
ausgegebene und umlaufende Anteile		743		1.197		k. A.					
NIW je Anteil	SGD	8,77	SGD	8,95		k. A.					
E Class:											
thesaurierend	\$	65.566	\$	85.842	\$	14.809					
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.615		8.673		1.405					
NIW je Anteil	\$	9,91	\$	9,90	\$	10,54					
ausschüttend II	\$	9	\$	9		k. A.					
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.					
NIW je Anteil	\$	9,08	\$	9,27		k. A.					
E Class AUD (Partially Hedged):											
thesaurierend	AUD	333	AUD	334		k. A.					
ausgegebene und umlaufende Anteile		36		36		k. A.					
NIW je Anteil	AUD	9,34	AUD	9,35		k. A.					
E Class EUR (Partially Hedged):											
thesaurierend	€	81.118	€	110.990	€	33.996					
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.865		11.966		3.436					
NIW je Anteil	€	9,15	€	9,28	€	9,89					
Erträge	€	9.280	€	11.302	€	5.738					
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.108		1.312		608					
NIW je Anteil	€	8,38	€	8,61	€	9,43					
E Class GBP (Partially Hedged):											
thesaurierend	£	8	£	8		k. A.					
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.					
NIW je Anteil	£	9,26	£	9,41		k. A.					
E Class SGD (Partially Hedged):											
thesaurierend	SGD	13	SGD	13		k. A.					
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.					
NIW je Anteil	SGD	9,34	SGD	9,35		k. A.					
H Institutional:											
thesaurierend	\$	9	\$	9		k. A.					
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.					
NIW je Anteil	\$	9,50	\$	9,45		k. A.					
M Retail:											
ausschüttend II	\$	209	\$	9		k. A.					
ausgegebene und umlaufende Anteile		23		1		k. A.					
NIW je Anteil	\$	9,16	\$	9,32		k. A.					
<b>Low Average Duration Fund</b>											
Nettovermögen	\$	886.012	\$	1.072.758	\$	1.179.138					
Institutional:											
thesaurierend	\$	552.752	\$	640.710	\$	747.732					
ausgegebene und umlaufende Anteile		35.140		41.077		45.606					
NIW je Anteil	\$	15,73	\$	15,60	\$	16,40					
Erträge	\$	34.066	\$	53.185	\$	33.312					
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.471		5.377		3.159					
NIW je Anteil	\$	9,81	\$	9,89	\$	10,54					
Institutional EUR (Hedged):											
thesaurierend	€	23.466	€	37.536	€	35.456					
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.423		3.864		3.402					
NIW je Anteil	€	9,68	€	9,71	€	10,42					
Erträge	€	3.309	€	8.986	€	10.023					
ausgegebene und umlaufende Anteile		477		1.270		1.302					
NIW je Anteil	€	6,94	€	7,08	€	7,70					
Institutional GBP (Hedged):											
thesaurierend	£	18.782	£	17.044	£	13.877					
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.919		1.748		1.347					
NIW je Anteil	£	9,79	£	9,75	£	10,30					
Erträge	£	3.056	£	3.285	£	4.225					
ausgegebene und umlaufende Anteile		347		367		439					
NIW je Anteil	£	8,81	£	8,95	£	9,64					
Investor:											
thesaurierend	\$	14.605	\$	16.532	\$	20.960					
ausgegebene und umlaufende Anteile		992		1.131		1.359					
NIW je Anteil	\$	14,72	\$	14,62	\$	15,42					
Erträge	\$	1.858	\$	2.022	\$	7.973					
ausgegebene und umlaufende Anteile		191		206		762					
NIW je Anteil	\$	9,74	\$	9,81	\$	10,46					
Administrative:											
thesaurierend	\$	9.370	\$	10.755	\$	11.016					
ausgegebene und umlaufende Anteile		654		755		733					
NIW je Anteil	\$	14,32	\$	14,24	\$	15,04					
E Class:											
thesaurierend	\$	44.437	\$	47.980	\$	52.498					
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.670		3.979		4.104					
NIW je Anteil	\$	12,11	\$	12,06	\$	12,79					
Erträge	\$	3.957	\$	5.384	\$	6.751					
ausgegebene und umlaufende Anteile		391		528		621					
NIW je Anteil	\$	10,12	\$	10,20	\$	10,87					
E Class EUR (Hedged):											
thesaurierend	€	23.098	€	25.480	€	18.812					
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.959		3.238		2.209					
NIW je Anteil	€	7,81	€	7,87	€	8,52					
H Institutional:											
thesaurierend	\$	134.383	\$	186.190	\$	186.367					
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.384		15.891		15.108					
NIW je Anteil	\$	11,81	\$	11,72	\$	12,34					
Erträge	\$	1.427	\$	1.521	\$	7.574					
ausgegebene und umlaufende Anteile		151		159		745					
NIW je Anteil	\$	9,46	\$	9,54	\$	10,16					
R Class:											
thesaurierend	\$	6.982	\$	7.183	\$	7.325					
ausgegebene und umlaufende Anteile		663		687		665					
NIW je Anteil	\$	10,52	\$	10,45	\$	11,02					
<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>											
Nettovermögen	\$	798.217	\$	654.749	\$	806.869					
Institutional:											
thesaurierend	\$	237.291	\$	120.881	\$	94.445					
ausgegebene und umlaufende Anteile		20.324		10.562		7.805					
NIW je Anteil	\$	11,68	\$	11,44	\$	12,10					

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)</b>			
Erträge	\$ 16.574	\$ 17.001	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.795	1.859	1
NIW je Anteil	\$ 9,23	\$ 9,15	\$ 9,82
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 422.000	€ 417.993	€ 520.319
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.989	41.937	48.370
NIW je Anteil	€ 10,05	€ 9,97	€ 10,76
Erträge	€ 120	€ 133	€ 928
ausgegebene und umlaufende Anteile	14	15	95
NIW je Anteil	€ 8,88	€ 8,90	€ 9,75
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 19.517	£ 18.388	£ 18.462
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.784	1.708	1.611
NIW je Anteil	£ 10,94	£ 10,77	£ 11,46
Erträge	£ 3.857	£ 3.910	£ 18.096
ausgegebene und umlaufende Anteile	426	432	1.849
NIW je Anteil	£ 9,06	£ 9,06	£ 9,79
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend	NOK 166.958	NOK 159.169	NOK 441.039
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.642	1.581	4.119
NIW je Anteil	NOK 101,70	NOK 100,63	NOK 107,06
E Class EUR (Hedged): thesaurierend	€ 35.305	€ 25.901	€ 17.694
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.824	2.816	1.767
NIW je Anteil	€ 9,23	€ 9,20	€ 10,01
<b>Low Duration Income Fund</b>			
Nettvermögen	\$ 1.455.385	\$ 1.084.380	\$ 1.367.475
Institutional: thesaurierend	\$ 176.283	\$ 186.357	\$ 275.963
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.608	17.111	24.381
NIW je Anteil	\$ 11,29	\$ 10,89	\$ 11,32
Erträge	\$ 5.902	\$ 11.734	\$ 13.398
ausgegebene und umlaufende Anteile	610	1.229	1.305
NIW je Anteil	\$ 9,67	\$ 9,56	\$ 10,27
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	CHF 1.854
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	178
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CHF 10,43
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 641.714	€ 633.070	€ 666.067
ausgegebene und umlaufende Anteile	63.064	63.769	63.153
NIW je Anteil	€ 10,18	€ 9,93	€ 10,55
Erträge	€ 8	€ 8	€ 60.301
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	6.036
NIW je Anteil	€ 9,14	€ 9,14	€ 9,99
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 207.672	£ 3.280	£ 5.158
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.400	316	475
NIW je Anteil	£ 10,70	£ 10,37	£ 10,85

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Low Duration Income Fund (Fortsetzung)</b>			
Erträge	£ 106.712	£ 50.073	£ 130.935
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.717	5.539	13.372
NIW je Anteil	£ 9,11	£ 9,04	£ 9,79
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend	SGD 16.488	SGD 15.840	SGD 19.822
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.580	1.566	1.883
NIW je Anteil	SGD 10,43	SGD 10,12	SGD 10,53
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 639
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	61
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 10,41
Erträge	k. A.	k. A.	€ 452
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	48
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,46
E Class: thesaurierend	\$ 45.350	\$ 27.537	\$ 16.491
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.194	2.629	1.502
NIW je Anteil	\$ 10,81	\$ 10,47	\$ 10,98
Erträge	\$ 7.746	\$ 8.193	\$ 9.075
ausgegebene und umlaufende Anteile	831	885	904
NIW je Anteil	\$ 9,32	\$ 9,25	\$ 10,04
E Class EUR (Hedged): thesaurierend	€ 58.816	€ 31.442	€ 16.611
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.044	3.297	1.625
NIW je Anteil	€ 9,73	€ 9,54	€ 10,22
Erträge	€ 6.071	€ 2.708	€ 1.014
ausgegebene und umlaufende Anteile	725	322	109
NIW je Anteil	€ 8,38	€ 8,42	€ 9,34
E Class SGD (Hedged): Erträge	k. A.	k. A.	SGD 721
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	73
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SGD 9,90
H Institutional: thesaurierend	\$ 36.753	\$ 62.043	\$ 3.622
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.509	6.136	344
NIW je Anteil	\$ 10,47	\$ 10,11	\$ 10,53
Erträge	\$ 556	\$ 418	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	59	45	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,45	\$ 9,34	k. A.
Z Class EUR (Hedged): thesaurierend	€ 10	€ 9	€ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	€ 10,49	€ 10,21	€ 10,79
<b>Low Duration Opportunities Fund</b>			
Nettvermögen	\$ 1.121.377	\$ 1.345.781	\$ 3.217.260
Institutional: thesaurierend	\$ 138.843	\$ 61.036	\$ 142.348
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.382	5.569	12.027
NIW je Anteil	\$ 11,21	\$ 10,96	\$ 11,84

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Low Duration Opportunities Fund (Fortsetzung)</b>			
Erträge	\$ 25.000	\$ 33.224	\$ 41.508
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.637	3.555	4.051
NIW je Anteil	\$ 9,48	\$ 9,35	\$ 10,25
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 16.304	€ 23.753	€ 41.652
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.682	2.478	3.940
NIW je Anteil	€ 9,69	€ 9,58	€ 10,57
Erträge	€ 5.089	€ 10.599	€ 12.374
ausgegebene und umlaufende Anteile	596	1.244	1.297
NIW je Anteil	€ 8,54	€ 8,52	€ 9,54
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 497.866	£ 713.035	£ 1.734.093
ausgegebene und umlaufende Anteile	47.643	69.498	155.485
NIW je Anteil	£ 10,45	£ 10,26	£ 11,15
Erträge	£ 229.777	£ 288.970	£ 447.455
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.362	31.985	44.752
NIW je Anteil	£ 9,06	£ 9,03	£ 10,00
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 4.060	€ 4.406	€ 8.109
ausgegebene und umlaufende Anteile	442	485	806
NIW je Anteil	€ 9,18	€ 9,09	€ 10,06
E Class EUR (Hedged): thesaurierend	€ 2.843	€ 3.102	€ 4.360
ausgegebene und umlaufende Anteile	319	350	443
NIW je Anteil	€ 8,93	€ 8,86	€ 9,84
Z Class: thesaurierend	\$ 1.573	\$ 1.534	\$ 2.989
ausgegebene und umlaufende Anteile	166	166	301
NIW je Anteil	\$ 9,48	\$ 9,24	\$ 9,93
<b>Low Duration Opportunities ESG Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 5.017	\$ 4.928	\$
Institutional: thesaurierend	\$ 4.491	\$ 4.426	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	447	446	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,05	\$ 9,90	k. A.
Erträge	\$ 10	10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,79	\$ 9,81	k. A.
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 226	€ 225	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	23	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,81	€ 9,78	k. A.
Erträge	€ 9	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,56	€ 9,69	k. A.
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 197	£ 194	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	20	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,95	£ 9,85	k. A.
Erträge	£ 8	£ 8	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,66	£ 9,75	k. A.
<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 97.091	\$ 120.137	\$ 100.538
Institutional: thesaurierend	\$ 13.729	\$ 21.492	\$ 21.487
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.297	2.114	2.658
NIW je Anteil	\$ 10,59	\$ 10,17	\$ 8,08

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund (Fortsetzung)</b>			
Erträge	\$ 8.590	\$ 10.469	\$ 29.680
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.348	1.678	5.697
NIW je Anteil	\$ 6,37	\$ 6,24	\$ 5,21
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 36.472	€ 41.892	€ 19.141
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.102	4.844	2.714
NIW je Anteil	€ 8,89	€ 8,65	€ 7,05
Erträge	€ 1.720	€ 3.309	€ 2.062
ausgegebene und umlaufende Anteile	323	625	455
NIW je Anteil	€ 5,33	€ 5,29	€ 4,54
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 1.460	£ 1.415	£ 1.362
ausgegebene und umlaufende Anteile	161	162	193
NIW je Anteil	£ 9,08	£ 8,76	£ 7,07
Erträge	k. A.	k. A.	£ 25
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	5
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 4,51
Investor: thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 1.183
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	117
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,09
E Class: Erträge	\$ 21.107	\$ 23.893	\$ 10.905
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.670	4.223	2.287
NIW je Anteil	\$ 5,75	\$ 5,66	\$ 4,77
Z Class: thesaurierend	\$ 10.141	\$ 14.340	\$ 11.293
ausgegebene und umlaufende Anteile	752	1.113	1.113
NIW je Anteil	\$ 13,48	\$ 12,88	\$ 10,14
<b>Mortgage Opportunities Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 620.336	\$ 849.148	\$ 2.238.424
Institutional: thesaurierend	\$ 314.026	\$ 409.011	\$ 558.563
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.587	38.104	47.581
NIW je Anteil	\$ 10,98	\$ 10,73	\$ 11,74
Erträge	\$ 31.854	\$ 94.373	\$ 351.769
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.619	10.759	35.231
NIW je Anteil	\$ 8,80	\$ 8,77	\$ 9,98
Institutional CAD (Hedged): thesaurierend	CAD 23.924	CAD 23.438	CAD 25.659
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.532	2.532	2.532
NIW je Anteil	CAD 9,45	CAD 9,26	CAD 10,14
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 2.590	CHF 3.010	CHF 5.577
ausgegebene und umlaufende Anteile	277	322	532
NIW je Anteil	CHF 9,36	CHF 9,34	CHF 10,47
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 119.415	€ 192.977	€ 317.357
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.364	20.209	29.769
NIW je Anteil	€ 9,66	€ 9,55	€ 10,66
Erträge	€ 11.593	€ 14.970	€ 26.722
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.500	1.923	2.953
NIW je Anteil	€ 7,73	€ 7,78	€ 9,05
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 6.109	£ 7.355	£ 19.288
ausgegebene und umlaufende Anteile	592	727	1.733
NIW je Anteil	£ 10,31	£ 10,12	£ 11,13
Erträge	£ 4.675	£ 6.104	£ 5.764
ausgegebene und umlaufende Anteile	567	740	609
NIW je Anteil	£ 8,24	£ 8,25	£ 9,46

	Mortgage Opportunities Fund (Fortsetzung)			StocksPLUS™ Fund (Fortsetzung)		
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Investor:						
thesaurierend	\$ 21.447	\$ 20.219	\$ 32.611	\$ 28.551	\$ 24.829	\$ 39.901
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.038	1.963	2.885	735	734	913
NIW je Anteil	\$ 10,52	\$ 10,30	\$ 11,30	\$ 38,84	\$ 33,81	\$ 43,69
Erträge	\$ 4.731	\$ 4.762	\$ 19.104			
ausgegebene und umlaufende Anteile	538	543	1.914			
NIW je Anteil	\$ 8,80	\$ 8,77	\$ 9,98			
Administrative:						
Erträge	\$ 3.190	\$ 44	\$ 540			
ausgegebene und umlaufende Anteile	362	5	54			
NIW je Anteil	\$ 8,80	\$ 8,77	\$ 9,98			
E Class:						
thesaurierend	\$ 46.140	\$ 43.823	\$ 58.797			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.447	4.304	5.232			
NIW je Anteil	\$ 10,38	\$ 10,18	\$ 11,24			
Erträge	\$ 6.086	\$ 4.351	\$ 10.154			
ausgegebene und umlaufende Anteile	692	496	1.017			
NIW je Anteil	\$ 8,79	\$ 8,77	\$ 9,99			
E Class CHF (Hedged):						
Erträge	CHF 228	CHF 166	CHF 319			
ausgegebene und umlaufende Anteile	31	22	36			
NIW je Anteil	CHF 7,43	CHF 7,55	CHF 8,82			
E Class EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 13.696	€ 12.803	€ 16.220			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.503	1.415	1.591			
NIW je Anteil	€ 9,11	€ 9,05	€ 10,20			
Erträge	k. A.	k. A.	€ 151			
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	17			
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 8,98			
E Class SGD (Hedged):						
Erträge	k. A.	k. A.	SGD 1.645			
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	168			
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SGD 9,78			
H Institutional:						
thesaurierend	\$ 40	\$ 39	\$ 71			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	4	7			
NIW je Anteil	\$ 10,11	\$ 9,88	\$ 10,83			
Z Class:						
thesaurierend	\$ 10	\$ 10	\$ 214.716			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	19.628			
NIW je Anteil	\$ 10,04	\$ 9,78	\$ 10,94			
Z Class GBP (Hedged):						
thesaurierend	k. A.	k. A.	£ 384.109			
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	34.658			
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 11,08			
Nettovermögen	\$ 1.803.959	\$ 1.008.739	\$ 3.761.156			
Institutional:						
thesaurierend	\$ 1.141.405	\$ 581.668	\$ 2.349.757			
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.867	12.422	39.164			
NIW je Anteil	\$ 54,70	\$ 46,83	\$ 60,00			
Erträge						
ausgegebene und umlaufende Anteile	735	734	913			
NIW je Anteil	\$ 38,84	\$ 33,81	\$ 43,69			
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 106.679	€ 131.649	€ 570.050			
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.479	4.953	16.237			
NIW je Anteil	€ 30,66	€ 26,58	€ 35,11			
Erträge	k. A.	k. A.	€ 2.081			
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	68			
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 30,66			
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 278	£ 3.922	£ 199			
ausgegebene und umlaufende Anteile	28	456	18			
NIW je Anteil	£ 9,98	£ 8,60	£ 11,28			
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD 437	SGD 335	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	43	38	k. A.			
NIW je Anteil	SGD 10,18	SGD 8,76	k. A.			
Investor:						
thesaurierend	\$ 29.245	\$ 19.778	\$ 21.609			
ausgegebene und umlaufende Anteile	581	458	389			
NIW je Anteil	\$ 50,34	\$ 43,17	\$ 55,51			
BE Retail:						
thesaurierend	\$ 4.897	\$ 9	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	489	1	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 10,01	\$ 8,66	k. A.			
E Class:						
thesaurierend	\$ 188.944	\$ 165.517	\$ 175.651			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.012	4.087	3.355			
NIW je Anteil	\$ 47,09	\$ 40,50	\$ 52,35			
E Class EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 73.824	€ 35.366	€ 13.927			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.784	2.632	777			
NIW je Anteil	€ 15,43	€ 13,44	€ 17,91			
H Institutional:						
thesaurierend	\$ 213.312	\$ 33.724	\$ 504.831			
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.626	2.884	33.635			
NIW je Anteil	\$ 13,65	\$ 11,69	\$ 15,01			
T Class:						
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 2.673			
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	124			
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 21,50			
Nettovermögen	\$ 11.547	\$ 9.528	\$ 11.610			
Institutional:						
thesaurierend	\$ 10.552	\$ 9.327	\$ 10.848			
ausgegebene und umlaufende Anteile	640	663	603			
NIW je Anteil	\$ 16,49	\$ 14,07	\$ 17,97			
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 405			
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	24			
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 17,09			
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 783	£ 167	£ 198			
ausgegebene und umlaufende Anteile	78	19	18			
NIW je Anteil	£ 10,02	£ 8,59	£ 11,24			
E Class:						
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 34			
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	2			
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 17,53			

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Strategic Income Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 461.936	\$ 506.557	\$ 619.928
Institutional:			
thesaurierend	\$ 20.699	\$ 21.761	\$ 33.080
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.783	1.939	2.754
NIW je Anteil	\$ 11,61	\$ 11,22	\$ 12,01
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 150.032	€ 168.023	€ 207.426
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.466	13.134	14.906
NIW je Anteil	€ 13,08	€ 12,79	€ 13,92
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	£ 207	£ 201	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	21	21	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,69	£ 9,67	k. A.
E Class:			
thesaurierend	\$ 34.553	\$ 37.001	\$ 35.991
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.526	2.786	2.509
NIW je Anteil	\$ 13,68	\$ 13,28	\$ 14,34
ausschüttend II	\$ 16.928	\$ 18.150	\$ 18.959
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.850	1.989	1.828
NIW je Anteil	\$ 9,15	\$ 9,13	\$ 10,37
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 115.914	€ 133.817	€ 140.034
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.670	11.367	10.837
NIW je Anteil	€ 11,99	€ 11,77	€ 12,92
ausschüttend II	€ 70.389	€ 76.984	€ 94.373
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.787	9.528	10.105
NIW je Anteil	€ 8,01	€ 8,08	€ 9,34
T Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 14.079	€ 15.503	€ 17.708
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.319	1.475	1.529
NIW je Anteil	€ 10,68	€ 10,51	€ 11,58
Erträge	€ 6.591	€ 8.019	€ 8.185
ausgegebene und umlaufende Anteile	747	908	817
NIW je Anteil	€ 8,83	€ 8,83	€ 10,02
<b>Total Return Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 4.326.369	\$ 4.150.717	\$ 4.944.898
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.531.261	\$ 1.419.973	\$ 1.598.195
ausgegebene und umlaufende Anteile	51.909	49.161	46.882
NIW je Anteil	\$ 29,50	\$ 28,88	\$ 34,09
Erträge	\$ 117.500	\$ 112.085	\$ 174.533
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.962	7.634	9.829
NIW je Anteil	\$ 14,76	\$ 14,68	\$ 17,76
Institutional CAD (Hedged):			
Erträge	CAD 9.498	CAD 13.555	CAD 26.323
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.110	1.587	2.540
NIW je Anteil	CAD 8,56	CAD 8,54	CAD 10,36
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 3.894	CHF 3.138	CHF 13.206
ausgegebene und umlaufende Anteile	398	320	1.111
NIW je Anteil	CHF 9,79	CHF 9,79	CHF 11,88

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>Total Return Bond Fund (Fortsetzung)</b>			
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 409.399	€ 388.231	€ 358.693
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.980	20.056	15.344
NIW je Anteil	€ 19,51	€ 19,36	€ 23,38
Erträge	€ 208.583	€ 212.408	€ 260.110
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.935	18.120	17.931
NIW je Anteil	€ 11,63	€ 11,72	€ 14,51
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 8.546	€ 19.929	€ 14.618
ausgegebene und umlaufende Anteile	316	736	488
NIW je Anteil	€ 27,04	€ 27,06	€ 29,97
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 5.834	£ 3.621	£ 5.534
ausgegebene und umlaufende Anteile	469	296	379
NIW je Anteil	£ 12,44	£ 12,24	£ 14,59
Erträge	£ 20.149	£ 29.067	£ 43.763
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.455	3.543	4.355
NIW je Anteil	£ 8,21	£ 8,20	£ 10,05
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	ILS 185
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	13
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	ILS 14,41
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 7.447	SGD 7.941	SGD 21.940
ausgegebene und umlaufende Anteile	603	652	1.524
NIW je Anteil	SGD 12,35	SGD 12,17	SGD 14,40
Investor:			
thesaurierend	\$ 374.957	\$ 409.533	\$ 369.122
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.866	15.440	11.750
NIW je Anteil	\$ 27,04	\$ 26,52	\$ 31,41
Erträge	\$ 67.805	\$ 67.693	\$ 35.775
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.530	4.545	1.987
NIW je Anteil	\$ 14,97	\$ 14,89	\$ 18,01
Investor CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 2.805	CHF 2.893	CHF 4.784
ausgegebene und umlaufende Anteile	299	307	417
NIW je Anteil	CHF 9,39	CHF 9,41	CHF 11,46
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 17.802	€ 18.868	€ 19.262
ausgegebene und umlaufende Anteile	973	1.038	874
NIW je Anteil	€ 18,30	€ 18,18	€ 22,03
Administrative:			
thesaurierend	\$ 134.057	\$ 130.283	\$ 159.690
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.025	4.975	5.141
NIW je Anteil	\$ 26,68	\$ 26,19	\$ 31,06
Erträge	\$ 50.367	\$ 4.583	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.268	482	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,56	\$ 9,51	k. A.
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 3.007	€ 2.966	€ 1.953
ausgegebene und umlaufende Anteile	276	273	148
NIW je Anteil	€ 10,91	€ 10,84	€ 13,16
Administrative SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 14	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,93	k. A.	k. A.
E Class:			
thesaurierend	\$ 422.590	\$ 380.803	\$ 478.210
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.734	15.332	16.167
NIW je Anteil	\$ 25,25	\$ 24,84	\$ 29,58
Erträge	\$ 149.005	\$ 151.164	\$ 199.962
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.266	13.526	14.801
NIW je Anteil	\$ 11,23	\$ 11,18	\$ 13,51

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022
<b>Total Return Bond Fund (Fortsetzung)</b>						
E Class CHF (Hedged):	CHF	11.034	CHF	9.731	CHF	5.648
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		1.329		1.166		553
Anteile						
NIW je Anteil	CHF	8,30	CHF	8,34	CHF	10,22
E Class EUR (Hedged):	€	452.255	€	471.035	€	623.265
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		27.052		28.276		30.705
Anteile						
NIW je Anteil	€	16,72	€	16,66	€	20,30
Erträge	€	37.051	€	40.476	€	54.687
ausgegebene und umlaufende		4.777		5.177		5.655
Anteile						
NIW je Anteil	€	7,76	€	7,82	€	9,67
E Class EUR (Unhedged):	€	191	€	489	€	710
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		20		51		67
Anteile						
NIW je Anteil	€	9,48	€	9,53	€	10,65
E Class HKD (Unhedged):		k. A.	HKD	1.568	HKD	3.128
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		k. A.		155		259
Anteile						
NIW je Anteil		k. A.	HKD	10,15	HKD	12,07
E Class SGD (Hedged):	SGD	29.383	SGD	30.035	SGD	38.699
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		802		828		894
Anteile						
NIW je Anteil	SGD	36,64	SGD	36,28	SGD	43,30
H Institutional:	\$	117.434	\$	115.199	\$	199.555
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		4.112		4.116		6.033
Anteile						
NIW je Anteil	\$	28,56	\$	27,98	\$	33,08
Erträge	\$	9.231	\$	8.589	\$	17.255
ausgegebene und umlaufende		1.020		954		1.585
Anteile						
NIW je Anteil	\$	9,05	\$	9,00	\$	10,89
M Retail HKD (Unhedged):	HKD	82.672	HKD	76.242	HKD	91.252
Erträge						
ausgegebene und umlaufende		9.270		8.622		8.552
Anteile						
NIW je Anteil	HKD	8,92	HKD	8,84	HKD	10,67
R Class EUR (Hedged):	€	2.553	€	2.836	€	5.974
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		275		308		535
Anteile						
NIW je Anteil	€	9,28	€	9,22	€	11,16
T Class:	\$	6.107	\$	6.382	\$	13.697
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		615		652		1.172
Anteile						
NIW je Anteil	\$	9,93	\$	9,79	\$	11,69
T Class EUR (Hedged):	€	4.745	€	4.426	€	4.561
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		555		518		437
Anteile						
NIW je Anteil	€	8,56	€	8,54	€	10,44
<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b>						
Nettovermögen	\$	302.364	\$	435.924	\$	101.789
Institutional:						
thesaurierend	\$	98.805	\$	183.555	\$	70.982
ausgegebene und umlaufende		7.881		14.361		6.152
Anteile						
NIW je Anteil	\$	12,54	\$	12,78	\$	11,54
Institutional EUR (Hedged):	€	32.375	€	121.520	€	11.436
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		2.955		10.765		1.108
Anteile						
NIW je Anteil	€	10,96	€	11,29	€	10,32
Institutional GBP (Hedged):	£	301	£	9	£	k. A.
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		31		1		k. A.
Anteile						
NIW je Anteil	£	9,66	£	9,88	£	k. A.
<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Fortsetzung)</b>						
Erträge	£	66.524	£	31.132	£	k. A.
ausgegebene und umlaufende		7.397		3.333		k. A.
Anteile						
NIW je Anteil	£	8,99	£	9,34	£	k. A.
Investor:	\$	4.667	\$	9	\$	k. A.
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		506		1		k. A.
Anteile						
NIW je Anteil	\$	9,23	\$	9,43	\$	k. A.
Investor EUR (Hedged):	€	9	€	9	€	k. A.
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		1		1		k. A.
Anteile						
NIW je Anteil	€	9,10	€	9,39	€	k. A.
E Class:	\$	9.234	\$	11.079	\$	2.886
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		804		941		269
Anteile						
NIW je Anteil	\$	11,49	\$	11,78	\$	10,74
E Class EUR (Hedged):	€	15.563	€	17.465	€	1.747
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		1.551		1.680		182
Anteile						
NIW je Anteil	€	10,04	€	10,40	€	9,61
H Institutional:	\$	549	\$	43	\$	k. A.
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		55		4		k. A.
Anteile						
NIW je Anteil	\$	9,93	\$	10,13	\$	k. A.
Z Class:	\$	51.840	\$	55.435	\$	12.929
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		4.695		4.958		1.299
Anteile						
NIW je Anteil	\$	11,04	\$	11,18	\$	9,95
<b>UK Corporate Bond Fund</b>						
Nettovermögen	£	334.835	£	389.173	£	592.164
Institutional:						
thesaurierend	£	41.367	£	46.355	£	75.231
ausgegebene und umlaufende		2.293		2.532		3.348
Anteile						
NIW je Anteil	£	18,04	£	18,31	£	22,47
Erträge	£	228.419	£	276.939	£	436.466
ausgegebene und umlaufende		28.029		32.956		41.393
Anteile						
NIW je Anteil	£	8,15	£	8,40	£	10,54
Z Class:	£	65.049	£	65.879	£	80.467
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende		7.715		7.715		7.715
Anteile						
NIW je Anteil	£	8,43	£	8,54	£	10,43
<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>						
Nettovermögen	£	297.912	£	325.020	£	425.748
Institutional:						
thesaurierend	£	260.414	£	283.958	£	366.869
ausgegebene und umlaufende		13.674		14.455		13.155
Anteile						
NIW je Anteil	£	19,04	£	19,65	£	27,89
Erträge	£	37.498	£	41.062	£	58.879
ausgegebene und umlaufende		3.516		3.656		3.578
Anteile						
NIW je Anteil	£	10,67	£	11,23	£	16,45
<b>US High Yield Bond Fund</b>						
Nettovermögen	\$	1.977.601	\$	1.984.922	\$	3.923.786
Institutional:						
thesaurierend	\$	759.077	\$	780.024	\$	1.665.090
ausgegebene und umlaufende		20.125		21.785		40.803
Anteile						
NIW je Anteil	\$	37,72	\$	35,80	\$	40,81
Erträge	\$	210.079	\$	233.780	\$	400.716
ausgegebene und umlaufende		24.484		27.877		39.668
Anteile						
NIW je Anteil	\$	8,58	\$	8,39	\$	10,10



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2021	31. Dez. 2021
<b>US High Yield Bond Fund (Fortsetzung)</b>						
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend		k. A.	k. A.	CHF	2,738	
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	k. A.		222	
NIW je Anteil		k. A.	k. A.	CHF	12,33	
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	232.152	€	240.268	€	482.095
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.184		8.811		15.170
NIW je Anteil	€	28,37	€	27,27	€	31,78
Erträge	€	35.376	€	33.678	€	138.522
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.658		3.520		11.751
NIW je Anteil	€	9,67	€	9,57	€	11,79
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	45.055	£	40.143	£	48.533
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.048		1.913		2.009
NIW je Anteil	£	22,00	£	20,99	£	24,16
Erträge	£	2.131	£	1.108	£	5.115
ausgegebene und umlaufende Anteile		260		138		522
NIW je Anteil	£	8,18	£	8,04	£	9,80
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend		k. A.	k. A.	SGD	374	
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	k. A.		37	
NIW je Anteil		k. A.	k. A.	SGD	10,10	
Investor:						
thesaurierend	\$	239.743	\$	236.934	\$	434.782
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.133		7.413		11.894
NIW je Anteil	\$	33,61	\$	31,96	\$	36,56
Erträge	\$	20.137	\$	20.862	\$	37.431
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.899		3.073		4.581
NIW je Anteil	\$	6,95	\$	6,79	\$	8,17
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	3.102	€	2.708	€	3.173
ausgegebene und umlaufende Anteile		121		110		110
NIW je Anteil	€	25,54	€	24,59	€	28,78
E Class:						
thesaurierend	\$	128.310	\$	132.559	\$	225.933
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.970		4.302		6.375
NIW je Anteil	\$	32,32	\$	30,82	\$	35,44
Erträge	\$	68.092	\$	58.679	\$	124.742
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.436		6.557		11.581
NIW je Anteil	\$	9,16	\$	8,95	\$	10,77
E Class EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	54.724	€	56.406	€	77.393
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.254		2.407		2.808
NIW je Anteil	€	24,27	€	23,44	€	27,56
H Institutional:						
thesaurierend	\$	108.402	\$	88.253	\$	139.658
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.974		2.548		3.532
NIW je Anteil	\$	36,45	\$	34,63	\$	39,54
Erträge	\$	3.410	\$	2.482	\$	3.370
ausgegebene und umlaufende Anteile		402		299		337
NIW je Anteil	\$	8,49	\$	8,29	\$	9,99
M Retail:						
Erträge	\$	12.208	\$	12.265	\$	4.154
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.315		1.351		381
NIW je Anteil	\$	9,28	\$	9,08	\$	10,91
R Class:						
thesaurierend	\$	4.183	\$	5.477	\$	4.914
ausgegebene und umlaufende Anteile		281		387		304
NIW je Anteil	\$	14,90	\$	14,17	\$	16,18

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2023	31. Dez. 2022	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2021	31. Dez. 2021
<b>US High Yield Bond Fund (Fortsetzung)</b>						
Z Class:						
thesaurierend	\$	9.008	\$	8.528	\$	9.666
ausgegebene und umlaufende Anteile		661		661		661
NIW je Anteil	\$	13,63	\$	12,91	\$	14,63
<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>						
Nettovermögen	\$	444.793	\$	388.522	\$	878.100
Institutional:						
thesaurierend	\$	190.969	\$	151.061	\$	132.646
ausgegebene und umlaufende Anteile		17.423		14.307		10.461
NIW je Anteil	\$	10,96	\$	10,56	\$	12,68
Erträge	\$	68.975	\$	61.577	\$	63.781
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.918		7.201		5.999
NIW je Anteil	\$	8,71	\$	8,55	\$	10,63
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	101.292	€	124.155	€	214.560
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.706		13.447		18.908
NIW je Anteil	€	9,46	€	9,23	€	11,35
Institutional GBP (Hedged):						
ausschüttend II	£	22.892	£	13.692	£	304.200
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.968		1.794		31.489
NIW je Anteil	£	7,71	£	7,63	£	9,66
E Class:						
thesaurierend	\$	37.293	\$	21.852	\$	17.627
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.134		2.504		1.667
NIW je Anteil	\$	9,02	\$	8,73	\$	10,58
Erträge	\$	6.769	\$	5.002	\$	8.025
ausgegebene und umlaufende Anteile		765		576		743
NIW je Anteil	\$	8,85	\$	8,68	\$	10,80
H Institutional:						
thesaurierend	\$	1.173	\$	55	\$	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		116		6		k. A.
NIW je Anteil	\$	10,09	\$	9,73	\$	k. A.
<b>US Short-Term Fund</b>						
Nettovermögen	\$	2.066.904	\$	2.310.115	\$	2.650.198
Institutional:						
thesaurierend	\$	720.990	\$	865.421	\$	835.096
ausgegebene und umlaufende Anteile		61.864		76.197		73.558
NIW je Anteil	\$	11,65	\$	11,36	\$	11,35
Erträge	\$	121.354	\$	131.027	\$	102.552
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.150		13.207		10.172
NIW je Anteil	\$	9,99	\$	9,92	\$	10,08
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	101.825	€	202.833	€	233.199
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.126		20.470		23.092
NIW je Anteil	€	10,06	€	9,91	€	10,10
Institutional GBP (Hedged):						
Erträge	£	201	£	k. A.	£	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		20		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	£	10,05	£	k. A.	£	k. A.
Investor:						
thesaurierend	\$	10.504	\$	12.829	\$	18.474
ausgegebene und umlaufende Anteile		930		1.164		1.671
NIW je Anteil	\$	11,29	\$	11,02	\$	11,06
E Class:						
thesaurierend	\$	434.206	\$	412.347	\$	467.026
ausgegebene und umlaufende Anteile		38.580		37.521		42.334
NIW je Anteil	\$	11,25	\$	10,99	\$	11,03
E Class EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	35.124	€	44.471	€	9.227
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.631		4.656		944
NIW je Anteil	€	9,67	€	9,55	€	9,77



	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
<b>US Short-Term Fund (Fortsetzung)</b>			
H Institutional: thesaurierend	\$ 17.510	\$ 22.367	\$ 33.914
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.639	2.147	3.250
NIW je Anteil	\$ 10,68	\$ 10,42	\$ 10,44
Z Class:			
Erträge	\$ 612.674	\$ 602.189	\$ 917.450
ausgegebene und umlaufende Anteile	61.012	60.375	90.541
NIW je Anteil	\$ 10,04	\$ 9,97	\$ 10,13

## 17. VERGÜTUNG

Die Verwaltungsgesellschaft wendet eine Vergütungspolitik an, die den geltenden OGAW-Anforderungen entspricht und im Prospekt zusammengefasst ist.

Weitere Einzelheiten zur Vergütung der Gesellschaft sowie entsprechende finanzielle Angaben werden im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 bereitgestellt.

## 18. RECHTSSTREITIGKEITEN UND AUFSICHTSRECHTLICHE ANGELEGENHEITEN

Die Gesellschaft ist nicht als Beklagte an wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schiedsgerichtsverfahren beteiligt und ihr sind etwaige solche gegen sie bestehenden oder drohenden wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schadensersatzforderungen nicht bekannt.

Die vorstehenden Ausführungen beziehen sich nur auf den Stand vom 30. Juni 2023.

## 19. KREDITFAZILITÄT

PIMCO Funds: Global Investors Series plc hat am 19. August 2022 im Auftrag der Fonds Global High Yield Bond Fund und US High Yield Bond Fund (die „Fonds“, jeder für sich ein „Fonds“) eine dritte geänderte und neu gefasste Kreditfazilität (die „Kreditvereinbarung“) u. a. zwischen den Fonds, bestimmten Kreditgebern, zu denen auch die MUFG Bank Ltd. („MUFG“) (als Kreditgeber) zählt, und MUFG (als Verwahrstelle und Konsortialführerin) abgeschlossen.

Jeder Fonds darf die Fazilität für temporäre Zwecke nutzen, um Rücknahmen durch Anteilinhaber zu finanzieren, sowie für andere kurzfristige Liquiditätszwecke gemäß seiner Anlagepolitik.

Der Gesamtbetrag, der für eine Nutzung durch die Fonds zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung auf 285.000.000 USD. Der Gesamtbetrag, der den Fonds zusammen mit den anderen Kreditnehmern (zusammen die „Kreditnehmer“) zur Verfügung steht, unterliegt den Bedingungen der Kreditvereinbarung 300.500.000 USD (der „zugesagte Gesamtbetrag“). Die Kreditnehmer können vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung eine Erhöhung um bis zu 299.500.000 USD auf den zugesagten Gesamtbetrag verlangen. Dieser erhöhte zugesagte Betrag würde den Kreditnehmern zur Inanspruchnahme gemäß den Bestimmungen der Kreditvereinbarung zur Verfügung stehen.

Die Kreditvereinbarung sieht zwei verschiedene Zinssätze vor. Bei der Inanspruchnahme eines Kredits entscheidet jeder Fonds selbst, welcher Zinssatz für das gesamte oder einen Teil des jeweiligen Darlehen gilt. Hierbei wird der geltende Zinssatz durch Bezugnahme auf (i) die Alternate Base Rate oder (ii) die Adjusted Daily Simple SOFR bestimmt.

Der Alternate Base Rate gilt für jeden Tag, je nachdem, welcher Wert höher ist: (i) Federal Funds Rate (wie in der Kreditvereinbarung festgelegt) oder (ii) der Overnight Bank Funding Rate (wie in der Kreditvereinbarung festgelegt), wie an diesem Datum gültig. Für jeden unter Bezugnahme auf den Alternate Base Rate berechneten Kreditnennbetrag werden Zinsen auf den ausstehenden Kapitalbetrag erhoben, und zwar für den Zeitraum vom Tag der Gewährung des Kredits bis u. a. zu dem Datum, an dem der Kredit vollständig zu einem bestimmten Zinssatz zurückgezahlt wird, und zwar in Höhe des Alternate Base Rate zzgl. der geltenden Marge (1,125 %).

Der Adjusted Daily Simple SOFR ist ein Zinssatz pro Jahr, der dem (a) Daily Simple SOFR (wie in der Kreditvereinbarung festgelegt) zzgl. (b) 0,10 % entspricht. Für jeden unter Bezugnahme auf den Adjusted Daily Simple SOFR berechneten Kreditnennbetrag werden Zinsen auf den ausstehenden Kapitalbetrag erhoben, und zwar für den Zeitraum vom Tag der Gewährung oder der Fortführung des Kredits bis einschließlich zu dem Datum, an dem der Kredit vollständig zu einem bestimmten Zinssatz zurückgezahlt wird, und zwar in Höhe des Adjusted Daily Simple SOFR zuzüglich der geltenden Marge (1,125 %).

Jeder Kredit ist vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarungen innerhalb von 60 Tagen nach Inanspruchnahme zurückzuzahlen.

Sämtliche Kredite werden auf unbesicherter Basis gewährt, und der Rückgriff der Kreditgeber gegenüber einem Fonds ist auf die Vermögenswerte des betreffenden Fonds beschränkt.

Zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 hatte keiner der Fonds im Rahmen der Kreditvereinbarung Kredite in Anspruch genommen.

## 20. VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die Verordnung über Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Securities Financing Transactions Regulation, „SFTR“) führt Melde- und Offenlegungspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions, „SFT“) und Total Return Swaps ein. SFTs sind gemäß Artikel 3(11) der SFTR folgendermaßen konkret definiert:

- Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Wertpapier- oder Rohstoffleihgeschäfte
- Buy-Sellback- oder Sale-Buyback-Geschäfte oder
- Lombardgeschäfte

### (a) Globale Daten und Konzentration von SFT-Kontrahenten

Zum 30. Juni 2023 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 30. Juni 2023 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	30. Jun. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 7.016	0,25
<b>Asia Strategic Interest Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 347	0,11
<b>PIMCO Capital Securities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
NOM	\$ 25.100	0,46
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(37.940)	(0,70)
BRC	(4.872)	(0,09)
JML	(117.913)	(2,16)
NOM	(4.768)	(0,09)
SCX	(87.890)	(1,61)
<b>Summe</b>	<b>(253.383)</b>	<b>(4,65)</b>
<b>PIMCO Climate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 34.000	11,74
<b>Commodity Real Return Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (3.069)	(0,31)
CBK	(4.652)	(0,49)
CIB	(818)	(0,08)
FBF	(380)	(0,04)
GST	(6.440)	(0,66)
JPM	(1.310)	(0,13)
MAC	(856)	(0,09)
MEI	(527)	(0,05)
SOG	(44)	0,00
<b>Summe</b>	<b>(18.096)</b>	<b>(1,85)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	30. Jun. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Commodity Real Return Fund (Fortsetzung)</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.394	0,25
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(220.439)	(22,65)
GRE	(107.859)	(11,08)
IND	(10.956)	(1,13)
<b>Summe</b>	<b>(339.254)</b>	<b>(34,86)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(13.250)	(1,36)
TDM	(9.831)	(1,01)
<b>Summe</b>	<b>(23.081)</b>	<b>(2,37)</b>
<b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 7	0,01
Pensionsgeschäfte		
BPS	12.600	12,63
SSB	553	0,55
<b>Summe</b>	<b>13.153</b>	<b>13,18</b>
<b>Diversified Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 251.600	3,17
BRC	842.700	10,62
FICC	105.437	1,33
MBC	36.100	0,45
TDM	800	0,01
<b>Summe</b>	<b>1.236.637</b>	<b>15,58</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(19.918)	(0,25)
JML	(26.154)	(0,33)
MYI	(17.123)	(0,22)
<b>Summe</b>	<b>(63.195)</b>	<b>(0,80)</b>
<b>Diversified Income Duration Hedged Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 91.100	17,47
BPS	13.000	2,49
FICC	3.266	0,63
<b>Summe</b>	<b>107.366</b>	<b>20,59</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JML	(368)	(0,07)
<b>Diversified Income ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
MBC	\$ 7.400	12,76
<b>Dynamic Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BRC	\$ 466.900	13,87
FICC	3.658	0,11
SAL	85.300	2,53
<b>Summe</b>	<b>555.858</b>	<b>16,51</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(217)	(0,01)
<b>Dynamic Multi-Asset Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	€ (2.830)	(0,07)
Pensionsgeschäfte		
BPS	73.200	1,72
FICC	16.166	0,38
IND	240.200	5,64
<b>Summe</b>	<b>329.566</b>	<b>7,74</b>
<b>Emerging Local Bond Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	\$ (73.428)	(2,63)
JML	(6.864)	(0,25)
MBC	(45.840)	(1,65)
SCX	(23.881)	(0,86)
<b>Summe</b>	<b>(150.013)</b>	<b>(5,39)</b>

Fonds	30. Jun. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Emerging Local Bond ESG Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (110)	(1,43)
<b>Emerging Markets Bond Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (30.379)	(0,90)
BRC	(20.783)	(0,62)
MBC	(3.301)	(0,09)
NOM	(449)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(54.912)</b>	<b>(1,62)</b>
<b>Emerging Markets Bond ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 84.900	3,59
FICC	6.040	0,26
<b>Summe</b>	<b>90.940</b>	<b>3,85</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(701)	(0,03)
BPS	(21.717)	(0,92)
BRC	(793)	(0,03)
MYI	(5.062)	(0,21)
NOM	(7.099)	(0,30)
SCX	(1.589)	(0,07)
<b>Summe</b>	<b>(36.961)</b>	<b>(1,56)</b>
<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 3.949	2,47
<b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 939	0,41
<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 150	0,75
<b>PIMCO ESG Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 31.800	12,49
<b>Euro Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 101.800	5,81
FICC	2.444	0,14
<b>Summe</b>	<b>104.244</b>	<b>5,95</b>
<b>Euro Credit Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 27.600	4,53
FICC	977	0,16
<b>Summe</b>	<b>28.577</b>	<b>4,69</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
MYI	(549)	(0,09)
<b>Euro Income Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 122.400	9,70
FICC	274	0,02
<b>Summe</b>	<b>122.674</b>	<b>9,72</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
MYI	(8.856)	(0,70)
<b>Euro Long Average Duration Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 6.700	1,49
FICC	633	0,14
<b>Summe</b>	<b>7.333</b>	<b>1,63</b>
<b>Euro Short-Term Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 9.400	4,41
FICC	131	0,06
<b>Summe</b>	<b>9.531</b>	<b>4,47</b>

Fonds	30. Jun. 2023		Fonds	30. Jun. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens		Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO European High Yield Bond Fund</b>			<b>Summe</b>	(30.833)	(1,69)
Pensionsgeschäfte			<b>Global Low Duration Real Return Fund</b>		
BPS	€ 3.200	1,42	Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			FICC	\$ 7.529	0,60
MYI	(837)	(0,37)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
<b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b>			BOS	(408.892)	(32,63)
Pensionsgeschäfte			Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
FICC	€ 295	0,20	TDM	(9.212)	(0,74)
<b>Global Advantage Fund</b>			<b>Global Real Return Fund</b>		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.347	0,57	FICC	\$ 2.272	0,09
<b>Global Bond Fund</b>			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			BOS	(10.867)	(0,43)
BPS	\$ 127.200	1,01	BSN	(548.666)	(21,85)
BRC	593.900	4,71	CIB	(19.218)	(0,77)
<b>Summe</b>	721.100	5,72	GRE	(34.244)	(1,37)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			NOM	(178.315)	(7,10)
MBC	(1.895)	(0,02)	<b>Summe</b>	(791.310)	(31,52)
<b>Global Bond ESG Fund</b>			<b>Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 204.500	6,12	BPS	\$ 877.858	1,37
FICC	1.785	0,05	BRC	417.900	0,65
<b>Summe</b>	206.285	6,17	FICC	122.098	0,19
<b>Global Bond Ex-US Fund</b>			MBC	558.100	0,86
Total Return Swaps			NXN	105.100	0,16
BOA	\$ (18)	0,00	SOG	9.545	0,01
BPS	(146)	(0,02)	<b>Summe</b>	2.090.601	3,24
MYC	0	0,00	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	(164)	(0,02)	BRC	(5.159)	(0,01)
Pensionsgeschäfte			MBC	(3.161)	0,00
FICC	1.874	0,26	<b>Summe</b>	(8.320)	(0,01)
<b>PIMCO Global Core Asset Allocation Fund</b>			<b>Inflation Multi-Asset Fund</b>		
Total Return Swaps			Total Return Swaps		
BOA	\$ (970)	(0,14)	BPS	\$ 246	0,07
BPS	(208)	(0,03)	JPM	(78)	(0,02)
JPM	(989)	(0,15)	MAC	(421)	(0,13)
MBC	1.212	0,18	SOG	73	0,02
MYI	(53)	(0,01)	<b>Summe</b>	(180)	(0,06)
SOG	(650)	(0,10)	Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	(1.658)	(0,25)	BOS	3.300	1,02
Pensionsgeschäfte			SSB	801	0,25
FICC	18.513	2,77	<b>Summe</b>	4.101	1,27
<b>Global High Yield Bond Fund</b>			<b>Low Average Duration Fund</b>		
Pensionsgeschäfte			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 3.895	0,13	BOS	\$ (169.814)	(19,16)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			GRE	(52.171)	(5,89)
BRC	(1.913)	(0,06)	<b>Summe</b>	(221.985)	(25,05)
JML	(6.473)	(0,22)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
MYI	(3.599)	(0,11)	BPG	(19.674)	(2,22)
<b>Summe</b>	(11.985)	(0,39)	<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>		
<b>Global Investment Grade Credit Fund</b>			Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			FICC	\$ 563	0,07
BRC	\$ 472.200	4,50	<b>Low Duration Income Fund</b>		
FICC	79.332	0,75	Pensionsgeschäfte		
SAL	8.000	0,08	BPS	\$ 322.600	22,16
<b>Summe</b>	559.532	5,33	FICC	3.892	0,27
<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund</b>			<b>Summe</b>	326.492	22,43
Pensionsgeschäfte			<b>Low Duration Opportunities Fund</b>		
SSB	\$ 2.319	0,13	Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BPS	\$ 92.300	8,23
BOS	(151.412)	(8,32)	FICC	2.587	0,23
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			<b>Summe</b>	94.887	8,46
BPG	(23.851)	(1,31)			
MSC	(6.982)	(0,38)			

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	30. Jun. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 756	0,79
BPS	69	0,07
CBK	(9)	(0,01)
FAR	76	0,08
JPM	9	0,01
MYI	573	0,58
<b>Summe</b>	<b>1.474</b>	<b>1,52</b>
Pensionsgeschäfte		
SSB	840	0,87
<b>Mortgage Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 4.008	0,65
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(6.770)	(1,09)
CIB	(338.422)	(54,56)
<b>Summe</b>	<b>(345.192)</b>	<b>(55,65)</b>
<b>StocksPLUS™ Fund</b>		
Total Return Swaps		
CBK	\$ 375	0,02
FAR	6.677	0,37
JPM	11.224	0,62
RBC	26.283	1,46
UBS	1.397	0,08
<b>Summe</b>	<b>45.956</b>	<b>2,55</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	174.000	9,64
BRC	36.600	2,03
DEU	100	0,01
FICC	10.413	0,58
GSC	130.000	7,21
MFK	150.000	8,31
RVM	150.000	8,31
<b>Summe</b>	<b>651.113</b>	<b>36,09</b>
<b>PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>		
Total Return Swaps		
BRC	\$ 62	0,53
CBK	94	0,82
FAR	133	1,15
RBC	315	2,73
<b>Summe</b>	<b>604</b>	<b>5,23</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	3.900	33,78
SSB	118	1,02
<b>Summe</b>	<b>4.018</b>	<b>34,80</b>
<b>Strategic Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.001	0,43
<b>Total Return Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.321	0,03
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(8.309)	(0,19)
MYI	(1.098)	(0,03)
<b>Summe</b>	<b>(9.407)</b>	<b>(0,22)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(7.982)	(0,18)
<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b>		
Total Return Swaps		
MEI	\$ (232)	(0,08)
Pensionsgeschäfte		
BPS	2.500	0,83
SSB	2.083	0,69
<b>Summe</b>	<b>4.583</b>	<b>1,52</b>

	30. Jun. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>UK Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BRC	£ 13.000	3,88
FICC	102	0,03
<b>Summe</b>	<b>13.102</b>	<b>3,91</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SCX	(25.054)	(7,48)
<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 322	0,11
SCX	1.600	0,54
<b>Summe</b>	<b>1.922</b>	<b>0,65</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SCX	(2.915)	(0,98)
<b>US High Yield Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 10.034	0,51
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(3.139)	(0,16)
BRC	(1.740)	(0,09)
MYI	(1.060)	(0,05)
RDR	(3.547)	(0,18)
<b>Summe</b>	<b>(9.486)</b>	<b>(0,48)</b>
<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 22.300	5,01
FICC	2.968	0,67
<b>Summe</b>	<b>25.268</b>	<b>5,68</b>
<b>US Short-Term Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 225.700	10,93
FICC	2.237	0,11
<b>Summe</b>	<b>227.937</b>	<b>11,04</b>

Zum 31. Dezember 2022 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 31. Dezember 2022 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 20.572	0,69
<b>Asia Strategic Interest Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 820	0,26
<b>PIMCO Capital Securities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 10.172	0,18
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(71.348)	(1,25)
BRC	(4.860)	(0,08)
BYR	(59.977)	(1,05)
FBF	(2.857)	(0,05)
IND	(171.111)	(2,98)
JML	(135.138)	(2,36)
SCX	(133.184)	(2,34)
<b>Summe</b>	<b>(578.475)</b>	<b>(10,11)</b>

Fonds	31. Dez. 2022		Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögen		Marktwert (000S)	% des Nettovermögen
<b>PIMCO Climate Bond Fund</b>			<b>Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)</b>		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
TDM	\$ 36.800	12,57	BPS	€ 22.818	0,45
<b>Commodity Real Return Fund</b>			CDI	100.000	1,96
Total Return Swaps			FICC	1.786	0,03
BPS	\$ (2.955)	(0,21)	<b>Summe</b>	124.604	2,44
CBK	(2.457)	(0,18)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CIB	(334)	(0,02)	BPS	(17.828)	(0,35)
FBF	(181)	(0,01)	<b>Emerging Local Bond Fund</b>		
GST	(3.476)	(0,25)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JPM	(345)	(0,03)	BPS	\$ (39.132)	(2,04)
MAC	1.137	0,08	BRC	(46.181)	(2,41)
MEI	(251)	(0,02)	<b>Summe</b>	(85.313)	(4,45)
SOG	(497)	(0,04)	<b>Emerging Markets Bond Fund</b>		
<b>Summe</b>	(9.359)	(0,68)	Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			FICC	\$ 9.160	0,28
FICC	613	0,04	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
IND	58.500	4,28	BPS	(36.659)	(1,11)
<b>Summe</b>	59.113	4,32	BRC	(16.023)	(0,48)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			MBC	(1.622)	(0,05)
BOS	(485)	(0,04)	MEI	(21.052)	(0,64)
CIB	(331.976)	(24,23)	<b>Summe</b>	(75.356)	(2,28)
GRE	(67.687)	(4,94)	<b>Emerging Markets Bond ESG Fund</b>		
RCY	(25.154)	(1,84)	Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	(425.302)	(31,05)	FICC	\$ 9.261	0,37
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			NOM	35.400	1,42
BOS	(17.959)	(1,31)	<b>Summe</b>	44.661	1,79
<b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Total Return Swaps			BPS	(21.023)	(0,84)
BPS	\$ (160)	(0,16)	BRC	(6.168)	(0,25)
Pensionsgeschäfte			MEI	(4.460)	(0,18)
BPS	6.300	6,48	NOM	(7.189)	(0,29)
FICC	610	0,63	<b>Summe</b>	(38.840)	(1,56)
<b>Summe</b>	6.910	7,11	<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>		
<b>Diversified Income Fund</b>			Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			BPS	\$ 6.100	3,61
BOS	\$ 500.000	5,71	FICC	2.286	1,35
BRC	568.200	6,49	<b>Summe</b>	8.386	4,96
CIB	580.100	6,63	<b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b>		
FICC	41.323	0,47	Pensionsgeschäfte		
MBC	56.700	0,65	SSB	\$ 706	0,35
<b>Summe</b>	1.746.323	19,95	<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BRC	(4.363)	(0,05)	SAL	\$ 2.500	11,95
JML	(2.283)	(0,03)	SSB	266	1,27
<b>Summe</b>	(6.646)	(0,08)	<b>Summe</b>	2.766	13,22
<b>Diversified Income Duration Hedged Fund</b>			<b>PIMCO ESG Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 102.832	18,21	BPS	\$ 44.400	18,66
<b>Dynamic Bond Fund</b>			<b>Euro Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BRC	\$ 1.055.700	30,31	BPS	€ 10.900	0,57
FICC	2.892	0,08	FICC	615	0,03
SAL	87.100	2,50	<b>Summe</b>	11.515	0,60
<b>Summe</b>	1.145.692	32,89	<b>Euro Credit Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
DBL	(2.164)	(0,06)	BPS	€ 7.400	1,21
<b>Dynamic Multi-Asset Fund</b>			FICC	921	0,15
Total Return Swaps			IND	36.300	5,95
BPS	€ 440	0,01	<b>Summe</b>	44.621	7,31
JPM	146	0,00	<b>Euro Income Bond Fund</b>		
MEI	80	0,00	Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	666	0,01	BPS	€ 16.600	1,23
			COM	100.000	7,38
			FICC	3.858	0,29
			<b>Summe</b>	120.458	8,90

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögen
<b>Euro Long Average Duration Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 1.500	1,36
<b>Euro Short-Term Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 14.100	3,99
<b>PIMCO European High Yield Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 3.700	2,12
<b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 4.400	2,08
<b>Global Advantage Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.408	0,34
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
MEI	(1.504)	(0,37)
<b>Global Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 660.000	5,77
CIB	562.700	4,93
FICC	124.270	1,09
<b>Summe</b>	<b>1.346.970</b>	<b>11,79</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
FBF	(1.682)	(0,01)
<b>Global Bond ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 275.900	8,88
BRC	313.900	10,11
FICC	568.047	18,29
<b>Summe</b>	<b>1.157.847</b>	<b>37,28</b>
<b>Global Bond Ex-US Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 182	0,03
BPS	315	0,04
MYC	21	0,00
<b>Summe</b>	<b>518</b>	<b>0,07</b>
Pensionsgeschäfte		
FICC	1.625	0,23
<b>PIMCO Global Core Asset Allocation Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 384	0,05
BPS	62	0,01
BRC	(49)	(0,01)
GST	(2)	0,00
JPM	192	0,03
MBC	(33)	0,00
MEI	7	0,00
MYI	(122)	(0,03)
SOG	118	0,02
<b>Summe</b>	<b>557</b>	<b>0,07</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	7.300	0,97
FICC	11.236	1,50
<b>Summe</b>	<b>18.536</b>	<b>2,47</b>
<b>Global High Yield Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 7.812	0,25
NOM	3.600	0,12
<b>Summe</b>	<b>11.412</b>	<b>0,37</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(5.516)	(0,18)
FBF	(2.419)	(0,08)
JML	(2.462)	(0,08)
<b>Summe</b>	<b>(10.397)</b>	<b>(0,34)</b>

Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögen
<b>Global Investment Grade Credit Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
DEU	\$ 30.800	0,29
FICC	29.223	0,28
SAL	15.400	0,15
<b>Summe</b>	<b>75.423</b>	<b>0,72</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(2.721)	(0,03)
JML	(1.433)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(4.154)</b>	<b>(0,04)</b>
<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 15.240	1,11
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(75.130)	(5,48)
BRC	(798)	(0,06)
<b>Summe</b>	<b>(75.928)</b>	<b>(5,54)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(75.242)	(5,49)
MSC	(684)	(0,05)
<b>Summe</b>	<b>(75.926)</b>	<b>(5,54)</b>
<b>Global Low Duration Real Return Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.053	0,08
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CIB	(190.632)	(13,97)
DEU	(71.081)	(5,21)
<b>Summe</b>	<b>(261.713)</b>	<b>(19,18)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BRC	(69.575)	(5,10)
TDM	(10.024)	(0,73)
<b>Summe</b>	<b>(79.599)</b>	<b>(5,83)</b>
<b>Global Real Return Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.245	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(14.838)	(0,58)
BRC	(3.159)	(0,12)
BSN	(554.549)	(21,56)
CIB	(171.691)	(6,68)
GRE	(51.915)	(2,02)
<b>Summe</b>	<b>(796.152)</b>	<b>(30,96)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BOS	(9.519)	(0,37)
<b>Income Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 80	0,00
GST	(735)	0,00
<b>Summe</b>	<b>(655)</b>	<b>0,00</b>
Pensionsgeschäfte		
BOS	500.000	0,86
DEU	116.100	0,20
FICC	2.037.659	3,51
MBC	644.900	1,11
SGY	113.800	0,20
SOG	9.239	0,02
<b>Summe</b>	<b>3.421.698</b>	<b>5,90</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(5.155)	(0,01)
DBL	(10.712)	(0,02)
<b>Summe</b>	<b>(15.867)</b>	<b>(0,03)</b>
<b>Inflation Multi-Asset Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (373)	(0,09)
BRC	(21)	(0,01)
CBK	(76)	(0,02)
GST	(118)	(0,03)

Fonds	31. Dez. 2022		Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögen		Marktwert (000S)	% des Nettovermögen
<b>Inflation Multi-Asset Fund (Fortsetzung)</b>			MBC	(120)	(0,01)
JPM	\$ 17	0,00	RBC	(1.063)	(0,11)
MAC	192	0,05	<b>StocksPLUS™ Fund (Fortsetzung)</b>		
MYI	(362)	(0,09)	UBS	\$ (35)	(0,01)
SOG	(48)	(0,01)	<b>Summe</b>	(2.366)	(0,24)
<b>Summe</b>	(789)	(0,20)	Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			BOS	20.300	2,01
GSC	37.700	9,34	FICC	14.743	1,46
SSB	3.020	0,76	NOM	60.000	5,95
<b>Summe</b>	40.720	10,10	SGY	24.500	2,43
<b>Low Average Duration Fund</b>			TOR	36.902	3,67
Pensionsgeschäfte			<b>Summe</b>	156.445	15,52
FICC	\$ 956	0,09	<b>PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Total Return Swaps		
BOS	(128.895)	(12,01)	BRC	\$ (4)	(0,04)
GRE	(15.962)	(1,49)	FAR	(16)	(0,16)
<b>Summe</b>	(144.857)	(13,50)	RBC	(17)	(0,19)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			<b>Summe</b>	(37)	(0,39)
CSN	(4.077)	(0,38)	Pensionsgeschäfte		
<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>			BPS	1.200	12,59
Pensionsgeschäfte			SSB	174	1,83
FICC	\$ 1.604	0,24	<b>Summe</b>	1.374	14,42
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			<b>Strategic Income Fund</b>		
BOS	(2.415)	(0,37)	Total Return Swaps		
BRC	(607)	(0,09)	GST	\$ (4)	0,00
GRE	(9.754)	(1,49)	Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	(12.776)	(1,95)	FICC	781	0,15
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			<b>Total Return Bond Fund</b>		
BPG	(1.409)	(0,22)	Pensionsgeschäfte		
<b>Low Duration Income Fund</b>			BOS	\$ 26.100	0,63
Total Return Swaps			FICC	144.795	3,49
GST	\$ (2)	0,00	<b>Summe</b>	170.895	4,12
Pensionsgeschäfte			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
FICC	5.431	0,50	BRC	(1.745)	(0,04)
MBC	93.400	8,61	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
<b>Summe</b>	98.831	9,11	BPG	(76.809)	(1,85)
<b>Low Duration Opportunities Fund</b>			<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b>		
Pensionsgeschäfte			Total Return Swaps		
FICC	\$ 118.800	8,83	MEI	\$ (165)	(0,04)
<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>			Pensionsgeschäfte		
Total Return Swaps			BPS	22.700	5,21
BOA	\$ (130)	(0,10)	SSB	4.752	1,09
CBK	(8)	(0,01)	<b>Summe</b>	27.452	6,30
FAR	(18)	(0,01)	<b>UK Corporate Bond Fund</b>		
JPM	(1)	0,00	Pensionsgeschäfte		
MYI	16	0,01	FICC	£ 177	0,05
<b>Summe</b>	(141)	(0,11)	<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
SSB	811	0,68	FICC	£ 269	0,08
<b>Mortgage Opportunities Fund</b>			<b>US High Yield Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 13.700	1,61	FICC	\$ 9.269	0,47
FICC	3.618	0,43	<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>		
<b>Summe</b>	17.318	2,04	Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BOS	\$ 12.800	3,30
CIB	(264.111)	(31,10)	FICC	2.583	0,66
JPS	(724)	(0,09)	<b>Summe</b>	15.383	3,96
RCY	(23.192)	(2,73)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
SCX	(28.466)	(3,35)	BPG	(38.655)	(9,95)
<b>Summe</b>	(316.493)	(37,27)	<b>US Short-Term Fund</b>		
<b>StocksPLUS™ Fund</b>			Pensionsgeschäfte		
Total Return Swaps			FICC	\$ 154.472	6,69
FAR	\$ (1.148)	(0,11)			



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

### (b) Sicherheiten

#### (i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Die zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 erhaltenen Sicherheiten wurden im globalen Depotbanknetz der State Street Bank and Trust als oberste Muttergesellschaft der Verwahrstelle gehalten.

#### (ii) Konzentrationsdaten:

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2023 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

		Zum 30. Jun. 2023	
Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)	
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 7.156	
Asia Strategic Interest Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	354	
PIMCO Capital Securities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	25.876	
PIMCO Climate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	34.995	
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.442	
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	13.433	
Diversified Income Fund	Ginnie Mae	100.088	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.165.706	
Diversified Income Duration Hedged Fund	Ginnie Mae	6.004	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	104.469	
Diversified Income ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	7.643	
Dynamic Bond Fund	Fannie Mae	395.977	
	Ginnie Mae	83.801	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	90.822	
Dynamic Multi-Asset Fund	Agence Francaise de Developpement	€ 6.042	
	BNG Bank NV	2.220	
	Bpifrance	798	
	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	1.508	
	Rat der Europäischen Entwicklungsbank	2.300	
	Europäische Union	106.469	
	Regierung von Frankreich	28.465	
	Germany Government	2.043	
	Kreditanstalt für Wiederaufbau	32.466	
	La Poste S.A.	1.143	
	Landwirtschaftliche Rentenbank	1.237	
	Regierung von Luxemburg	50.663	
	Niederlandse Waterschapsbank NV	1.634	
	NRW Bank	600	
	SFIL S.A.	174	
	Societe Nationale SNCF S.A.	73.831	
	Land Berlin	3.312	
	State of Lower Saxony	197	
	UNEDIC	4.648	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	16.489	
Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 27	
Emerging Markets Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	92.751	
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	4.028	
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	958	
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	153	
PIMCO ESG Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	32.515	
Euro Bond Fund	Land Nordrhein-Westfalen	€ 100.000	
	Land Saarland	8.561	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.493	

  

		Zum 30. Jun. 2023	
Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)	
Euro Credit Fund	Land Nordrhein-Westfalen	€ 28.356	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	997	
Euro Income Bond Fund	State of Brandenburg	100.000	
	Land Nordrhein-Westfalen	32.863	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	280	
Euro Long Average Duration Fund	Land Berlin	6.030	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	646	
Euro Short-Term Fund	State of Brandenburg	9.724	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	134	
PIMCO European High Yield Bond Fund	Europäische Union	3.250	
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	301	
Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 2.394	
Global Bond Fund	Ginnie Mae	102	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	735.683	
Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	210.484	
Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.911	
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.883	
Global High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.973	
Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	571.059	
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.365	
Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	7.680	
Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.317	
Income Fund	American International Group, Inc.	3.115	
	Amgen, Inc.	1.966	
	Barclays PLC	3.300	
	Canada Government International Bond	225.563	
	Morgan Stanley	1.791	
	Province of Quebec	161.448	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.744.640	
Inflation Multi-Asset Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	4.206	
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	574	
Low Duration Income Fund	Ginnie Mae	48.032	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	285.568	
Low Duration Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	96.812	
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	857	
Mortgage Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	4.088	
StocksPLUS™ Fund	Fannie Mae	134.655	
	Ginnie Mae	179.208	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	354.160	
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Ginnie Mae	1.863	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.265	
Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.041	
Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.347	
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	4.678	
UK Corporate Bond Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	£ 13.263	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	104	
UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	1.644	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	329	
US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 10.808	
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	25.782	
US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	232.988	

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2022 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2022		
Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)	Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 20.983	Euro Income Bond Fund	BNG Bank NV	€ 16.819
Asia Strategic Interest Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	836		Land Berlin	102.209
PIMCO Capital Securities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	10.375		Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.935
PIMCO Climate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	38.412	Euro Long Average Duration Fund	Kreditanstalt für Wiederaufbau	1.517
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	61.286	Euro Short-Term Fund	BNG Bank NV	14.286
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	7.060	PIMCO European High Yield Bond Fund	Kreditanstalt für Wiederaufbau	3.743
Diversified Income Fund	Freddie Mac	139.541	PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Kreditanstalt für Wiederaufbau	4.454
	Ginnie Mae	450.224	Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 1.436
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.205.939	Global Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.378.007
Diversified Income Duration Hedged Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	104.889	Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.181.854
Dynamic Bond Fund	Freddie Mac	139.541	Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.658
	Ginnie Mae	413.154	PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.879
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	621.400	Global High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	11.642
Dynamic Multi-Asset Fund	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 100.270	Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	76.925
	Europäische Union	18.150	Global Investment Grade Credit ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	15.545
	Kreditanstalt für Wiederaufbau	161	Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.074
	Landwirtschaftliche Rentenbank	4.907	Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.391
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.822	Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.498.550
Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 9.343	Inflation Multi-Asset Fund	Freddie Mac	38.846
Emerging Markets Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	45.570		Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.080
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	8.567	Low Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	975
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	720	Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.636
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.820	Low Duration Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	101.947
PIMCO ESG Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	45.259	Low Duration Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	121.176
Euro Bond Fund	BNG Bank NV	€ 11.063	PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	827
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	627	StocksPLUS™ Fund	Regierung von Kanada	36.902
Euro Credit Fund	BNG Bank NV	2.776		Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	122.051
	Bpifrance SACA	483	PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.405
	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	568	Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	797
	Europäische Union	25.098	Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	174.491
	Kreditanstalt für Wiederaufbau	4.431	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	28.016
	Landwirtschaftliche Rentenbank	8.536	UK Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	£ 181
	Land Nordrhein-Westfalen	837	UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	274
	UNEDIC	1.626	US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 9.454
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	940	US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	15.768
			US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	157.561

### (iii) Aggregierte Transaktionsdaten:

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2023 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 7.156	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Asia Strategic Interest Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	354	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Capital Securities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	25.876	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	790	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	7.750	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Climate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	\$ 34.995	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Commodity Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.442	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	260	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	12.869	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	564	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income Fund									
	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	100.088	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	353.153	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.640	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	255.041	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	447.505	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	108.367	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	288	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Diversified Income Duration Hedged Fund									
	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	6.004	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	93.785	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	102	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	7.251	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	3.331	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	7.643	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Dynamic Bond Fund									
	Pensionsgeschäfte	Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	395.977	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	83.801	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	90.822	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund									
	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	€ 2.400	k. A.	k. A.	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Agence Francaise de Developpement	Unternehmensanleihen	697	AA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Agence Francaise de Developpement	Unternehmensanleihen	4.653	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Agence France Locale	Unternehmensanleihen	692	A-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		BNG Bank NV	Treasury	2.220	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Bpifrance Financement S.A.	Treasury	798	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Treasury	497	AA-	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Treasury	1.011	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Rat der Europäischen Entwicklungsbank	Treasury	2.300	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Finanzstabilisierungsfazilität	Treasury	13.142	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Finanzstabilisierungsfazilität	Treasury	7.333	AAA	Unter 1 Monat	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Investitionsbank	Treasury	29.499	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäischer Stabilitätsmechanismus	Treasury	3.895	AAA	1-3 Monate	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäischer Stabilitätsmechanismus	Treasury	1.317	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Union	Treasury	30.747	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		European Union Treasury Bills	Treasury	9.739	AAA	1-3 Monate	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		European Union Treasury Bills	Treasury	10.797	AAA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		France Government International Bond	Treasury	26.399	AA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		France Government International Bond	Treasury	2.066	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	1.364	AAA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
		Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	€ 31.102	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		La Poste S.A.	Unternehmensanleihen	1.143	A+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Land Berlin	Treasury	3.312	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Treasury	1.237	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Luxembourg Government International Bond	Treasury	50.663	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Niederlandse Waterschapsbank NV	Treasury	1.634	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		NRW Bank	Unternehmensanleihen	600	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		SFIL S.A.	Unternehmensanleihen	174	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Societe Nationale SNCF S.A.	Unternehmensanleihen	73.831	A+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Land Niedersachsen	Treasury	197	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	396	AAA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	1.647	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	16.489	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		UNEDIC	Treasury	4.648	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Emerging Local Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 285	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	27	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	86.590	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	6.161	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	280	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	4.028	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	958	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	153	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO ESG Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	24.760	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	7.755	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	€ 100.000	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		Land Saarland	Treasury	8.561	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.493	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	28.356	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	997	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	State of Brandenburg	Treasury	100.000	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	32.863	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	280	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	270	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	Land Berlin	Treasury	6.030	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	646	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	State of Brandenburg	Treasury	9.724	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	134	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO European High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Europäische Union	Treasury	3.250	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	301	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 2.394	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	102	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	129.709	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	605.974	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	102	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	208.561	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.821	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.080	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.280	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.911	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	4.250	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.510	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	410	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	18.883	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	3.973	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	481.979	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	89.080	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.365	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	7.680	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.317	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Income Fund	Pensionsgeschäfte	American International Group, Inc.	Unternehmensanleihen	3.115	BBB+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Amgen, Inc.	Unternehmensanleihen	1.966	BBB+	3 Monate - 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barclays PLC	Unternehmensanleihen	3.300	A	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Canada Government International Bond	Treasury	225.563	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Frankreich	FED, Bilateral
		Morgan Stanley	Unternehmensanleihen	1.791	A+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Province of Quebec	Treasury	161.448	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	144.409	AAA	1-3 Monate	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	49.959	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	108.590	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	60.417	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	510.165	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	10.645	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	735.915	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	124.540	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Inflation Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.340	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	3.389	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	817	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	574	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Income Fund	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	48.032	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	281.598	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	3.970	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	94.173	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.639	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	320	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	340	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	820	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	857	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	4.088	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
StocksPLUS™ Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 31.470	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	134.655	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	141.714	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	37.494	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	153.753	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	37.947	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	151.839	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Cayman-Inseln	FED, Bilateral
	U.S. Treasury Notes	Treasury	10.621	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	300	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	80	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	1.863	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.145	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	U.S. Treasury Notes	Treasury	120	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.041	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.347	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	320	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.553	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.125	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	£ 104	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		United Kingdom Gilt	Treasury	13.263	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	FED, Bilateral
UK Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	329	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		United Kingdom Gilt	Treasury	1.644	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	FED, Bilateral
US High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 10.235	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	303	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	270	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	22.755	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	3.027	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	200.759	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
US Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	29.947	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.282	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2022 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnungs- und Verrechnungssystem
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 20.983	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	836	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Asia Strategic Interest Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	10.375	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.516	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	6.877	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	264	k. A.	k. A.	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
PIMCO Capital Securities Fund		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	7.614	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	38.412	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Climate Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	840	k. A.	k. A.	USD	Australien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.310	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	625	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	60.504	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	157	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art Sicherheiten	Marktwert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung- und Verrechnungssystem	
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2	62	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
					6.43					
Diversified Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	8	139.54	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	1	450.22	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	4	58.07	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	8	42.15	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	0	513.51	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	6	592.19	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	5	27	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income Duration Hedged Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	7	2.48	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1	102.40	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	8	139.54	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	1	413.15	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	4	2.95	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	0	529.68	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	1	88.76	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte			9	10.20	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
				€	4.04	k. A.	k. A.	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
				0	7.08	k. A.	k. A.	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	0	100.27	AA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Treasury	0	18.15	AAA	1-3 Monate	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäischer Stabilitätsmechanismus	Treasury	0	16	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	1	4.90	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Unternehmensanleihen	7	1.82	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	2	9.34	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	3	2.60	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	9	39	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3	9.44	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	6	36.12	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	4	80	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	7	2.33	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	2	6.23	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	5	72	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	0	2.54	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	9	27	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1	45.25	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO ESG Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	9	11.06	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		BNG Bank NV	Treasury	3	62	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	7	2.77	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		BNG Bank NV	Treasury	6	48	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	Bpifrance SACA	Treasury	3	56	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Treasury	8	78	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Rat der Europäischen Entwicklungsbank	Treasury	4	4.99	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäischer Stabilitätsmechanismus	Treasury	6	6.79	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Investitionsbank	Treasury	8		AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral



Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnungssystem
		Europäische Union	Treasury	€ 12.520	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	979	AAA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	3.452	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Unternehmensanleihen	8.536	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	837	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		UNEDIC	Treasury	1.626	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	940	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	BNG Bank NV	Treasury	16.819	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Land Berlin	Treasury	102.209	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	3.935	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	1.517	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	BNG Bank NV	Treasury	14.286	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
PIMCO European High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	3.743	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	4.454	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	\$ 1.436	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	307.187	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	269.857	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	674.208	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	126.755	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	320.650	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	36.147	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	281.796	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	543.261	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	530	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.658	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.660	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.560	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	590	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	11.461	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	7.418	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	7.968	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	3.674	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	205	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	29.808	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	31.422	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	15.695	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	15.545	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.074	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.290	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	101	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	404.498	AAA	Bis zu 1 Monat	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	82.219	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	9.894	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	747.747	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected	Treasury	323.152	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	257.998	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.673.042	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	273	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	1	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Inflation Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	240	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	38.846	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	3.080	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnungssystem
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 975	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.636	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	5.540	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	96.407	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Low Duration Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	121.176	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Swap-Kontrakte	Zahlungs mittel		370	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	827	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	3.690	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	14.004	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungs mittel	4.656	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
StocksPLUS™ Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Ontario	Treasury	36.902	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	15.038	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	107.013	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.227	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	178	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	797	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	26.800	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	5.911	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	141.780	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	23.169	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	4.847	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	£ 181	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	274	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	\$ 9.454	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	13.133	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.635	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.725	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	154.836	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Der Marktwert der Sicherheiten für Pensionsgeschäfte umfasst aufgelaufene Zinsen.

Rahmenverträge für Termingeschäfte decken eine Kombination aus Buy-Sellback-Geschäften, Sale-Buyback-Geschäften und sonstigen Finanzierungsgeschäften ab, die oben nicht enthalten sind. Der Gesamtbetrag der zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 für alle Sicherheiten, die für gemäß diesen Vereinbarungen abgeschlossene Geschäfte erhalten wurden, ist oben enthalten. Es ist nicht möglich, die Sicherheiten für jedes einzelne Wertpapierfinanzierungsgeschäft separat zu analysieren.

ISDA-Vereinbarungen decken eine Kombination von Swap-Kontrakten ab; der Gesamtbetrag der Sicherheiten für diese Vereinbarungen ist in den obigen Angaben enthalten.

### (c) Rendite/Kosten

Die nachfolgenden Tabellen liefern detaillierte Angaben zur Rendite und den Kosten jeder Art von SFT und Total Return Swap für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022. Die Beträge sind in der Basiswährung der Fonds ausgewiesen.

Fonds	30. Jun. 2023							
	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 733	\$ 0	\$ 0	\$ (61)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Asia Strategic Interest Bond Fund	22	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO Capital Securities Fund	1.818	0	133	(8.854)	0	0	0	0
PIMCO Climate Bond Fund	1.017	0	1	(4)	0	0	0	0
Commodity Real Return Fund	229	0	0	(9.180)	0	(2)	0	(64)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	282	0	0	0	0	0	0	(1)
Diversified Income Fund	30.043	0	0	(330)	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	2.075	0	0	(1)	0	0	0	0
Diversified Income ESG Fund	62	0	0	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	15.666	0	0	0	0	0	0	0

30. Jun. 2023

Fonds	Pensions- geschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback- Finanzierungs- geschäfte		Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
	€	€	€	€	€	€	€	€
Dynamic Multi-Asset Fund	2.823	0	0	(6)	0	0	0	0
Emerging Local Bond Fund	\$ 304	\$ 0	\$ 0	\$ (4.900)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Emerging Local Bond ESG Fund	0	0	0	(3)	0	0	0	0
Emerging Markets Bond Fund	71	0	0	(2.061)	0	0	0	(170)
Emerging Markets Bond ESG Fund	1.572	0	0	(900)	0	0	0	(6)
Emerging Markets Corporate Bond Fund	39	0	0	(2)	0	0	0	0
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	173	0	0	(14)	0	0	0	0
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	136	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO ESG Income Fund	1.138	0	0	0	0	0	0	0
Euro Bond Fund	€ 1.126	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	364	0	0	(4)	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	1.277	0	0	(15)	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	65	0	0	(13)	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	186	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	125	0	0	(2)	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	42	0	0	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	\$ 20	\$ 0	\$ 0	\$ (7)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (1)
Global Bond Fund	14.063	0	0	(10)	0	0	0	(20)
Global Bond ESG Fund	10.397	0	1	(13)	0	0	0	(5)
Global Bond Ex-US Fund	21	0	0	(8)	0	0	0	(3)
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	443	0	0	(28)	0	0	0	(32)
Global High Yield Bond Fund	285	0	35	0	0	0	0	(6)
Global Investment Grade Credit Fund	11.884	(89)	0	(16)	0	0	0	0
Global Investment Grade Credit ESG Fund	200	0	0	(2.757)	0	0	0	(372)
Global Low Duration Real Return Fund	27	0	0	(8.191)	0	0	0	(303)
Global Real Return Fund	33	0	0	(19.043)	0	0	0	(185)
Income Fund	155.272	0	5	(39)	0	0	0	(89)
Income Fund II	0	(51)	0	0	0	0	0	(20)
Inflation Multi-Asset Fund	409	0	0	0	0	0	0	(5)
Low Average Duration Fund	269	0	13	(2.221)	0	(1)	0	(889)
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	45	0	0	(178)	0	0	0	(264)
Low Duration Income Fund	5.404	0	0	0	0	0	0	0
Low Duration Opportunities Fund	1.654	0	0	(51)	0	0	0	0
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	12	0	0	0	0	0	0	0
Mortgage Opportunities Fund	589	0	0	(7.156)	0	0	0	(7)
StocksPLUS™ Fund	10.986	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	60	0	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	16	0	0	0	0	0	0	0
Total Return Bond Fund	378	0	0	(37)	0	0	0	(8)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	402	0	0	(9)	0	0	0	(17)
UK Corporate Bond Fund	£ 93	£ 0	£ 0	£ (286)	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	19	0	0	(117)	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	\$ 145	\$ 0	\$ 16	\$ (2)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (19)
US Investment Grade Corporate Bond Fund	431	0	0	0	0	0	1	0
US Short-Term Fund	1.618	0	0	(4)	0	0	0	(140)

30. Jun. 2022

Fonds	Pensions- geschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback- Finanzierungs- geschäfte		Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 60	\$ 0	\$ 505	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Asia Strategic Interest Bond Fund	4	0	35	0	0	0	0	0
PIMCO Capital Securities Fund	65	0	309	1.383	0	0	0	0
PIMCO Climate Bond Fund	6	0	0	0	0	0	0	0
Commodity Real Return Fund	58	0	0	18	0	0	0	80
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	2	0	0	0	0	0	0	0
Diversified Income Fund	1.661	0	2.118	0	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	114	0	57	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	48	0	39	0	0	0	0	0
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 7	€ 619	€ 13	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0

30. Jun. 2022

Fonds	Pensions- geschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback- Finanzierungs- geschäfte		Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
Emerging Local Bond Fund	\$ 3	\$ 0	\$ 0	\$ 3.248	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Emerging Markets Bond Fund	51	0	78	250	0	0	0	0
Emerging Markets Bond ESG Fund	70	0	137	196	0	0	0	0
Emerging Markets Corporate Bond Fund	1	0	1	2	0	0	0	0
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	64	9	0	0	0	0	0	0
PIMCO ESG Income Fund	20	0	0	0	0	0	0	0
Euro Bond Fund	€ 0	€ 100	€ 14	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	2	63	4	0	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	0	99	38	0	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	0	8	0	0	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	0	51	0	0	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	0	25	2	0	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	0	29	4	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	\$ 0	\$ 0	\$ 120	\$ 29	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 8
Global Bond Fund	557	0	2.813	229	0	0	0	20
Global Bond ESG Fund	231	0	0	6	0	0	0	1
Global Bond Ex-US Fund	1	0	293	31	0	0	0	0
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	6	0	0	0	0	0	0	0
Global High Yield Bond Fund	134	0	169	28	0	0	0	0
Global Investment Grade Credit Fund	28	0	29	103	0	0	0	7
Global Investment Grade Credit ESG Fund	29	0	0	77	0	0	0	31
Global Low Duration Real Return Fund	1	0	0	0	0	0	0	465
Global Real Return Fund	17	0	56	1.862	0	0	0	96
Income Fund	10.275	70	1.605	0	0	0	0	6
Income Fund II	2	0	0	0	0	0	0	0
Inflation Multi-Asset Fund	121	0	0	0	0	0	0	0
Low Average Duration Fund	117	0	0	3	0	0	204	0
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	4	0	0	0	0	0	20	0
Low Duration Income Fund	66	0	0	0	0	0	0	0
Low Duration Opportunities Fund	458	0	7	0	0	0	0	0
Mortgage Opportunities Fund	1	0	0	701	0	0	0	7
StocksPLUS™ Fund	310	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	3	0	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	1	0	0	0	0	0	0	0
Total Return Bond Fund	122	0	19	380	0	0	0	31
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	9	0	0	0	0	0	0	0
UK Corporate Bond Fund	£ 137	£ 0	£ 0	£ 114	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	17	0	0	37	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	\$ 83	\$ 0	\$ 17	\$ 33	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
US Investment Grade Corporate Bond Fund	0	0	0	8	0	0	0	11
US Short-Term Fund	5	0	0	435	0	0	0	192

Alle Renditen aus SFT-Derivatgeschäften laufen zugunsten des Fonds auf und fallen nicht unter Ertragsteuervereinbarungen mit der Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft oder sonstigen Dritten.

Für Total Return Swaps lassen sich die Transaktionskosten nicht separat identifizieren. Für diese Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und bilden Teil des Bruttoanlageergebnisses jedes Fonds. Renditen werden als realisierte Gewinne und Veränderungen der nicht realisierten Gewinne auf den Swap-Kontrakt während des Berichtszeitraums identifiziert und sind in der Betriebsergebnisrechnung im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten sowie in der Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten enthalten.

## 21. WESENTLICHE EREIGNISSE

Im Februar 2022 startete Russland eine Invasion in die Ukraine, was zu Sanktionen gegen verschiedene russische Unternehmen und Personen führte. Die Fonds können in Wertpapiere und Instrumente anlegen, die wirtschaftlich an Russland gebunden sind. Solche Anlagen könnten durch die Sanktionen und Gegensanktionen Russlands negativ beeinflusst worden sein, einschließlich Wertverlusten und Liquiditätsrückgängen. Die Liquiditätsrückgänge von Anlagen,

die mit Russland verbunden sind, können dazu führen, dass die Fonds Portfoliobestände zu einem ungünstigen Zeitpunkt oder Preis verkaufen oder weiterhin mit Russland verbundene Anlagen halten, die die Fonds möglicherweise nicht mehr halten möchten. PIMCO wird diese Positionen weiterhin aktiv im besten Interesse der Fonds und ihrer Anteilhaber verwalten.

Am 01. Januar 2023 lief der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für den Income Fund II ab. Am gleichen Tag lief der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für den Low Duration Income Fund ab und die Verwaltungsgebühr wurde dauerhaft gesenkt.

Am 03. Januar 2023 wurde der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für den Low Duration Income Fund und den Income Fund II geändert.

Am 18. Januar 2023 wurde der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für den Euro Short-Term Fund und den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund geändert.

Am 26. Januar 2023 wurde der Gesellschaftssekretär von State Street Fund Services (Ireland) Limited in Walkers Corporate Services (Ireland) Limited geändert.

Am 06. April 2023 wurde von der Verwaltungsgesellschaft eine Zeichnung in Höhe von 5.000.000 USD im US Short-Term Fund durchgeführt.

Am 26. April 2023 wurde von der Verwaltungsgesellschaft eine Rücknahme in Höhe von 11.580.279 USD aus dem US Short-Term Fund durchgeführt.

Am 01. Juni 2023 lief der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für die Investor Accumulation Class des PIMCO Climate Bond Fund ab.

Am 30. Juni 2023 wurde die Ergänzung für den Euro Credit Fund aktualisiert, um den Verzicht auf die Verwaltungsgebühr in Höhe von 25 BPS für die Anteilsklasse H Institutional um ein Jahr auf den 30. Juni 2024 zu verlängern.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Berichtszeitraums keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

## **22. EREIGNISSE NACH ABSCHLUSS DES BERICHTSZEITRAUMS**

Am 18. August 2023 wurde die Kreditfazilitätsvereinbarung, die PIMCO Funds: Global Investors Series plc im Namen des Global High Yield Bond Fund und des US High Yield Bond Fund mit bestimmten Kreditgebern, darunter MUFG Bank Ltd. („MUFG“), abgeschlossen hat, geändert und auf den PIMCO Asia High Yield Bond Fund ausgedehnt. Zum 25. August 2023 hat kein Fonds Kredite im Rahmen der Kreditfazilitätsvereinbarung aufgenommen. Weitere Einzelheiten werden im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 bereitgestellt.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Berichtszeitraums keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

## **23. GENEHMIGUNG VON FINANZABSCHLÜSSEN**

Dieser Abschluss wurde am 25. August 2023 vom Verwaltungsrat genehmigt.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Asia High Yield Bond Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	41.324.787	\$ 411.499	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	38.107.620	\$ 379.478
	<b>PAR (000S)</b>			<b>PAR (000S)</b>	
Standard Chartered PLC 7,750 % fällig am 15.08.2027	\$ 40.400	40.538	Sands China Ltd. 5,625 % fällig am 08.08.2025	\$ 26.900	26.621
Mongolia Government International Bond 8,650 % fällig am 19.01.2028	28.270	27.934	Freeport Indonesia PT 5,315 % fällig am 14.04.2032	21.800	20.424
Shriram Finance Ltd. 4,400 % fällig am 13.03.2024	25.154	24.632	Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023	19.800	19.483
Sino-Ocean Land Treasure Ltd. 3,250 % fällig am 05.05.2026	32.250	24.086	Krung Thai Bank PCL 4,400 % fällig am 25.03.2026	18.800	17.128
Indonesia Government International Bond 4,650 % fällig am 20.09.2032	21.684	21.457	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026	15.800	14.868
Bangkok Bank PCL 5,000 % fällig am 23.09.2025	18.400	17.447	Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026	16.800	14.867
Huarong Finance Co. Ltd. 4,750 % fällig am 27.04.2027	18.100	15.569	India Green Power Holdings 4,000 % fällig am 22.02.2027	16.600	14.360
SK Hynix, Inc. 6,375 % fällig am 17.01.2028	15.200	15.126	NWD Finance BVI Ltd. 5,250 % fällig am 22.03.2026	16.200	13.870
Sino-Ocean Land Treasure Ltd. 2,700 % fällig am 13.01.2025	21.200	15.109	NWD Finance BVI Ltd. 4,800 % fällig am 09.09.2023	17.200	12.468
Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	15.600	14.077	Indika Energy Capital Pte. Ltd. 8,250 % fällig am 22.10.2025	12.400	12.277
Wanda Properties Global Co. Ltd. 11,000 % fällig am 20.01.2025	14.000	13.668	HSBC Holdings PLC 6,000 % fällig am 22.05.2027	12.700	12.171
ReNew Wind Energy AP2 4,500 % fällig am 14.07.2028	15.800	13.431	NWD Finance BVI Ltd. 6,150 % fällig am 16.03.2025	11.300	10.525
Standard Chartered PLC 6,000 % fällig am 26.07.2025	13.400	13.200	SK Hynix, Inc. 6,375 % fällig am 17.01.2028	10.300	10.482
Adaro Indonesia PT 4,250 % fällig am 31.10.2024	13.590	13.133	Lenovo Group Ltd. 5,875 % fällig am 24.04.2025	10.000	10.024
Wynn Macau Ltd. 4,500 % fällig am 07.03.2029	12.300	13.029	Mongolia Government International Bond 5,625 % fällig am 01.05.2023	10.022	9.972
Huarong Finance Co. Ltd. 3,250 % fällig am 13.11.2024	13.900	12.967	Zhongsheng Group Holdings Ltd. 0,000 % fällig am 21.05.2025	HKD 69.000	9.705
Huarong Finance Co. Ltd. 3,750 % fällig am 29.05.2024	13.500	12.925	Standard Chartered PLC 7,750 % fällig am 15.08.2027	\$ 9.400	9.230
SK Broadband Co. Ltd. 4,875 % fällig am 28.06.2028	12.950	12.856	Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % fällig am 29.05.2029	10.700	9.202
Huarong Finance Co. Ltd. 5,000 % fällig am 19.11.2025	13.100	11.595	Freeport Indonesia PT 4,763 % fällig am 14.04.2027	9.200	8.855
Sands China Ltd. 5,900 % fällig am 08.08.2028	11.700	11.346			
Agile Group Holdings Ltd. 5,500 % fällig am 17.05.2026	27.010	11.343			
Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % fällig am 29.05.2029	14.300	11.201			

(a) Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	8.563.541	\$ 85.277	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	9.459.862	\$ 94.200
	<b>PAR (000S)</b>			<b>PAR (000S)</b>	
Korea Housing Finance Corp. 4,625 % fällig am 24.02.2028	\$ 7.100	7.039	Korea National Oil Corp. 2,125 % fällig am 18.04.2027	\$ 5.300	4.808
Kasikornbank PCL 5,458 % fällig am 07.03.2028	5.600	5.600	ONGC Videsh Ltd. 3,750 % fällig am 07.05.2023	4.100	4.082
POSCO 5,750 % fällig am 17.01.2028	3.700	3.682	Indonesia Government International Bond 4,650 % fällig am 20.09.2032	4.000	3.944
Export-Import Bank of Korea 5,000 % fällig am 11.01.2028	3.500	3.520	Export-Import Bank of Korea 5,000 % fällig am 11.01.2028	3.500	3.573
Korea National Oil Corp. 4,875 % fällig am 03.04.2028	3.500	3.506	Periana Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	3.500	3.378
SK Hynix, Inc. 2,375 % fällig am 19.01.2031	4.620	3.477	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,400 % fällig am 06.06.2027	3.200	3.165
SMBC Aviation Capital Finance DAC 5,450 % fällig am 03.05.2028	3.400	3.401	Kasikornbank PCL 5,458 % fällig am 07.03.2028	2.900	2.995
SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026	3.400	3.397	SK Hynix, Inc. 2,375 % fällig am 19.01.2031	3.600	2.730
Bank Mandiri Persero Tbk PT 5,500 % fällig am 04.04.2026	2.900	2.888	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 4,250 % fällig am 12.09.2028	2.300	2.250
India Toll Roads 5,500 % fällig am 19.08.2024	2.700	2.594	Muang Thai Life Assurance PCL 3,552 % fällig am 27.01.2037	2.600	2.249
NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % fällig am 10.03.2028	3.550	2.523	SK Hynix, Inc. 6,375 % fällig am 17.01.2028	2.200	2.209
Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp. 5,375 % fällig am 11.05.2028	2.450	2.431	Celestial Miles Ltd. 5,750 % fällig am 31.01.2024	2.200	2.175
Standard Chartered PLC 6,301 % fällig am 09.01.2029	2.300	2.303	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	2.189	2.160
Woori Bank 4,875 % fällig am 26.01.2028	2.200	2.192	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 4,250 % fällig am 19.06.2024	2.100	2.079
SK Hynix, Inc. 6,375 % fällig am 17.01.2028	2.200	2.189	Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd. 4,250 % fällig am 27.07.2027	2.000	1.939
Standard Chartered PLC 7,750 % fällig am 15.08.2027	2.100	2.110	Adaro Indonesia PT 4,250 % fällig am 31.10.2024	1.900	1.834
Vietnam Government International Bond 5,500 % fällig am 12.03.2028	2.000	1.940	LG Chem Ltd. 2,375 % fällig am 07.07.2023	2.000	1.652
Adaro Indonesia PT 4,250 % fällig am 31.10.2024	1.900	1.834	GC Treasury Center Co. Ltd. 2,980 % fällig am 18.03.2031	1.900	1.544
Melco Resorts Finance Ltd. 5,750 % fällig am 21.07.2028	2.100	1.759	Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 15.01.2026	1.600	1.465

(a) Der Asia Strategic Interest Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Capital Securities Fund 30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
Credit Agricole S.A. 7,250 % fällig am 23.09.2028	€ 117.500	\$ 125.610	HSBC Holdings PLC 4,750 % fällig am 04.07.2029	€ 83.102	\$ 78.626
Lloyds Banking Group PLC 8,500 % fällig am 27.03.2028	£ 54.000	66.135	BNP Paribas S.A. 7,000 % fällig am 16.08.2028	\$ 56.700	55.964
Barclays PLC 9,250 % fällig am 15.09.2028	49.500	59.529	CaixaBank S.A. 5,250 % fällig am 23.03.2026	€ 54.000	51.184
ING Groep NV 7,500 % fällig am 16.05.2028	\$ 56.400	55.970	Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027	45.300	47.981
HSBC Holdings PLC 8,000 % fällig am 07.03.2028	54.700	54.194	Societe Generale S.A. 6,221 % fällig am 15.06.2033	\$ 49.800	47.552
Intesa Sanpaolo SpA 7,778 % fällig am 20.06.2054	48.400	48.400	Barclays PLC 8,875 % fällig am 15.09.2027	£ 36.200	40.562
Deutsche Bank AG 7,079 % fällig am 10.02.2034	46.371	46.326	Societe Generale S.A. 6,750 % fällig am 06.04.2028	\$ 44.300	38.270
Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % fällig am 24.06.2024	£ 36.675	42.698	Deutsche Bank AG 3,742 % fällig am 07.01.2033	49.100	38.161
HSBC Holdings PLC 6,000 % fällig am 29.09.2023	€ 36.831	39.440	RCI Banque S.A. 2,625 % fällig am 18.02.2030	€ 36.500	36.562
Lloyds Banking Group PLC 8,000 % fällig am 27.09.2029	\$ 43.280	37.626	ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026	\$ 39.300	35.228
Svenska Handelsbanken AB 4,375 % fällig am 01.03.2027	44.600	37.295	Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.03.2029	40.000	34.259
Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034	36.200	37.133	Barclays PLC 9,250 % fällig am 15.09.2028	£ 30.000	33.921
CaixaBank S.A. 8,250 % fällig am 13.03.2029	€ 29.600	31.588	Barclays PLC 6,375 % fällig am 15.12.2025	30.764	32.967
Svenska Handelsbanken AB 4,750 % fällig am 01.03.2031	\$ 35.800	29.312	Electricite de France S.A. 2,875 % fällig am 15.12.2026	€ 33.600	30.259
Electricite de France S.A. 9,125 % fällig am 15.03.2033	23.800	24.201	Abertis Infraestructuras Finance BV 2,625 % fällig am 26.01.2027	35.800	30.190
Societe Generale S.A. 7,875 % fällig am 18.12.2023	23.600	23.549	Deutsche Bank AG 4,500 % fällig am 30.11.2026	39.400	30.073
Morgan Stanley 5,948 % fällig am 19.01.2038	23.400	23.400	Barclays PLC 6,125 % fällig am 15.12.2025	\$ 35.300	29.859
Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.06.2024	23.350	23.199	BNP Paribas S.A. 6,875 % fällig am 06.12.2029	€ 27.400	28.694
BNP Paribas S.A. 7,375 % fällig am 11.06.2030	€ 21.800	23.162	BNP Paribas S.A. 9,250 % fällig am 17.11.2027	\$ 24.300	26.298
NatWest Group PLC 6,000 % fällig am 29.12.2025	\$ 24.300	22.097	UBS Group AG 4,194 % fällig am 01.04.2031	32.900	26.172
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 8,375 % fällig am 21.06.2028	€ 20.200	21.821	Legal & General Group PLC 5,625 % fällig am 24.03.2031	£ 26.300	26.142
Societe Generale S.A. 7,875 % fällig am 18.12.2023	19.400	20.862	UBS Group AG 7,000 % fällig am 31.01.2024	\$ 24.958	24.958
HSBC Holdings PLC 6,161 % fällig am 09.03.2029	\$ 20.000	20.000	NatWest Group PLC 7,416 % fällig am 06.06.2033	£ 17.500	22.490
NatWest Group PLC 4,600 % fällig am 28.06.2031	25.000	19.679	Erste Group Bank AG 4,250 % fällig am 15.10.2027	€ 26.800	22.307
BNP Paribas S.A. 9,250 % fällig am 17.11.2027	18.000	19.404	Banco Mercantil del Norte S.A. 8,375 % fällig am 14.10.2030	\$ 23.900	21.730
BNP Paribas S.A. 7,750 % fällig am 16.08.2029	19.665	19.238	Deutsche Bank AG 7,079 % fällig am 10.02.2034	23.186	21.308
HSBC Holdings PLC 6,000 % fällig am 22.05.2027	19.300	17.225	Lloyds Banking Group PLC 8,500 % fällig am 27.03.2028	£ 18.100	21.144
Credit Agricole S.A. 7,875 % fällig am 23.01.2024	17.200	17.137	UBS Group AG 4,375 % fällig am 10.02.2031	\$ 25.200	20.339
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % fällig am 21.11.2033	16.000	16.511	Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032	26.875	20.232
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033	16.200	16.200	NatWest Group PLC 4,600 % fällig am 28.06.2031	27.100	19.749
Lloyds Banking Group PLC 7,875 % fällig am 27.06.2029	£ 14.041	16.183	Swedbank AB 4,000 % fällig am 17.03.2029	26.000	19.284
de Volksbank NV 7,000 % fällig am 15.12.2027	€ 16.000	16.129	HSBC Holdings PLC 8,000 % fällig am 07.03.2028	19.300	19.141
Deutsche Bank AG 5,000 % fällig am 05.09.2030	15.800	15.913			
Lloyds Banking Group PLC 7,500 % fällig am 27.06.2024	\$ 15.800	15.682			
ING Groep NV 3,875 % fällig am 16.05.2027	22.158	15.644			
Lloyds Banking Group PLC 4,947 % fällig am 27.06.2025	€ 14.982	15.384			

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Climate Bond Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
Europäische Investitionsbank 3,750 % fällig am 14.02.2033	\$ 5.000	\$ 4.974	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	\$ 7.490	\$ 6.751
Caja Rural de Navarra SCC 3,000 % fällig am 26.04.2027	€ 2.100	2.271	U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.01.2025	3.600	3.378
Nordea Bank Abp 6,000 % fällig am 02.06.2026	£ 1.800	2.236	Dominion Energy, Inc. 2,250 % fällig am 15.08.2031	2.350	1.944
Hyundai Capital America 5,800 % fällig am 26.06.2025	\$ 2.200	2.197	DTE Electric Co. 1,900 % fällig am 01.04.2028	2.200	1.936
TDC Net A/S 5,618 % fällig am 06.02.2030	€ 1.900	2.071	Liberty Utilities Finance GP 2,050 % fällig am 15.09.2030	2.475	1.911
PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % fällig am 26.01.2027	\$ 2.000	2.000	Avangrid, Inc. 3,800 % fällig am 01.06.2029	1.965	1.827
DNB Bank ASA 3,625 % fällig am 16.02.2027	€ 1.700	1.825	Public Service Co. of Oklahoma 2,200 % fällig am 15.08.2031	2.050	1.674
Regie Autonome des Transports Parisiens 3,250 % fällig am 11.04.2033	1.400	1.523	Assicurazioni Generali SpA 4,125 % fällig am 04.05.2026	€ 1.400	1.535
Bank of America Corp. 4,134 % fällig am 12.06.2028	1.400	1.500	Forvia 2,375 % fällig am 15.06.2029	1.500	1.296
AIB Group PLC 4,625 % fällig am 23.07.2029	1.300	1.403	Verallia S.A. 1,625 % fällig am 14.05.2028	1.300	1.193
Schneider Electric SE 3,250 % fällig am 12.06.2028	1.200	1.276	Bank of Ireland Group PLC 4,875 % fällig am 16.07.2028	1.100	1.185
Bank of Ireland Group PLC 4,875 % fällig am 16.07.2028	1.100	1.176	AES Corp. 1,375 % fällig am 15.01.2026	\$ 1.300	1.168
Public Service Electric & Gas Co. 4,650 % fällig am 15.03.2033	\$ 1.100	1.099	NXP BV 5,000 % fällig am 15.01.2033	1.100	1.086
SCE Recovery Funding LLC 5,112 % fällig am 14.12.2049	1.000	1.000	Valeo S.A. 1,000 % fällig am 03.08.2028	€ 1.200	1.032
United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053	£ 800	995	SCE Recovery Funding LLC 5,112 % fällig am 14.12.2049	\$ 1.000	985
Nederlandse Waterschapsbank NV 3,000 % fällig am 20.04.2033	€ 900	987	Public Service Co. of Colorado 3,700 % fällig am 15.06.2028	1.000	960
Alexandria Real Estate Equities, Inc. 2,000 % fällig am 18.05.2032	\$ 1.200	930	Enel Finance International NV 0,875 % fällig am 28.09.2034	€ 1.300	959
Societe Nationale SNCF S.A. 3,375 % fällig am 25.05.2033	€ 800	876	Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032	\$ 1.300	953
Export-Import Bank of Korea 5,125 % fällig am 11.01.2033	\$ 850	847	Vesteda Finance BV 0,750 % fällig am 18.10.2031	€ 1.200	949
Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048	800	800	Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	£ 800	909
Comcast Corp. 4,650 % fällig am 15.02.2033	800	799	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024	\$ 900	893
Ford Motor Credit Co. LLC 6,800 % fällig am 12.05.2028	800	799	Export-Import Bank of Korea 5,125 % fällig am 11.01.2033	850	890
Danske Bank A/S 4,750 % fällig am 21.06.2030	€ 700	758	Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	€ 1.100	881
Commerzbank AG 3,375 % fällig am 12.12.2025	700	749	ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig am 13.12.2029	\$ 1.000	841
Instituto de Credito Oficial 3,050 % fällig am 31.10.2027	700	748	CaixaBank S.A. 0,750 % fällig am 26.05.2028	€ 900	839
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 5,520 % fällig am 22.02.2055	\$ 700	700	Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048	\$ 800	835
AES Corp. 5,450 % fällig am 01.06.2028	700	700	Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,125 % fällig am 15.06.2028	900	810
SK Hynix, Inc. 6,375 % fällig am 17.01.2028	700	697	Comcast Corp. 4,650 % fällig am 15.02.2033	800	784
Hong Kong Government International Bond 5,250 % fällig am 11.01.2053	700	693	Suez SACA 4,625 % fällig am 03.11.2028	€ 700	768
Deutsche Bahn Finance GmbH 3,250 % fällig am 19.05.2033	€ 600	648	Instituto de Credito Oficial 3,050 % fällig am 31.10.2027	700	744
UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S 3,750 % fällig am 20.06.2028	600	645	Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	\$ 800	664
UniCredit Bank Austria AG 3,125 % fällig am 21.09.2029	600	640	Verizon Communications, Inc. 2,850 % fällig am 03.09.2041	900	622
CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % fällig am 01.04.2053	\$ 600	600	Leeward Renewable Energy Operations LLC 4,250 % fällig am 01.07.2029	700	610
Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % fällig am 01.04.2033	600	599	SBB Treasury Oyj 1,125 % fällig am 26.11.2029	€ 900	565
Land Securities Capital Markets PLC 4,875 % fällig am 15.09.2034	£ 500	586			
MidAmerican Energy Co. 3,650 % fällig am 01.08.2048	\$ 750	578			

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

## Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Commodity Real Return Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$ 67.092	\$ 68.212	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	\$ 108.835	\$ 107.256
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)	32.610	31.392	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2026 (b)	70.611	67.130
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	22.989	22.028	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	51.791	50.150
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)	13.843	13.229	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	38.784	38.146
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 8.161	10.368	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)	36.646	35.028
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025	€ 4.584	4.796	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	33.655	33.338
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	\$ 2.121	2.109	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	22.925	22.077
UBS Group AG 4,177 % fällig am 16.01.2026	€ 400	394	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	20.504	20.005
	<b>AKTIEN</b>		U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	19.256	18.236
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	246	2	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)	19.151	18.038
			United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£ 12.796	15.454
			U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	\$ 15.727	15.124
			U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	13.946	13.850
			Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 113.300	12.252
			Carbone CLO Ltd. 6,390 % fällig am 20.01.2031	\$ 4.576	4.535
			Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 42.900	4.471
			Madison Park Funding Ltd. 6,010 % fällig am 15.04.2029	\$ 4.483	4.441
			Ares European CLO DAC 3,957 % fällig am 15.10.2031	€ 4.000	4.309
			Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 40.200	4.307
			Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,073 % fällig am 15.11.2031	€ 3.850	4.043

(a) Der Commodity Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 29.02.2028	\$ 15.000	\$ 14.888	U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 29.02.2028	\$ 15.000	\$ 15.246
U.S. Treasury Notes 0,500 % fällig am 31.10.2027	9.900	8.560			
	<b>AKTIEN</b>		<b>AKTIEN</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	550.196	5.479	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	542.276	5.400
	<b>PAR (000S)</b>		<b>PAR (000S)</b>		
AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % fällig am 14.08.2024	\$ 1.150	1.102	U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 31.08.2027	\$ 3.825	3.727
Mattel, Inc. 3,375 % fällig am 01.04.2026	900	828	Netflix, Inc. 5,375 % fällig am 15.11.2029	1.300	1.319
Station Casinos LLC 4,625 % fällig am 01.12.2031	700	585	Crown Castle, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2031	1.200	1.001
Altice France S.A. 5,125 % fällig am 15.07.2029	725	525	Buckeye Partners LP 1,000 % fällig am 01.11.2026	986	986
Caesars Entertainment, Inc. 7,000 % fällig am 15.02.2030	500	500	Citigroup, Inc. 6,270 % fällig am 17.11.2033	900	972
Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034	500	499	USI, Inc. 1,000 % fällig am 02.12.2026	970	970
Vornado Realty LP 2,150 % fällig am 01.06.2026	600	491	Air Canada 3,875 % fällig am 15.08.2026	1.025	923
Weatherford International Ltd. 6,500 % fällig am 15.09.2028	400	402	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % fällig am 16.11.2025	936	876
Credit Suisse AG 4,713 % fällig am 31.05.2024	€ 400	400	Goldman Sachs Group, Inc. 4,482 % fällig am 23.08.2028	900	869
Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,450 % fällig am 15.09.2028	\$ 500	394	Citigroup, Inc. 3,785 % fällig am 17.03.2033	900	804
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 400	362	DAE Funding LLC 1,550 % fällig am 01.08.2024	800	751
Occidental Petroleum Corp. 7,500 % fällig am 01.05.2031	\$ 300	328	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.08.2032	800	749
Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029	322	310	LeasePlan Corp. NV 7,375 % fällig am 29.05.2024	€ 700	739
EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 400	309	Sprint LLC 7,875 % fällig am 15.09.2023	\$ 600	604
Transocean Titan Financing Ltd. 8,375 % fällig am 01.02.2028	\$ 300	306	VeriSign, Inc. 2,700 % fällig am 15.06.2031	700	582
Philip Morris International, Inc. 5,375 % fällig am 15.02.2033	300	304	White Cap Parent LLC (8,250 % bar oder 9,000 % PIK) 8,250 % fällig am 15.03.2026	550	506
Valaris Ltd. 8,375 % fällig am 30.04.2030	300	301	Manitowoc Co, Inc. 9,000 % fällig am 01.04.2026	500	503
			Service Properties Trust 7,500 % fällig am 15.09.2025	500	493

(a) Der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	24.229.226	\$ 241.268	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	29.327.235	\$ 292.033
	<b>PAR (000S)</b>			<b>PAR (000S)</b>	
Saudi Arabia Government International Bond 3,450 % fällig am 02.02.2061	\$ 34.500	24.317	Setanta Aircraft Leasing DAC 7,538 % fällig am 05.11.2028	\$ 48.800	48.721
Occidental Petroleum Corp. 6,625 % fällig am 01.09.2030	20.900	22.475		<b>AKTIEN</b>	
Verizon Communications, Inc. 2,355 % fällig am 15.03.2032	26.800	21.956	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (a)	3.637.652	40.252
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % fällig am 01.06.2031	21.725	21.725		<b>PAR (000S)</b>	
Netflix, Inc. 4,875 % fällig am 15.06.2030	21.000	20.854	Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023	\$ 38.200	36.947
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	20.000	20.272	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	35.400	32.304
Saudi Arabia Government International Bond 5,000 % fällig am 18.01.2053	20.000	19.153	Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026	€ 28.500	27.691
Peru Government International Bond 8,750 % fällig am 21.11.2033	15.000	19.142	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % fällig am 22.06.2026	\$ 27.523	27.488
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	18.775	18.775	HSBC Holdings PLC 4,300 % fällig am 08.03.2026	26.700	26.026
Romania Government International Bond 6,625 % fällig am 27.09.2029	€ 14.500	16.268	Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 20.01.2027	€ 27.500	25.884
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035	\$ 15.300	16.034	WP/AP Telecom Holdings BV 7,498 % fällig am 30.03.2029	23.100	24.827
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6,150 % fällig am 21.05.2048	15.000	15.142	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	32.900	24.765
Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032	12.000	14.799	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 23.400	23.734
South Africa Government International Bond 5,650 % fällig am 27.09.2047	13.700	10.553	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024	\$ 22.800	22.581
Boeing Co. 5,930 % fällig am 01.05.2060	10.000	10.213	Ziggo BV 1,000 % fällig am 31.01.2029	€ 19.560	19.917
Mexico Government International Bond 5,750 % fällig am 12.10.2110	10.000	9.486	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875 % fällig am 31.03.2028	19.200	18.661
Serbia Government International Bond 6,500 % fällig am 26.09.2033	9.400	9.450	Casino Guichard-Perrachon S.A. 7,108 % fällig am 31.08.2025	22.500	18.351
AT&T, Inc. 3,800 % fällig am 01.12.2057	12.200	9.177	ZF Finance GmbH 3,750 % fällig am 21.09.2028	18.400	17.424
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030	8.800	8.800	HSBC Holdings PLC 3,900 % fällig am 25.05.2026	\$ 15.900	15.247
Project Mercury 0,000 % fällig am 17.07.2030	€ 8.000	8.623	Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	€ 18.100	14.863
Option One Mortgage Loan Trust 5,430 % fällig am 25.07.2036	\$ 14.010	8.194	BNP Paribas S.A. 4,705 % fällig am 10.01.2025	\$ 14.400	14.256
			Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % fällig am 24.06.2024	£ 12.100	14.136
			Deutsche Bank AG 1,750 % fällig am 19.11.2030	€ 15.700	13.629
			Lloyds Banking Group PLC 4,450 % fällig am 08.05.2025	\$ 13.151	12.840
			Petroleos Mexicanos 6,700 % fällig am 16.02.2032	16.100	12.828
			INEOS Finance PLC 6,168 % fällig am 08.11.2028	€ 12.100	12.399
			Credit Agricole S.A. 1,907 % fällig am 16.06.2026	\$ 13.350	12.267

(a) Der Diversified Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023			VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	671.735 \$	6.689	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	1.241.436 \$	12.362
	PAR (000S)			PAR (000S)	
Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028	\$ 2.800	2.794	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % fällig am 22.06.2026	\$ 4.185	4.180
Ivory Coast Government International Bond 5,750 % fällig am 31.12.2032	2.985	2.746	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	3.500	3.177
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	2.500	2.521	Deutsche Bank AG 1,750 % fällig am 19.11.2030	€ 3.600	3.176
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	2.200	2.200	ZF Finance GmbH 3,750 % fällig am 21.09.2028	3.100	2.934
Romania Government International Bond 5,000 % fällig am 27.09.2026	€ 2.000	2.190	CommScope, Inc. 4,750 % fällig am 01.09.2029	\$ 3.600	2.920
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 18.01.2028	\$ 2.000	1.993	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 2.600	2.736
Gaci First Investment Co. 4,750 % fällig am 14.02.2030	2.000	1.979	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % fällig am 28.04.2025	2.700	2.709
Occidental Petroleum Corp. 7,875 % fällig am 15.09.2031	1.700	1.936	CGG S.A. 8,750 % fällig am 01.04.2027	\$ 2.800	2.417
Verizon Communications, Inc. 2,355 % fällig am 15.03.2032	2.200	1.802	Altice Financing S.A. 5,750 % fällig am 15.08.2029	3.000	2.370
Sprint Capital Corp. 6,875 % fällig am 15.11.2028	1.385	1.495	Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023	2.400	2.320
Netflix, Inc. 4,875 % fällig am 15.06.2030	1.400	1.391	UniCredit SpA 7,830 % fällig am 04.12.2023	2.200	2.240
Peru Government International Bond 8,750 % fällig am 21.11.2033	1.000	1.276	Casino Guichard-Perrachon S.A. 7,108 % fällig am 31.08.2025	€ 2.600	2.190
Mexico Government International Bond 3,771 % fällig am 24.05.2061	1.600	1.107	Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 18.01.2028	\$ 2.000	2.020
Greensaif Pipelines Bidco SARL 6,129 % fällig am 23.02.2038	1.100	1.100	Deutsche Bank AG 3,547 % fällig am 18.09.2031	2.100	1.777
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 5,520 % fällig am 25.02.2037	2.512	1.091	Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026	€ 1.800	1.735
Saudi Arabia Government International Bond 4,500 % fällig am 26.10.2046	1.200	1.084	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 1.700	1.721
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6,150 % fällig am 21.05.2048	1.000	1.011	Freedom Mortgage Corp. 7,625 % fällig am 01.05.2026	\$ 2.100	1.676
Serbia Government International Bond 6,500 % fällig am 26.09.2033	1.000	1.006	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 2.000	1.542
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030	1.000	1.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 4,500 % fällig am 01.03.2025	1.400	1.470
HCA, Inc. 5,500 % fällig am 01.06.2033	1.000	999	Deutsche Bank AG 5,882 % fällig am 08.07.2031	\$ 1.700	1.468
Saudi Arabia Government International Bond 3,450 % fällig am 02.02.2061	1.400	963	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875 % fällig am 31.03.2028	€ 1.500	1.441
South Africa Government International Bond 5,650 % fällig am 27.09.2047	1.200	924	Tierra Mojada Luxembourg SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040	\$ 1.663	1.432
WMG Acquisition Corp. 3,000 % fällig am 15.02.2031	1.100	920	Plains All American Pipeline LP 4,900 % fällig am 15.02.2045	1.700	1.366
Philippines Government International Bond 5,000 % fällig am 17.07.2033	800	800	Level 3 Financing, Inc. 6,967 % fällig am 01.03.2027	1.600	1.320
Charter Communications Operating LLC 3,850 % fällig am 01.04.2061	1.200	759	Nakilat, Inc. 6,067 % fällig am 31.12.2033	1.159	1.214
Occidental Petroleum Corp. 6,625 % fällig am 01.09.2030	700	754	IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026	€ 1.200	1.127
Gaci First Investment Co. 5,125 % fällig am 14.02.2053	800	730	Marks & Spencer PLC 4,500 % fällig am 10.07.2027	£ 1.000	1.119
Crown Castle, Inc. 5,000 % fällig am 11.01.2028	700	705	Jaguar Land Rover Automotive PLC 5,875 % fällig am 15.11.2024	€ 1.000	1.012
PRA Group, Inc. 8,375 % fällig am 01.02.2028	700	700	Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % fällig am 24.06.2024	£ 800	934
Sirius XM Radio, Inc. 4,125 % fällig am 01.07.2030	800	697	Wynn Resorts Finance LLC 5,125 % fällig am 01.10.2029	\$ 1.000	915
DISH Network Corp. 11,750 % fällig am 15.11.2027	675	689	WP/AP Telecom Holdings BV 7,498 % fällig am 30.03.2029	€ 800	864
Crown Castle, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2031	800	667	Petroleos Mexicanos 7,690 % fällig am 23.01.2050	\$ 1.200	853
Nokia Oyj 6,625 % fällig am 15.05.2039	600	621			

(a) Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income ESG Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Emerging Markets Bond ESG Fund (a)	426.683	\$ 4.337	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Emerging Markets Bond ESG Fund (a)	81.957	\$ 833
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Investment Grade Credit ESG Fund (a)	147.887	1.485		PAR (000S)	
	PAR (000S)		BNP Paribas S.A.		
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.04.2053	\$ 1.000	993	1,675 % fällig am 30.06.2027	\$ 400	355
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053	912	919	Uruguay Government International Bond 5,100 % fällig am 18.06.2050	300	306
Uruguay Government International Bond 5,100 % fällig am 18.06.2050	700	720	KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029	300	301
Panama Government International Bond 6,700 % fällig am 26.01.2036	600	648	Dominican Republic Government International Bond 4,500 % fällig am 30.01.2030	300	265
Bank of America Corp. 6,204 % fällig am 10.11.2028	600	627	Peru Government International Bond 3,000 % fällig am 15.01.2034	300	250
Dominican Republic Government International Bond 4,500 % fällig am 30.01.2030	600	530	Brazil Government International Bond 4,750 % fällig am 14.01.2050	300	219
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % fällig am 06.06.2032	500	509	Panama Government International Bond 4,500 % fällig am 19.01.2063	300	219
JPMorgan Chase & Co. 2,580 % fällig am 22.04.2032	600	504	Oman Government International Bond 6,000 % fällig am 01.08.2029	200	206
Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032	400	492	Oman Government International Bond 6,750 % fällig am 17.01.2048	200	199
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034	500	487	Mexico Government International Bond 5,750 % fällig am 12.10.2110	225	198
Mexico Government International Bond 4,875 % fällig am 19.05.2033	500	485	Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034	200	190
Peru Government International Bond 3,000 % fällig am 15.01.2034	500	418	Ivory Coast Government International Bond 6,125 % fällig am 15.06.2033	200	180
Amgen, Inc. 3,000 % fällig am 22.02.2029	450	417	Natura Cosmetics S.A. 4,125 % fällig am 03.05.2028	200	162
WMG Acquisition Corp. 2,250 % fällig am 15.08.2031	€ 400	345	Chile Government International Bond 3,100 % fällig am 07.05.2041	200	153
Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	\$ 400	343	Morocco Government International Bond 4,000 % fällig am 15.12.2050	200	138
SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	400	342	MPT Operating Partnership LP 3,500 % fällig am 15.03.2031	200	137
Air Canada Pass-Through Trust 5,250 % fällig am 01.10.2030	343	335	ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	125	119
IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2028	€ 350	334	Argentina Government International Bond 1,500 % fällig am 09.07.2035	500	112
			TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028	€ 100	108
			Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 100	101
			ING Groep NV 1,125 % fällig am 07.12.2028	100	99
			Verallia S.A. 1,625 % fällig am 14.05.2028	€ 100	97
			IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2028	100	95
			Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	100	94
			Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025	\$ 100	93
			HSBC Holdings PLC 3,973 % fällig am 22.05.2030	100	92
			G City Europe Ltd. 4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 100	92
			Altice Financing S.A. 4,250 % fällig am 15.08.2029	100	91
			Banco BTG Pactual S.A. 2,750 % fällig am 11.01.2026	\$ 100	91
			Dominican Republic Government International Bond 6,500 % fällig am 15.02.2048	100	89
			Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % fällig am 14.01.2029	100	87
			Dana, Inc. 4,250 % fällig am 01.09.2030	100	84
			Ivory Coast Government International Bond 6,625 % fällig am 22.03.2048	€ 100	80
			Colombia Government International Bond 5,000 % fällig am 15.06.2045	\$ 100	71
			Microsoft Corp. 2,675 % fällig am 01.06.2060	100	70

(a) Der Diversified Income ESG Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Dynamic Bond Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		6.757.953	\$ 67.295	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		8.234.342	\$ 82.000
		<b>PAR (000S)</b>				<b>PAR (000S)</b>	
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF	12.975.000	37.913	Caesars Entertainment Corp. 8,452 % fällig am 06.02.2030	\$	5.500	5.486
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2023		12.927.000	37.254	Zayo Group Holdings, Inc. 8,217 % fällig am 09.03.2027		6.204	5.028
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€	23.400	24.989	Bank of America Corp. 4,125 % fällig am 22.01.2024		5.050	4.993
Stratton Mortgage Funding PLC 5,991 % fällig am 20.07.2060	£	10.705	11.546	<b>Nationwide Building Society</b>		<b>AKTIEN 31.186</b>	<b>4.794</b>
Caesars Entertainment Corp. 8,452 % fällig am 06.02.2030	\$	7.000	6.930			<b>PAR (000S)</b>	
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % fällig am 02.03.2026	€	6.500	6.888	U.S. Foods, Inc. 7,943 % fällig am 22.11.2028	\$	4.021	4.016
DISH Network Corp. 11,750 % fällig am 15.11.2027	\$	6.400	6.528	Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£	3.300	3.829
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030		4.800	4.800	Israel Government International Bond 2,750 % fällig am 03.07.2030	\$	4.000	3.640
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. 3,375 % fällig am 24.07.2024		5.000	4.625	Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060		4.600	3.611
Resloc UK PLC 3,776 % fällig am 15.12.2043	€	4.756	4.139	Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	12.900	3.105
HSBC Holdings PLC 6,254 % fällig am 09.03.2034	\$	3.800	3.800	Hamburg Commercial Bank AG 0,500 % fällig am 22.09.2026	€	2.800	2.720
Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % fällig am 15.01.2033		3.800	3.790	Organon & Co. 8,250 % fällig am 02.06.2028	\$	2.543	2.536
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035		3.700	3.686	Morgan Stanley 3,875 % fällig am 29.04.2024		2.575	2.530
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % fällig am 06.04.2026	€	3.300	3.574	Imperial Brands Finance PLC 2,125 % fällig am 12.02.2027	€	2.500	2.529
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. 3,100 % fällig am 02.02.2031	\$	5.000	3.400	HSBC Holdings PLC 3,356 % fällig am 18.05.2024	\$	2.300	2.303
Adler Financing SARL 12,500 % fällig am 30.06.2025	€	2.989	3.057	MPT Operating Partnership LP 2,500 % fällig am 24.03.2026	£	2.500	2.227
Trinity Square PLC 5,316 % fällig am 15.07.2059	£	2.153	2.608	Zayo Group Holdings, Inc. 1,000 % fällig am 09.03.2027	€	1.940	1.775
Canada Square Funding PLC 5,316 % fällig am 17.01.2059		2.380	2.574	Hilton Grand Vacations Borrower LLC 8,239 % fällig am 02.08.2028	\$	1.576	1.570
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,841 % fällig am 20.07.2045		2.049	2.481	Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % fällig am 15.03.2024		1.500	1.461
				Adient U.S. LLC 8,334 % fällig am 10.04.2028		1.016	1.016

(a) Der Dynamic Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023					VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	625	105.350.	\$	1.049.	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	49	91.645.4	\$	912
			PAR (000S)				PAR (000S)		
Thailand Government International Bond 2,350 % fällig am 17.06.2026	THB	762	3.247.	107	95.	Thailand Government International Bond 3,350 % fällig am 17.06.2033	THB	2.212.	68
							958		
Thailand Government International Bond 3,350 % fällig am 17.06.2033	608	2.281.	967	71.	Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 06.03.2025	MXN	1.173.		61
							200		
Thailand Government International Bond 2,650 % fällig am 17.06.2028	201	2.263.	815	67.	Malaysia Government Investment Issue 3,990 % fällig am 15.10.2025	MYR	267.		61
							690		
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 6,000 % fällig am 01.04.2033	CLP	000	46.955.	421	60.	Indonesia Government International Bond 7,000 % fällig am 15.02.2033	IDR	681.081.	47
							000		
Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 06.03.2025	MXN	200	1.173.	775	56.	Romania Government International Bond 4,500 % fällig am 17.06.2024	RON	212.	45
							500		
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	000	962.	705	55.	Thailand Government International Bond 3,390 % fällig am 17.06.2037	THB	1.344.	42
							200		
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	300	194.	760	52.	Thailand Government International Bond 2,350 % fällig am 17.06.2026		1.376.	40
							638		
Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR	968	217.	095	51.	China Government International Bond 3,030 % fällig am 11.03.2026	CNY	245.	35
							690		
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF	000	16.383.	871	47.	Colombian TES 9,250 % fällig am 28.05.2042	COP	179.039.	31
							600		
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2023	000	16.323.	041	47.	Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	500	113.676.	27	
China Government International Bond 2,620 % fällig am 25.09.2029	CNY	300	308.	982	42.	Colombian TES 3,750 % fällig am 25.02.2037	368	122.979.	22
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN	200	150.	761	41.	South Africa Government International Bond 6,500 % fällig am 28.02.2041	ZAR	607.	20
							449		
Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP	900	187.473.	527	40.	South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	900	399.	20
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	400	176.	834	37.	Colombian TES 2,250 % fällig am 18.04.2029	COP	98.665.	20
							684		
Indonesia Government International Bond 7,500 % fällig am 15.06.2035	IDR	000	483.620.	175	34.	Indonesia Government International Bond 7,500 % fällig am 15.06.2035	IDR	246.840.	18
							000		
Hungary Government International Bond 6,750 % fällig am 22.10.2028	HUF	600	11.684.	879	29.	Indonesia Government International Bond 7,125 % fällig am 15.06.2038	000	237.219.	15
Mexico Government International Bond 5,500 % fällig am 04.03.2027	MXN	000	616.	103	29.	Thailand Government International Bond 2,000 % fällig am 17.12.2031	THB	508.	14
							070		
China Government International Bond 2,600 % fällig am 01.09.2032	CNY	010	201.	869	27.	Malaysia Government International Bond 3,757 % fällig am 22.05.2040	MYR	64.	13
							468		
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP	500	1.634.	039	27.	China Government Bond 2,700 % fällig am 03.11.2026	CNY	96.	13
							600		

(a) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	KOSTEN (000S)		BESCHREIBUNG		PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>					<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>			
Thailand Government International Bond 2,350 % fällig am 17.06.2026	THB	10.109	\$ 296		South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	2.900	\$ 178
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	950	262		Romania Government International Bond 3,250 % fällig am 29.04.2024	RON	800	171
Poland Government International Bond 7,500 % fällig am 25.07.2028	PLN	800	198		Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.02.2023	ILS	500	148
Thailand Government International Bond 2,650 % fällig am 17.06.2028	THB	5.419	163		Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023		500	136
International Finance Corp. 8,000 % fällig am 09.10.2023	IDR	2.200.000	148		Thailand Government International Bond 3,390 % fällig am 17.06.2037	THB	3.900	125
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN	500	138		Poland Government International Bond 7,500 % fällig am 25.07.2028	PLN	500	119
Mexico Government International Bond 7,500 % fällig am 26.05.2033	MXN	2.800	131		South Africa Government International Bond 6,500 % fällig am 28.02.2041	ZAR	3.300	112
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 6,000 % fällig am 01.04.2033	CLP	100.000	129		Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	14.000	108
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 5,800 % fällig am 19.01.2028	ZAR	2.500	125		Europäische Investitionsbank 3,000 % fällig am 25.11.2029	PLN	500	99
Poland Government International Bond 6,000 % fällig am 25.10.2033	PLN	500	115		Thailand Government International Bond 3,350 % fällig am 17.06.2033	THB	2.510	80
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	14.000	110		Thailand Government International Bond 2,350 % fällig am 17.06.2026		2.690	79
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	500	107		Thailand Government International Bond 1,585 % fällig am 17.12.2035		2.920	73
Czech Republic Government International Bond 5,000 % fällig am 30.09.2030	CZK	2.200	105		Malaysia Government International Bond 3,582 % fällig am 15.07.2032	MYR	320	70
International Bank for Reconstruction & Development 8,500 % fällig am 06.04.2026	MXN	2.000	100		Colombian TES 3,750 % fällig am 25.02.2037	COP	366.443	69
Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.04.2032	IDR	1.467.000	99		Indonesia Government International Bond 7,000 % fällig am 15.02.2033	IDR	974.000	67
Europäische Investitionsbank 2,875 % fällig am 15.11.2029	PLN	500	98		Colombian TES 9,250 % fällig am 28.05.2042	COP	313.000	55
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	1.700	93		Peru Government International Bond 6,900 % fällig am 12.08.2037	PEN	200	50
Europäische Investitionsbank 3,000 % fällig am 25.11.2029	PLN	500	91		Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 30.01.2026	DOP	2.500	47
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP	5.300	88		Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR	198	47
Thailand Government International Bond 3,350 % fällig am 17.06.2033	THB	2.642	84		South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	700	42
International Bank for Reconstruction & Development 7,070 % fällig am 26.06.2029	MXN	1.400	70		Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.04.2042	IDR	610.000	40
Asian Development Bank 12,750 % fällig am 03.03.2025	COP	339.000	68		Malaysia Government International Bond 3,757 % fällig am 22.05.2040	MYR	188	40
Thailand Government International Bond 3,400 % fällig am 17.06.2036	THB	2.001	65		Colombian TES 2,250 % fällig am 18.04.2029	COP	169.408	34
Malaysia Government Investment Issue 4,193 % fällig am 07.10.2032	MYR	278	64		Thailand Government International Bond 2,650 % fällig am 17.06.2028	THB	1.070	32
Colombian TES 3,750 % fällig am 25.02.2037	COP	363.205	63		Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP	1.700	32
South Africa Government International Bond 9,000 % fällig am 31.01.2040	ZAR	1.400	61		Hungary Government International Bond 5,000 % fällig am 22.02.2027	€	30	32
Hungary Government International Bond 6,750 % fällig am 22.10.2028	HUF	22.800	60		Malaysia Government International Bond 4,696 % fällig am 15.10.2042	MYR	134	32
South Africa Government International Bond 8,750 % fällig am 31.01.2044	ZAR	1.400	59		Indonesia Government International Bond 7,500 % fällig am 15.06.2035	IDR	388.000	28
Colombian TES 9,250 % fällig am 28.05.2042	COP	313.000	51		Malaysia Government Investment Issue 3,990 % fällig am 15.10.2025	MYR	120	27
Malaysia Government Investment Issue 3,465 % fällig am 15.10.2030	MYR	230	51		Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	100	27
Peru Government International Bond 5,400 % fällig am 12.08.2034	PEN	200	48					
Thailand Government International Bond 2,000 % fällig am 17.12.2031	THB	1.520	45					
Dominican Republic Government International Bond 13,625 % fällig am 10.02.2034	DOP	2.000	44					
Malaysia Government International Bond 2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	210	44					

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN		KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN		ERLÖSE (000S)	
KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		85.561.931	\$	852.006	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	87.959.244	\$	875.900
		PAR (000S)				PAR (000S)		
U.S. Treasury Notes				CBB International Sukuk Programme Co.				
4,000 % fällig am 28.02.2030	\$	33.100		32.946	6,250 % fällig am 18.10.2030	\$	21.000	21.171
South Africa Government International Bond				28.930	Egypt Government International Bond			
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	484.900		28.065	4,750 % fällig am 16.04.2026	€	14.508	13.585
Saudi Arabia Government International Bond				27.504	Chile Government International Bond			
4,875 % fällig am 18.07.2033	\$	28.400		27.504	2,750 % fällig am 31.01.2027	\$	13.400	12.720
Saudi Arabia Government International Bond				22.992	Standard Chartered PLC			
4,750 % fällig am 18.01.2028		27.600		21.000	7,767 % fällig am 16.11.2028		11.200	11.943
Malaysia Government International Bond				16.400	Colombia Government International Bond			
3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	107.200		16.340	4,000 % fällig am 26.02.2024		12.100	11.933
CBB International Sukuk Programme Co.				15.749	Nigeria Government International Bond			
6,250 % fällig am 18.10.2030	\$	21.000		15.131	6,500 % fällig am 28.11.2027		13.000	11.306
Mexico Government International Bond				14.668	Nogaholding Sukuk Ltd.			
6,350 % fällig am 09.02.2035		16.400		14.614	6,625 % fällig am 25.05.2033		10.200	10.216
Nigeria Government International Bond				13.900	Serbia Government International Bond			
6,500 % fällig am 28.11.2027		18.844		13.779	6,250 % fällig am 26.05.2028		9.950	9.883
Hungarian Development Bank				13.327	Indonesia Government International Bond			
6,500 % fällig am 29.06.2028		15.300		13.300	4,850 % fällig am 11.01.2033		9.700	9.754
Ecopetrol S.A.				15.600	Hungary Government International Bond			
0,000 % fällig am 17.08.2024		15.200		13.900	5,000 % fällig am 22.02.2027	€	8.200	8.829
Peru Government International Bond				13.900	CK Hutchison International Ltd.			
6,550 % fällig am 14.03.2037		13.300		13.900	4,750 % fällig am 21.04.2028	\$	8.800	8.828
Gaci First Investment Co.				11.894	Mexico Government International Bond			
5,125 % fällig am 14.02.2053		15.600		11.583	4,280 % fällig am 14.08.2041		10.491	8.685
Nogaholding Sukuk Ltd.				11.158	Ivory Coast Government International Bond			
6,625 % fällig am 25.05.2033		13.900		10.813	5,750 % fällig am 31.12.2032		9.347	8.589
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik					CK Hutchison International Ltd.			
13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP	833.500			4,875 % fällig am 21.04.2033		8.400	8.432
Poland Government International Bond					Morocco Government International Bond			
4,875 % fällig am 04.10.2033	\$	13.400			6,500 % fällig am 08.09.2033		7.600	7.916
Turkey Government International Bond					Gaci First Investment Co.			
9,125 % fällig am 13.07.2030		12.000			5,375 % fällig am 13.10.2122		8.000	7.731
Israel Government International Bond					South Africa Government International Bond			
1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	41.700			4,850 % fällig am 30.09.2029		8.500	7.719
Dominican Republic Government International Bond					Hungary Government International Bond			
13,625 % fällig am 03.02.2033	DOP	631.800			6,750 % fällig am 25.09.2052		7.300	7.486
Dominican Republic Government International Bond					Petroleos Mexicanos			
13,625 % fällig am 10.02.2034		489.000			6,950 % fällig am 28.01.2060		9.800	6.630

(a) Der Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>				
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	324.500	\$	19.365
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	62.400		17.333
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	74.400		15.957
Hungary Government International Bond 6,750 % fällig am 25.09.2052	\$	16.600		15.891
Mexico Government International Bond 4,875 % fällig am 19.05.2033		15.800		15.097
Poland Government International Bond 4,875 % fällig am 04.10.2033		14.700		14.609
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035		14.000		13.948
Israel Government International Bond 4,500 % fällig am 17.01.2033		13.400		13.322
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034		12.510		12.418
OTP Bank Nyrt 8,750 % fällig am 15.05.2033		12.300		12.228
Finanzministerium der Regierung von Schardscha 6,500 % fällig am 23.11.2032		12.300		12.199
Uruguay Government International Bond 5,750 % fällig am 28.10.2034		11.200		12.168
Poland Government International Bond 5,500 % fällig am 04.04.2053		11.500		11.359
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP	685.100		11.321
Romania Government International Bond 7,625 % fällig am 17.01.2053	\$	11.100		11.040
Bulgaria Government International Bond 4,500 % fällig am 27.01.2033	€	10.400		10.988
Serbia Government International Bond 6,250 % fällig am 26.05.2028	\$	10.950		10.909
Hungarian Development Bank 6,500 % fällig am 29.06.2028		10.900		10.780
Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048		10.600		10.588
Serbia Government International Bond 6,500 % fällig am 26.09.2033		10.500		10.274
IHS Netherlands Holdco BV 8,000 % fällig am 18.09.2027		10.700		9.658
Poland Government International Bond 2,750 % fällig am 25.05.2032	€	9.100		8.906
Dominican Republic Government International Bond 13,625 % fällig am 03.02.2033	DOP	500.900		8.847
Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028	\$	8.700		8.683
Export-Import Bank of Korea 5,125 % fällig am 11.01.2033		8.400		8.366
Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033	€	11.300		8.340
Jordan Government International Bond 7,500 % fällig am 13.01.2029	\$	8.000		7.904
Magyar Export-Import Bank 6,125 % fällig am 04.12.2027		7.500		7.443
Indonesia Government International Bond 4,850 % fällig am 11.01.2033		7.400		7.257
Airport Authority Hong Kong 4,875 % fällig am 12.01.2030		7.200		7.155
North Macedonia Government International Bond 6,960 % fällig am 13.03.2027	€	6.700		7.085
Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375 % fällig am 22.05.2033	\$	7.000		6.983
First Abu Dhabi Bank PJSC 4,774 % fällig am 06.06.2028		6.500		6.500
Polaris PLC 6,141 % fällig am 23.05.2059	£	5.307		6.480
North Macedonia Government International Bond 5,625 % fällig am 26.07.2023	€	5.800		6.197
Hong Kong Government International Bond 4,625 % fällig am 11.01.2033	\$	6.200		6.177
Dominican Republic Government International Bond 13,625 % fällig am 10.02.2034	DOP	277.400		6.130
Costa Rica Government International Bond 6,550 % fällig am 03.04.2034	\$	6.000		6.000
Morocco Government International Bond 6,500 % fällig am 08.09.2033		5.900		5.855
Hong Kong Government International Bond 3,750 % fällig am 07.06.2032	€	5.500		5.821
Khazanah Global Sukuk Bhd. 4,687 % fällig am 01.06.2028	\$	5.800		5.800
Corp. Nacional del Cobre de Chile 5,125 % fällig am 02.02.2033		5.800		5.796
Hong Kong Government International Bond 4,500 % fällig am 11.01.2028		5.800		5.778

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>				
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	152.300	\$	40.645
Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023		79.600		21.341
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035	\$	14.000		14.659
South Africa Government International Bond 4,300 % fällig am 12.10.2028		14.500		13.268
Israel Government International Bond 4,500 % fällig am 17.01.2033		13.400		13.224
South Africa Government International Bond 5,875 % fällig am 20.04.2032		13.500		12.538
Chile Government International Bond 2,750 % fällig am 31.01.2027		12.900		12.245
OTP Bank Nyrt 8,750 % fällig am 15.05.2033		12.300		12.194
Hungary Government International Bond 5,000 % fällig am 22.02.2027	€	10.600		11.416
Serbia Government International Bond 6,250 % fällig am 26.05.2028	\$	10.950		10.915
Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A. 3,500 % fällig am 10.09.2051		13.700		9.575
Colombia Government International Bond 6,125 % fällig am 18.01.2041		11.400		8.922
Poland Government International Bond 2,750 % fällig am 25.05.2032	€	9.100		8.888
Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028	\$	8.700		8.829
Israel Government International Bond 4,250 % fällig am 31.03.2023	ILS	30.500		8.658
Uruguay Government International Bond 7,875 % fällig am 15.01.2033	\$	6.930		8.532
Egypt Government International Bond 5,250 % fällig am 06.10.2025		10.600		8.431
Ivory Coast Government International Bond 5,750 % fällig am 31.12.2032		8.942		8.222
Standard Chartered PLC 7,767 % fällig am 16.11.2028		7.600		8.104
Eastern & Southern African Trade & Development Bank 4,125 % fällig am 30.06.2028		9.900		7.884
Indonesia Government International Bond 4,850 % fällig am 11.01.2033		7.400		7.439
Banco do Brasil S.A. 3,250 % fällig am 30.09.2026		8.100		7.341
Mongolia Government International Bond 3,500 % fällig am 07.07.2027		8.600		7.046
Qatar Government International Bond 3,250 % fällig am 02.06.2026		7.000		6.759
Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % fällig am 03.05.2028		8.100		6.510
Philippines Government International Bond 3,200 % fällig am 06.07.2046		8.700		6.430
XP, Inc. 3,250 % fällig am 01.07.2026		7.400		6.377
Hong Kong Government International Bond 4,625 % fällig am 11.01.2033		6.200		6.319
Greenko Dutch BV 3,850 % fällig am 29.03.2026		6.956		6.266
Morocco Government International Bond 6,500 % fällig am 08.09.2033		5.900		5.922
Hong Kong Government International Bond 4,500 % fällig am 11.01.2028		5.800		5.834
Mexico Government International Bond 3,771 % fällig am 24.05.2061		8.200		5.520
Poland Government International Bond 5,500 % fällig am 16.11.2027		5.100		5.278

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.481.150	\$ 34.663	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.561.054	\$ 35.460
	PAR (000S)			PAR (000S)	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥ 430.000	3.373	Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS 6.000	1.650
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033	\$ 2.200	2.200	Bank Leumi Le-Israel B.M. 3,275 % fällig am 29.01.2031	\$ 1.800	1.631
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034	1.500	1.489	QNB Finance Ltd. 3,500 % fällig am 28.03.2024	1.548	1.524
KazMunayGas National Co. JSC 6,375 % fällig am 24.10.2048	1.500	1.277	Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034	1.500	1.433
Bank Hapoalim B.M. 3,255 % fällig am 21.01.2032	1.300	1.153	Mizrahi Tefahot Bank Ltd. 3,077 % fällig am 07.04.2031	1.300	1.167
Seazen Group Ltd. 4,450 % fällig am 13.07.2025	1.400	1.132	New Metro Global Ltd. 6,800 % fällig am 05.08.2023	1.100	1.055
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC 4,375 % fällig am 24.01.2029	1.100	1.093	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	968	973
Ecopetrol S.A. 0,000 % fällig am 17.08.2024	1.000	965	ABJA Investment Co. Pte. Ltd. 5,450 % fällig am 24.01.2028	1.000	962
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd. 3,750 % fällig am 27.07.2026	1.000	954	Bank Hapoalim B.M. 3,255 % fällig am 21.01.2032	1.100	923
NBK SPC Ltd. 1,625 % fällig am 15.09.2027	800	714	Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033	900	872
SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026	700	699	S.A. Global Sukuk Ltd. 2,694 % fällig am 17.06.2031	1.000	871
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 3,500 % fällig am 31.03.2027	700	665	Israel Electric Corp. Ltd. 3,750 % fällig am 22.02.2032	1.000	871
Melco Resorts Finance Ltd. 5,625 % fällig am 17.07.2027	700	641	Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS 2.700	752
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 5,950 % fällig am 17.07.2026	600	599	Xiaomi Best Time International Ltd. 2,875 % fällig am 14.07.2031	\$ 900	684
POSCO 5,750 % fällig am 17.01.2028	600	597	Bangkok Bank PCL 3,733 % fällig am 25.09.2034	800	678
Standard Chartered PLC 7,767 % fällig am 16.11.2028	500	547	POSCO 5,750 % fällig am 17.01.2028	600	618
Kasikornbank PCL 3,343 % fällig am 02.10.2031	600	532	Leviathan Bond Ltd. 6,125 % fällig am 30.06.2025	600	578
Greensaif Pipelines Bidco SARL 6,129 % fällig am 23.02.2038	500	500	Banco de Credito e Inversiones S.A. 3,500 % fällig am 12.10.2027	600	550
Sasol Financing USA LLC 8,750 % fällig am 03.05.2029	500	500	Studio City Finance Ltd. 6,500 % fällig am 15.01.2028	600	510

(a) Der Emerging Markets Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)		BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023					VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023					
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>					11.259.245	\$				112.116
			PAR (000S)						PAR (000S)	
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	33.800		9.363	Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 06.03.2025	MXN	182.400		8.865	
Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 06.03.2025	MXN	182.400		8.782	Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	\$	5.200		5.317	
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 6,000 % fällig am 01.04.2033	CLP	6.390.000		8.227	U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.08.2042		4.000		3.773	
U.S. Treasury Bonds 1,125 % fällig am 15.05.2040	\$	11.900		7.961	South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	75.100		3.715	
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	134.500		7.474	U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.02.2042	\$	4.300		3.458	
Poland Government International Bond 0,250 % fällig am 25.10.2026	PLN	33.200		5.997	Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN	11.000		2.997	
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	\$	5.200		5.139	Petroleos Mexicanos 6,500 % fällig am 02.06.2041	\$	4.000		2.466	
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP	269.700		4.461	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042		2.500		2.315	
U.S. Treasury Bonds 1,750 % fällig am 15.08.2041	\$	5.400		3.808	Tierra Mojada Luxembourg SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040		2.567		2.204	
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF	1.168.000		3.413	Philippines Government International Bond 5,000 % fällig am 17.07.2033		2.100		2.156	
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 27.04.2023		1.172.000		3.379	Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035		2.000		2.138	
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2023		1.164.000		3.355	Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028		2.000		2.063	
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	14.600		3.131	Airport Authority Hong Kong 4,875 % fällig am 12.01.2030		2.000		2.061	
Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 18.11.2038	MXN	46.000		2.545	Morocco Government International Bond 6,500 % fällig am 08.09.2033		2.000		2.060	
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	49.500		2.325	Colombian TES 3,750 % fällig am 25.02.2037	COP	11.447.877		2.047	
South Africa Government International Bond 6,500 % fällig am 28.02.2041		64.900		2.245	Standard Chartered PLC 6,170 % fällig am 09.01.2027	\$	2.000		2.025	
Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375 % fällig am 22.05.2033	\$	2.200		2.195	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	17.913		1.965	
Ungarische Entwicklungsbank 6,500 % fällig am 29.06.2028		2.200		2.176	Corsair International Ltd. 7,772 % fällig am 28.01.2027	€	1.700		1.828	
Philippines Government International Bond 5,000 % fällig am 17.07.2033		2.100		2.100	Khazanah Global Sukuk Bhd. 4,687 % fällig am 01.06.2028	\$	1.600		1.590	

(a) Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	350.000	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	350.000
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	5.400	Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.05.2023	ILS	1.600
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 27.04.2023	HUF	306.000	Export-Import Bank of Korea 4,890 % fällig am 09.08.2023	INR	26.600
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023		164.000	Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2023	PEN	900
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2023		163.000	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	3.600
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2023	PEN	1.300	Standard Chartered PLC 6,170 % fällig am 09.01.2027	\$	200
Export-Import Bank of Korea 4,890 % fällig am 09.08.2023	INR	26.600	Danske Bank A/S 6,466 % fällig am 09.01.2026		200
Mexico Government International Bond 7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN	4.900	Colombian TES 9,250 % fällig am 28.05.2042	COP	1.167.800
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033	\$	200	Gaci First Investment Co. 4,750 % fällig am 14.02.2030	\$	200
Danske Bank A/S 6,466 % fällig am 09.01.2026		200	Lloyds Banking Group PLC 4,716 % fällig am 11.08.2026		200
Standard Chartered PLC 6,170 % fällig am 09.01.2027		200	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026		200
Gaci First Investment Co. 4,750 % fällig am 14.02.2030		200	Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP	663.500
Ungarische Entwicklungsbank 6,500 % fällig am 29.06.2028		200	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	1.467
Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP	663.500		<b>AKTIEN</b>	
Dominican Republic Government International Bond 13,625 % fällig am 03.02.2033	DOP	8.000	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>		10.041
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	2.000	<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)</b>		1.000
				<b>PAR (000S)</b>	
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>		10.112	Leviathan Bond Ltd. 6,125 % fällig am 30.06.2025	\$	100
			Colombian TES 2,250 % fällig am 18.04.2029	COP	479.715
<b>Petroleos Mexicanos</b>			Nakilat, Inc. 6,067 % fällig am 31.12.2033	\$	89
10,000 % fällig am 07.02.2033	\$	100	Empresas Publicas de Medellin ESP 8,375 % fällig am 08.11.2027	COP	489.000
Malaysia Government Investment Issue 3,990 % fällig am 15.10.2025	MYR	400	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	589
Colombian TES 2,250 % fällig am 18.04.2029	COP	473.632			64

(a) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO ESG Income Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.06.2053	\$ 21.763	\$ 21.847	Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048	\$ 1.500	\$ 1.560
EMF-UK PLC 5,970 % fällig am 13.03.2046	£ 3.566	4.219	Viridis European Loan Conduit 5,724 % fällig am 22.07.2029	£ 900	1.095
TDC Net A/S 5,618 % fällig am 06.02.2030	€ 2.700	2.944	Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % fällig am 21.01.2032	\$ 950	841
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a)	\$ 2.547	2.455	Starwood Property Trust, Inc. 3,625 % fällig am 15.07.2026	680	585
Great Hall Mortgages PLC 5,282 % fällig am 18.06.2038	£ 2.040	2.387	Hong Kong Government International Bond 5,250 % fällig am 11.01.2053	500	546
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (a)	\$ 1.842	1.780	Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	630	538
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 4,459 % fällig am 25.01.2037	3.177	1.752	Verallia S.A. 1,625 % fällig am 14.05.2028	€ 500	487
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (a)	1.702	1.654	Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % fällig am 03.05.2028	\$ 600	482
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,161 % fällig am 20.10.2051	£ 1.300	1.540	Prosus NV 3,061 % fällig am 13.07.2031	600	469
Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048	\$ 1.500	1.500	Leeward Renewable Energy Operations LLC 4,250 % fällig am 01.07.2029	500	448
Verizon Communications, Inc. 5,050 % fällig am 09.05.2033	1.500	1.498	Verallia S.A. 1,875 % fällig am 10.11.2031	€ 500	447
Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % fällig am 01.04.2053	1.300	1.295	Transalta Corp. 7,750 % fällig am 15.11.2029	\$ 400	421
KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029	1.250	1.250	Nokia Oyj 3,125 % fällig am 15.05.2028	€ 400	419
Bridgeway Funding PLC 8,466 % fällig am 16.10.2062	£ 950	1.091	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023	400	414
245 Park Avenue Trust 3,779 % fällig am 05.06.2037	\$ 1.250	1.089	Radian Group, Inc. 6,625 % fällig am 15.03.2025	\$ 400	399
Bridgeway Funding PLC 9,466 % fällig am 16.10.2062	£ 950	1.087	Banco do Brasil S.A. 4,875 % fällig am 11.01.2029	400	377
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.12.2052	\$ 1.099	1.065	DaVita, Inc. 3,750 % fällig am 15.02.2031	400	323
Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034	1.000	1.004	Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 300	317
Amgen, Inc. 5,600 % fällig am 02.03.2043	900	895	Rexel S.A. 2,125 % fällig am 15.12.2028	300	287
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,475 % fällig am 22.02.2031	800	800	Owens Corning 3,950 % fällig am 15.08.2029	\$ 300	286
CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % fällig am 01.04.2053	800	799	Prosus NV 3,257 % fällig am 19.01.2027	300	274
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (a)	817	799	Starwood Property Trust, Inc. 4,375 % fällig am 15.01.2027	310	266
Intesa Sanpaolo SpA 6,625 % fällig am 31.05.2033	£ 600	735	Intesa Sanpaolo SpA 6,250 % fällig am 16.05.2024	€ 200	214
			Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	200	211
			Allegion U.S. Holding Co., Inc. 3,550 % fällig am 01.10.2027	\$ 200	190
			Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,125 % fällig am 15.06.2028	200	183
			NextEra Energy Operating Partners LP 3,875 % fällig am 15.10.2026	180	169
			Greenko Dutch BV 3,850 % fällig am 29.03.2026	188	169
			Greenko Power Ltd. 4,300 % fällig am 13.12.2028	191	165
			BNP Paribas S.A. 2,871 % fällig am 19.04.2032	200	164
			Owl Rock Capital Corp. 2,875 % fällig am 11.06.2028	200	164
			MPT Operating Partnership LP 3,375 % fällig am 24.04.2030	£ 200	150
			Fortune Brands Home & Security, Inc. 3,250 % fällig am 15.09.2029	\$ 150	133

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Bond Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	283.500	€ 27.505	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	833.400	€ 80.366
	PAR (000S)			PAR (000S)	
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	€ 17.900	17.327	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 392.712	37.100
Europäische Union 3,375 % fällig am 04.10.2038	14.820	14.748	Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	€ 17.900	16.736
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.10.2053	14.300	14.237	Europäische Union 0,250 % fällig am 22.04.2036	23.000	16.386
	AKTIEN			AKTIEN	
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	146.000	13.994	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	132.500	12.844
	PAR (000S)			PAR (000S)	
BMW Finance NV 3,609 % fällig am 09.12.2024	€ 10.400	10.400	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,150 % fällig am 01.09.2052	€ 19.000	12.014
Credit Mutuel Home Loan SFH S.A. 3,250 % fällig am 20.04.2029	9.700	9.669	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.06.2029	11.100	9.311
France Government International Bond 0,550 % fällig am 01.03.2039	8.710	8.585	France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2038	9.260	8.470
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 7.361	6.606	Citigroup, Inc. 4,412 % fällig am 31.03.2031	\$ 8.100	7.254
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	7.289	6.561	Spain Government International Bond 2,550 % fällig am 31.10.2032	€ 7.400	7.162
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	7.233	6.555	Credit Mutuel Home Loan SFH S.A. 3,250 % fällig am 20.04.2029	5.900	5.851
Spain Government International Bond 0,000 % fällig am 31.01.2028	€ 7.100	6.240	Spain Government International Bond 1,400 % fällig am 30.07.2028	6.000	5.517
UniCredit SpA 3,375 % fällig am 31.01.2027	6.000	5.983	Spain Government International Bond 0,000 % fällig am 31.01.2026	6.000	5.515
Europäische Union 2,750 % fällig am 05.10.2026	6.000	5.983	Electricite de France S.A. 2,625 % fällig am 01.12.2027	6.600	5.429
Hops Hill PLC 0,000 % fällig am 21.12.2055	£ 5.200	5.940	JAB Holdings BV 2,000 % fällig am 18.05.2028	5.100	4.667
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€ 5.700	5.700	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 47.800	4.595
Banco BPM SpA 3,750 % fällig am 27.06.2028	5.700	5.693	Spain Government International Bond 1,950 % fällig am 30.04.2026	€ 4.600	4.487
Harvest CLO DAC 3,907 % fällig am 15.10.2030	5.676	5.578	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 42.300	4.191
Pierpont BTL PLC 0,000 % fällig am 21.09.2054	£ 4.800	5.502	Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1,475 % fällig am 18.01.2031	€ 4.900	4.030
Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % fällig am 05.05.2026	\$ 6.000	5.439	Barclays PLC 2,885 % fällig am 31.01.2027	4.000	3.866
Red & Black Auto Lease France 4,093 % fällig am 27.06.2035	€ 5.400	5.400	Europäische Union 0,750 % fällig am 04.01.2047	6.100	3.628
Canada Square Funding PLC 5,316 % fällig am 17.01.2059	£ 4.582	5.313	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,800 % fällig am 01.03.2067	5.000	3.606
SCF Rahoituspalvelut DAC 4,020 % fällig am 25.06.2033	€ 5.300	5.300	Nexi SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026	3.797	3.484
Svensk Exportkredit AB 3,250 % fällig am 13.04.2026	5.300	5.299	Europäische Investitionsbank 0,250 % fällig am 20.01.2032	4.200	3.341
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,875 % fällig am 29.05.2026	5.200	5.182	Dexia Credit Local S.A. 0,500 % fällig am 17.01.2025	3.500	3.327
Ginkgo Sales Finance 4,113 % fällig am 25.11.2049	5.150	5.149	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2031	4.200	3.321
Royal Bank of Canada 3,607 % fällig am 17.01.2025	5.000	5.000			
Credit Mutuel Home Loan SFH S.A. 3,125 % fällig am 22.06.2027	4.900	4.888			
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 3,250 % fällig am 18.04.2028	4.700	4.680			
Twin Bridges PLC 5,715 % fällig am 12.03.2055	£ 4.031	4.662			
Spain Government International Bond 2,800 % fällig am 31.05.2026	€ 4.500	4.490			
Oak No. 4 PLC 0,000 % fällig am 26.02.2065	£ 3.850	4.436			
Europäische Union 2,625 % fällig am 04.02.2048	€ 4.700	4.133			
Revocar UG 4,032 % fällig am 21.04.2036	4.100	4.100			
Twin Bridges PLC 5,525 % fällig am 12.09.2055	£ 3.443	3.972			
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,841 % fällig am 20.07.2045	2.821	3.289			
Autonoria FCT 3,883 % fällig am 26.01.2043	€ 3.200	3.200			

(a) Der Euro Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Credit Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.10.2030	€ 15.400	€ 12.406	UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.04.2025	€ 8.400	€ 8.126
Europäische Investitionsbank 2,250 % fällig am 15.03.2030	12.800	12.294	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 78.904	7.577
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 3,000 % fällig am 15.12.2028	11.000	10.940	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	74.128	7.479
Europäische Investitionsbank 0,050 % fällig am 13.10.2034	12.700	9.141	Wells Fargo & Co. 1,000 % fällig am 02.02.2027	€ 7.600	6.804
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.02.2033	7.600	7.529	Nationwide Building Society 4,363 % fällig am 01.08.2024	\$ 6.800	6.300
Region of Ile de France 3,050 % fällig am 03.02.2033	7.200	7.183	UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.07.2025	€ 6.900	6.238
Romania Government International Bond 6,625 % fällig am 27.09.2029	6.400	6.606	Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig am 05.09.2027	5.300	5.178
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.11.2025	6.700	6.204	Cooperative Rabobank UA 4,000 % fällig am 10.01.2030	5.100	5.141
Europäische Union 1,500 % fällig am 04.10.2035	7.400	6.189	Barclays PLC 0,577 % fällig am 09.08.2029	6.400	5.126
Europäische Union 0,400 % fällig am 04.02.2037	8.900	6.130	Logicor Financing SARL 2,250 % fällig am 13.05.2025	5.500	5.039
Europäischer Stabilitätsmechanismus 0,750 % fällig am 15.03.2027	6.700	6.118	BNP Paribas S.A. 0,500 % fällig am 04.06.2026	5.400	5.021
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,250 % fällig am 24.05.2033	7.000	6.103	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 3,927 % fällig am 15.07.2030	4.887	4.810
Europäische Union 0,450 % fällig am 04.07.2041	9.700	6.092	NatWest Group PLC 2,000 % fällig am 04.03.2025	4.900	4.798
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 2,375 % fällig am 11.04.2028	6.300	6.091	Worldline S.A. 1,625 % fällig am 13.09.2024	4.800	4.645
Europäische Investitionsbank 0,250 % fällig am 20.01.2032	7.500	6.088	CaixaBank S.A. 3,750 % fällig am 07.09.2029	4.500	4.509
BNG Bank NV 3,000 % fällig am 11.01.2033	6.000	5.997	Global Switch Holdings Ltd. 1,500 % fällig am 31.01.2024	4.600	4.507
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	6.200	5.964	InterContinental Hotels Group PLC 2,125 % fällig am 15.05.2027	4.600	4.287
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2023	5.600	5.588	Stratton Mortgage Funding PLC 5,391 % fällig am 20.07.2060	£ 3.724	4.236
Hamburg Commercial Bank AG 6,250 % fällig am 18.11.2024	5.300	5.486	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % fällig am 09.07.2027	€ 4.300	4.016
Cooperative Rabobank UA 4,000 % fällig am 10.01.2030	5.100	5.078	ING Groep NV 3,000 % fällig am 18.02.2026	£ 3.600	3.847
Cooperative Rabobank UA 4,655 % fällig am 22.08.2028	\$ 5.200	4.636	Standard Chartered PLC 1,214 % fällig am 23.03.2025	\$ 3.800	3.377
Werfen S.A. 4,625 % fällig am 06.06.2028	€ 4.600	4.560	Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % fällig am 13.09.2029	€ 4.200	3.375
Province of Quebec 3,000 % fällig am 24.01.2033	4.200	4.161	Goldman Sachs Group, Inc. 0,875 % fällig am 09.05.2029	4.100	3.349
Verizon Communications, Inc. 4,750 % fällig am 31.10.2034	3.600	3.752	ORIX Corp. 4,477 % fällig am 01.06.2028	3.300	3.322
American Tower Corp. 4,625 % fällig am 16.05.2031	3.500	3.478	Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK31.738	3.227
Morgan Stanley 5,123 % fällig am 01.02.2029	\$ 3.600	3.333	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 7,375 % fällig am 15.09.2029	€ 3.100	3.115
ORIX Corp. 4,477 % fällig am 01.06.2028	€ 3.300	3.300	AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % fällig am 06.02.2027	3.100	3.091
			Romania Government International Bond 6,625 % fällig am 27.09.2029	3.000	3.077
			Charter Communications Operating LLC 6,795 % fällig am 01.02.2027	\$ 3.300	3.056
			Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 3.400	3.056
			UBS Group AG 4,282 % fällig am 09.01.2028	\$ 3.600	3.053
			Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % fällig am 22.06.2026	3.240	3.021
			Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 3.100	2.988
			Cie Plastic Omnium S.A. 1,250 % fällig am 26.06.2024	3.000	2.892
			DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024	\$ 3.200	2.883
			Deutsche Bank AG 0,750 % fällig am 17.02.2027	€ 3.200	2.835
			Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % fällig am 17.03.2026	3.000	2.791

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023 (Forts.)</b>				
QNB Finance Ltd. 1,375 % fällig am 26.01.2026	\$	3.300	€	2.750
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	26.040		2.647
TDF Infrastructure SASU 1,750 % fällig am 01.12.2029	€	3.200		2.594

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Income Bond Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
Jupiter Mortgage PLC 5,891 % fällig am 20.07.2060	£ 24.700	€ 27.420	France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2023	€ 21.750	€ 21.715
Bridgeway Funding PLC 6,716 % fällig am 16.10.2062	24.122	26.663	Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	21.600	19.218
Dutch Property Finance BV 4,168 % fällig am 28.04.2064	€ 16.200	15.995	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 168.664	16.983
Shamrock Residential DAC 4,439 % fällig am 24.06.2071	15.000	14.787	HSBC Holdings PLC 1,589 % fällig am 24.05.2027	\$ 17.500	14.307
Glenbeigh Issuer DAC 4,350 % fällig am 24.06.2050	14.848	14.629	Loxam S.A.S. 3,250 % fällig am 14.01.2025	€ 14.600	13.966
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2023	14.600	14.550	<b>AKTIEN</b>		
Barclays PLC 7,437 % fällig am 02.11.2033	\$ 12.226	12.596	<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)</b>	137.900	13.231
Tower Bridge Funding PLC 5,991 % fällig am 20.10.2064	£ 10.400	11.876		<b>PAR (000S)</b>	
NatWest Group PLC 6,016 % fällig am 02.03.2034	\$ 11.900	11.225	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 13.600	13.148
BPCE S.A. 5,748 % fällig am 19.07.2033	12.100	11.072	Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % fällig am 09.10.2025	14.000	13.108
Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % fällig am 15.01.2033	11.700	11.005	Banco de Sabadell S.A. 1,125 % fällig am 27.03.2025	14.000	12.872
HSBC Holdings PLC 5,402 % fällig am 11.08.2033	12.000	10.902	Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 20.01.2027	14.200	12.616
Atrium Hotel Portfolio Trust 7,093 % fällig am 15.06.2035	9.700	8.681	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 112.167	11.274
Option One Mortgage Loan Trust 5,330 % fällig am 25.04.2037	13.654	7.290	Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % fällig am 15.01.2033	\$ 11.700	10.992
Societe Generale S.A. 6,446 % fällig am 10.01.2029	7.200	6.821	Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % fällig am 17.03.2026	€ 11.400	10.717
UBS Commercial Mortgage Trust 6,693 % fällig am 15.02.2032	7.520	6.700	Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	11.500	9.831
KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029	7.200	6.695	Societe Generale S.A. 2,226 % fällig am 21.01.2026	\$ 11.000	9.624
UBS Group AG 7,750 % fällig am 01.03.2029	€ 6.400	6.664	IHO Verwaltungs GmbH 3,625 % fällig am 15.05.2025	€ 10.200	9.614
Harbour Energy PLC 5,457 % fällig am 28.01.2054	£ 5.700	6.300	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % fällig am 09.07.2027	10.500	9.562
Stratton Mortgage Funding PLC 6,991 % fällig am 20.07.2060	5.594	6.204	Accor S.A. 2,375 % fällig am 29.11.2028	9.600	8.237
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2023	€ 5.380	5.368	TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028	£ 8.600	7.779
Soundview Home Loan Trust 6,150 % fällig am 25.09.2037	\$ 7.944	5.244	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 75.223	7.222
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % fällig am 21.11.2033	4.950	4.927	Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025	\$ 7.700	6.689
Ludgate Funding PLC 3,212 % fällig am 01.01.2061	€ 5.062	4.807	UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.07.2025	€ 7.000	6.682
IndyMac Mortgage Loan Trust 5,770 % fällig am 25.10.2036	\$ 9.569	4.740	WPC Eurobond BV 1,350 % fällig am 15.04.2028	7.000	5.922
Pacific Gas & Electric Co. 6,100 % fällig am 15.01.2029	5.000	4.657	Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % fällig am 13.09.2029	7.500	5.899
Pacific Gas & Electric Co. 6,400 % fällig am 15.06.2033	5.000	4.655	Sofina S.A. 1,000 % fällig am 23.09.2028	7.400	5.819
Countrywide Alternative Loan Trust 5,500 % fällig am 25.03.2035	5.570	4.583	Grifols S.A. 5,633 % fällig am 15.11.2027	6.000	5.705
RMAC Securities PLC 5,254 % fällig am 12.06.2044	£ 4.276	4.517	Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 7,396 % fällig am 01.12.2027	\$ 5.670	5.170
Fremont Home Loan Trust 5,270 % fällig am 25.01.2037	\$ 10.545	4.497	Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	€ 6.000	5.141
Option One Mortgage Loan Trust 5,250 % fällig am 25.07.2036	10.720	4.451	KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029	\$ 5.200	4.878
HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,525 % fällig am 25.05.2037	4.600	4.109	INEOS Finance PLC 6,168 % fällig am 08.11.2028	€ 5.000	4.761
			AA Bond Co. Ltd. 5,500 % fällig am 31.07.2050	£ 4.510	4.650

(a) Der Euro Income Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
France Government International Bond 4,500 % fällig am 25.04.2041	€ 47.000	€ 55.092	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	116.900	€ 11.213
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.10.2038	34.500	37.869		PAR (000S)	
France Government International Bond 2,500 % fällig am 25.05.2043	27.700	24.485	France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 19.500	10.161
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2060	17.900	20.809	France Government International Bond 2,500 % fällig am 25.05.2043	7.600	6.516
France Government International Bond 3,250 % fällig am 25.05.2045	20.400	20.520	France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048	6.450	4.951
France Government International Bond 3,000 % fällig am 25.05.2054	18.900	17.701	France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2055	2.800	3.104
	<b>AKTIEN</b>		France Government International Bond 3,250 % fällig am 25.05.2045	3.100	3.063
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	179.500	17.243	Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 15.08.2046	2.900	2.874
	PAR (000S)		Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 26.741	2.518
Netherlands Government International Bond 2,750 % fällig am 15.01.2047	€ 13.700	13.989	France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.06.2039	€ 2.850	2.405
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	23.200	12.774	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 30.01.2026	£ 1.900	1.954
Bundesrepublik Deutschland 4,750 % fällig am 04.07.2040	9.300	12.149	France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2060	€ 1.650	1.855
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2055	10.200	11.639	Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap 3,250 % fällig am 12.01.2043	1.500	1.405
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$ 10.338	9.366	France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.06.2044	2.000	1.235
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	8.703	7.846	France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.05.2072	2.600	1.005
Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2052	€ 16.000	7.816	Europäische Union 0,300 % fällig am 04.11.2050	1.800	853
France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050	11.300	7.724	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b)	\$ 964	808
Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2038	11.300	7.608	France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050	€ 1.100	780
Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 15.08.2046	7.300	7.477	Nykredit Realkredit A/S 3,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 6.011	741
France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048	8.200	6.391	Landmark Mortgage Securities PLC 4,865 % fällig am 17.04.2044	£ 681	720
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2053	12.100	6.297	Banco Santander S.A. 2,375 % fällig am 08.09.2027	€ 700	675
Slovenia Government International Bond 1,500 % fällig am 25.03.2035	7.600	6.135			
France Government International Bond 1,250 % fällig am 25.05.2038	7.700	6.004	(a) Der Euro Long Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.		
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2066	7.000	4.742	(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 5.103	4.549	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Short-Term Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	PAR (000S)		KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)		KOSTEN (000S)		
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>				<b>KAUFE BIS 30. JUNI 2023 (Forts.)</b>					
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a)	\$	14.211	€	12.578	Silver Arrow S.A. 3,768 % fällig am 15.02.2030	€	700	€	700
Towd Point Mortgage Funding PLC 6,216 % fällig am 20.02.2045	£	2.997		3.513	Commerzbank AG 3,375 % fällig am 12.12.2025		700		699
Westpac Banking Corp. 3,457 % fällig am 04.04.2025	€	1.500		1.500	CaixaBank S.A. 4,625 % fällig am 16.05.2027		700		699
ING Bank NV 3,000 % fällig am 15.02.2026		1.500		1.495	Realkredit Danmark A/S 2,860 % fällig am 01.07.2023	DKK	5.200		698
Hana Bank 3,750 % fällig am 04.05.2026		1.400		1.399	National Australia Bank Ltd. 5,507 % fällig am 17.06.2026	£	600		691
Burberry Group PLC 1,125 % fällig am 21.09.2025	£	1.100		1.150	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 3,602 % fällig am 16.02.2026	€	690		690
Heathrow Funding Ltd. 1,500 % fällig am 12.10.2027	€	1.200		1.143	Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025		700		680
Fortum Oyj 1,625 % fällig am 27.02.2026		1.200		1.138	Harbour Energy PLC 5,358 % fällig am 28.01.2054	£	591		669
JAB Holdings BV 1,750 % fällig am 25.06.2026		1.200		1.135	Svensk Exportkredit AB 3,250 % fällig am 13.04.2026	€	650		650
Thames Water Utilities Finance PLC 4,000 % fällig am 19.06.2025	£	1.000		1.120	Koninklijke Philips NV 0,500 % fällig am 22.05.2026		700		641
Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,875 % fällig am 29.05.2026	€	1.200		1.109	Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026		700		636
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3,437 % fällig am 04.04.2025		1.100		1.100					
Nationale-Niederlanden Bank NV 0,500 % fällig am 10.10.2056		1.100		1.051					
ING Groep NV 0,125 % fällig am 29.11.2025		1.100		1.025					
Royal Bank of Canada 3,607 % fällig am 17.01.2025		1.000		1.000					
Toronto-Dominion Bank 3,650 % fällig am 20.01.2025		1.000		1.000					
Banco Santander S.A. 3,375 % fällig am 11.01.2026		1.000		999					
BNG Bank NV 0,050 % fällig am 11.07.2023		1.000		999					
Cairn CLO DAC 3,842 % fällig am 30.04.2031		986		965					
Stanlington PLC 5,815 % fällig am 12.06.2045	£	816		920					
Harvest CLO DAC 3,907 % fällig am 15.01.2031	€	931		914					
Cars Alliance Auto Loans Germany 3,860 % fällig am 18.03.2035		900		900					
Bank of Nova Scotia 3,704 % fällig am 02.05.2025		900		900					
Lloyds Bank PLC 3,250 % fällig am 02.02.2026		900		900					
Bank of Ireland Group PLC 0,750 % fällig am 08.07.2024		900		899					
South Korea Government International Bond 2,125 % fällig am 10.06.2024		900		886					
Rochester Financing PLC 5,602 % fällig am 18.12.2044	£	790		883					
Stratton BTL Mortgage Funding PLC 5,221 % fällig am 20.01.2054		779		868					
Bavarian Sky S.A. 3,765 % fällig am 20.03.2030	€	800		800					
Autonoria FCT 3,883 % fällig am 26.01.2043		800		800					
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % fällig am 06.04.2026		800		800					
Dilosk RMBS DAC 4,070 % fällig am 20.07.2061		800		800					
Revocar UG 4,032 % fällig am 21.04.2036		800		800					
Bavarian Sky UK PLC 5,407 % fällig am 20.04.2031	£	700		794					
Ginkgo Sales Finance 4,113 % fällig am 25.11.2049	€	749		749					
Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % fällig am 05.05.2026	\$	800		725					
BMW Finance NV 3,609 % fällig am 09.12.2024	€	700		700					

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023 (Forts.)</b>		
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,550 % fällig am 06.11.2023	€ 7.300	€ 7.183	ING Bank NV 3,000 % fällig am 15.02.2026	€ 1.500	€ 1.491
Bank of China Ltd. 5,216 % fällig am 10.08.2023	£ 5.000	5.616	Goldman Sachs Group, Inc. 3,750 % fällig am 30.04.2024	1.500	1.490
Trinity Square PLC 5,316 % fällig am 15.07.2059	4.441	5.003	Bank of Ireland Group PLC 1,375 % fällig am 29.08.2023	1.500	1.489
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,635 % fällig am 20.10.2051	3.629	4.256			
Bain Capital Euro CLO DAC 3,940 % fällig am 20.01.2032	€ 3.800	3.717	(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
Korea Housing Finance Corp. 0,723 % fällig am 22.03.2025	3.700	3.495	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
Precise Mortgage Funding PLC 6,065 % fällig am 12.12.2055	£ 2.804	3.243			
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	€ 3.200	3.113	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Becton Dickinson & Co. 0,000 % fällig am 13.08.2023	3.000	2.970			
Caja Rural de Navarra SCC 0,625 % fällig am 01.12.2023	3.000	2.952			
Schaeffler AG 1,875 % fällig am 26.03.2024	3.000	2.934			
Jubilee Place BV 4,027 % fällig am 17.01.2059	2.899	2.884			
Canada Square Funding PLC 5,852 % fällig am 17.06.2058	£ 2.535	2.814			
Lanebrook Mortgage Transaction PLC 5,141 % fällig am 20.07.2058	2.512	2.802			
BNZ International Funding Ltd. 0,625 % fällig am 03.07.2025	€ 2.900	2.719			
Dexia Credit Local S.A. 0,250 % fällig am 01.06.2023	2.600	2.593			
Morgan Stanley 0,637 % fällig am 26.07.2024	2.600	2.587			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a)	\$ 2.669	2.384			
Hops Hill PLC 6,204 % fällig am 27.11.2054	£ 1.959	2.230			
Clydesdale Bank PLC 5,540 % fällig am 22.03.2026	1.900	2.178			
Toronto-Dominion Bank 4,954 % fällig am 22.04.2025	1.900	2.150			
Freddie Mac 0,800 % fällig am 28.10.2026	\$ 2.600	2.137			
Societe Generale S.A. 1,250 % fällig am 15.02.2024	€ 2.100	2.059			
Freddie Mac 0,650 % fällig am 27.10.2025	\$ 2.400	2.018			
Yorkshire Building Society 0,375 % fällig am 11.04.2023	€ 2.000	1.993			
Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	2.000	1.975			
Ripon Mortgages PLC 5,491 % fällig am 28.08.2056	£ 1.636	1.876			
Teollisuuden Voima Oyj 2,125 % fällig am 04.02.2025	€ 1.900	1.812			
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0,250 % fällig am 17.03.2025	1.900	1.792			
Bank of Nova Scotia 3,050 % fällig am 31.10.2024	1.800	1.790			
Poland Government International Bond 0,000 % fällig am 07.07.2023	1.800	1.786			
Cairn CLO DAC 3,912 % fällig am 31.01.2030	1.790	1.759			
Land Securities Capital Markets PLC 1,974 % fällig am 08.02.2024	£ 1.500	1.698			
Nationwide Building Society 0,250 % fällig am 22.07.2025	€ 1.800	1.664			
LeasePlan Corp. NV 0,125 % fällig am 13.09.2023	1.600	1.568			
Korea Housing Finance Corp. 0,010 % fällig am 05.02.2025	1.600	1.499			
Logicor Financing SARL 0,750 % fällig am 15.07.2024	1.600	1.494			

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
Ford Motor Credit Co. LLC 4,867 % fällig am 03.08.2027	€ 4.150	€ 4.150	Ford Motor Credit Co. LLC 4,867 % fällig am 03.08.2027	€ 4.150	€ 4.071
Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % fällig am 17.06.2031	\$ 5.100	3.771	Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % fällig am 17.06.2031	\$ 3.100	2.298
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2023	€ 3.090	3.078	Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 2.100	2.061
Pinnacle Bidco PLC 6,375 % fällig am 15.02.2025	£ 2.800	2.991	Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % fällig am 15.08.2024	1.900	1.865
Spectrum Brands, Inc. 4,000 % fällig am 01.10.2026	€ 3.000	2.874	Lottomatica SpA 7,125 % fällig am 01.06.2028	1.800	1.853
<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)</b>	<b>29.500</b>	<b>2.826</b>	Cirsa Finance International SARL 4,750 % fällig am 22.05.2025	1.800	1.761
	<b>PAR (000S)</b>		Intrum AB 9,250 % fällig am 15.03.2028	1.800	1.754
Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 2.600	2.559	France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2023	1.700	1.698
Electricite de France S.A. 6,000 % fällig am 29.01.2026	£ 2.400	2.509	EP Infrastructure A/S 1,698 % fällig am 30.07.2026	1.900	1.635
EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 3.400	2.431	INEOS Quattro Finance Plc 3,375 % fällig am 15.01.2026	\$ 1.900	1.584
Schaeffler AG 3,375 % fällig am 12.10.2028	2.700	2.413	Summer BC Holdco SARL 5,750 % fällig am 31.10.2026	€ 1.700	1.484
France Government International Bond 4,250 % fällig am 25.10.2023	2.350	2.356	BCP Modular Services Finance PLC 4,750 % fällig am 30.11.2028	1.500	1.251
INEOS Quattro Finance PLC 2,500 % fällig am 15.01.2026	2.500	2.270	Inter Media and Communication SpA 6,750 % fällig am 09.02.2027	1.300	1.225
BCP Modular Services Finance PLC 4,750 % fällig am 30.11.2028	2.700	2.252	Cellnex Finance Co. S.A. 1,500 % fällig am 08.06.2028	1.400	1.194
Telecom Italia SpA 6,875 % fällig am 15.02.2028	2.200	2.204	EnQuest PLC 11,625 % fällig am 01.11.2027	\$ 1.300	1.113
Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£ 2.400	2.194	Rossini SARL 6,750 % fällig am 30.10.2025	€ 1.000	1.011
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2023	€ 2.150	2.145	Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025	1.000	935
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 2.200	2.079	Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	1.100	925
Forvia 2,750 % fällig am 15.02.2027	€ 2.200	1.970	Axalta Coating Systems Dutch Holding BV 3,750 % fällig am 15.01.2025	900	887
Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026	2.100	1.929	Virgin Money UK PLC 9,250 % fällig am 08.06.2024	£ 800	863
Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	2.100	1.841	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % fällig am 31.03.2027	€ 1.000	850
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	2.200	1.836	Accor S.A. 2,375 % fällig am 29.11.2028	900	811
Lottomatica SpA 7,125 % fällig am 01.06.2028	1.800	1.800	Lloyds Banking Group PLC 8,500 % fällig am 27.03.2028	£ 800	808
Rolls-Royce PLC 3,375 % fällig am 18.06.2026	£ 1.580	1.623	Loxam S.A.S. 3,250 % fällig am 14.01.2025	€ 800	781
Chemours Co. 4,000 % fällig am 15.05.2026	€ 1.700	1.581			
Kronos International, Inc. 3,750 % fällig am 15.09.2025	1.700	1.568	(a) Der PIMCO European High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.		
Commerzbank AG 8,625 % fällig am 28.02.2033	£ 1.300	1.533	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % fällig am 31.03.2027	€ 1.700	1.437	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025	1.600	1.415			
ProGroup AG 3,000 % fällig am 31.03.2026	1.500	1.410			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % fällig am 02.03.2026	1.400	1.401			

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	157.000	€ 15.114	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	231.600	€ 22.258
	PAR (000S)			PAR (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	\$ 8.375	7.412	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 30.694	3.046
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9,000 % fällig am 01.11.2023	€ 2.200	2.296	Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	31.500	2.996
Spain Government International Bond 2,350 % fällig am 30.07.2033	1.600	1.461	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	28.880	2.744
Bundesrepublik Deutschland 4,250 % fällig am 04.07.2039	900	1.143	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	€ 2.400	2.342
HSBC Holdings PLC 6,254 % fällig am 09.03.2034	\$ 1.000	944	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9,000 % fällig am 01.11.2023	2.200	2.293
Europäische Union 0,300 % fällig am 04.11.2050	€ 1.900	897	UniCredit SpA 7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 2.050	1.879
AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % fällig am 06.02.2027	900	897	Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 18.682	1.843
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025	900	873	Realkredit Danmark A/S 2,000 % fällig am 01.10.2053	17.500	1.840
Santander UK Group Holdings PLC 6,534 % fällig am 10.01.2029	\$ 800	754	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0,125 % fällig am 15.09.2031	€ 2.300	1.831
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.01.2046	£ 1.100	716	Realkredit Danmark A/S 3,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 13.600	1.619
Westpac Banking Corp. 3,457 % fällig am 04.04.2025	€ 700	700	Crown European Holdings S.A. 2,625 % fällig am 30.09.2024	€ 1.400	1.374
ING Belgium S.A. 3,375 % fällig am 31.05.2027	700	699	Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025	1.200	1.194
Barclays PLC 7,437 % fällig am 02.11.2033	\$ 600	606	Volkswagen Bank GmbH 1,875 % fällig am 31.01.2024	1.200	1.184
Royal Bank of Canada 3,607 % fällig am 17.01.2025	€ 600	600	Sparebanken Soer Boligkreditt A/S 3,125 % fällig am 14.11.2025	1.100	1.101
Spain Government International Bond 3,550 % fällig am 31.10.2033	590	590	Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3,205 % fällig am 15.11.2024	1.100	1.099
Deutsche Bank AG 3,875 % fällig am 12.02.2024	£ 500	553	Charles Schwab Corp. 5,609 % fällig am 13.05.2026	\$ 1.200	1.086
Banco Santander S.A. 3,727 % fällig am 16.01.2025	€ 500	500	Deutsche Bank AG 4,000 % fällig am 29.11.2027	€ 1.100	1.082
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	500	500	Royal Bank of Canada 4,784 % fällig am 12.12.2025	\$ 1.100	1.023
Intesa Sanpaolo SpA 3,625 % fällig am 30.06.2028	500	500	Sprint LLC 7,875 % fällig am 15.09.2023	1.000	945
UniCredit SpA 3,375 % fällig am 31.01.2027	500	499	AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % fällig am 06.02.2027	€ 900	909
Virgin Money UK PLC 4,625 % fällig am 29.10.2028	500	498	Europäische Union 0,300 % fällig am 04.11.2050	1.900	899
			Highland Holdings SARL 0,000 % fällig am 12.11.2023	900	877
			Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 8.700	864
			Nykredit Realkredit A/S 3,500 % fällig am 01.10.2053	6.786	844
			UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.07.2025	€ 900	809
			Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 7.200	789

(a) Der PIMCO European Short-Term Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Advantage Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	8.704.172	\$ 86.675	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	8.365.588	\$ 83.300
	PAR (000S)			PAR (000S)	
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥ 1.050.000	7.902	Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD 5.500	4.137
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF 1.653.000	4.830	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	\$ 3.400	3.512
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2023	1.647.000	4.747	U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	4.500	3.378
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD 5.500	4.134	Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 9.000	2.157
South Korea Government International Bond 4,250 % fällig am 10.12.2032	KRW 4.950.810	4.050	Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD 3.750	1.965
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 3.824	3.800	Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	2.180	1.554
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	3.400	3.509	Morocco Government International Bond 2,000 % fällig am 30.09.2030	€ 1.800	1.530
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	3.275	3.189	UBS Group AG 4,703 % fällig am 05.08.2027	\$ 1.500	1.457
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	3.061	2.963	American Municipal Power, Inc. 7,334 % fällig am 15.02.2028	1.300	1.411
Bulgaria Government International Bond 4,500 % fällig am 27.01.2033	€ 2.100	2.219	U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028	1.400	1.399
Israel Government International Bond 4,500 % fällig am 17.01.2033	\$ 2.200	2.178	Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % fällig am 27.09.2023	1.400	1.383
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW 2.805.850	2.105	Serbia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.05.2027	€ 1.400	1.376
Magyar Export-Import Bank 6,125 % fällig am 04.12.2027	\$ 2.100	2.084	Madison Park Funding Ltd. 6,010 % fällig am 15.04.2029	\$ 1.240	1.226
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD 3.750	2.077	Citigroup, Inc. 3,785 % fällig am 17.03.2033	1.300	1.157
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034	\$ 1.900	1.886	Petroleos Mexicanos 6,750 % fällig am 21.09.2047	1.809	1.105
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	CAD 2.180	1.551	Santander UK Group Holdings PLC 4,750 % fällig am 15.09.2025	1.100	1.062
Hungary Government International Bond 6,250 % fällig am 22.09.2032	\$ 1.500	1.502	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2031 (b)	1.154	1.061
Gaci First Investment Co. 4,875 % fällig am 14.02.2035	1.500	1.466	Israel Electric Corp. Ltd. 3,750 % fällig am 22.02.2032	1.200	1.040
U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028	1.400	1.406	Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026	1.000	944

(a) Der Global Advantage Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	60.602.158 \$	603.449	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	48.998.920 \$	487.900
	PAR (000S)			PAR (000S)	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥ 31.160.000	244.445	Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD 264.600	198.050
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD 264.600	197.730	Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	223.959	148.630
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	223.959	148.531	Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.09.2027	143.300	106.340
South Korea Government International Bond 4,250 % fällig am 10.12.2032	KRW 166.494.540	136.110	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	\$ 88.200	91.067
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥ 17.912.450	134.182	U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	114.700	86.089
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.03.2024	15.550.000	120.544	Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD 149.130	79.520
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.09.2027	CAD 143.300	106.280	Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	79.050	56.360
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 98.484	95.885	U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028	\$ 35.400	35.386
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	92.408	91.612	Boeing Co. 3,625 % fällig am 01.02.2024	36.000	34.888
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	88.200	91.022	CBAM Ltd. 6,370 % fällig am 20.10.2029	27.151	26.947
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	90.376	87.460	South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW 34.132.210	25.933
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD 149.130	83.867	Thailand Government International Bond 3,450 % fällig am 17.06.2043	THB 793.970	25.139
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW 102.355.980	76.910	Prudential Funding Asia PLC 2,950 % fällig am 03.11.2033	\$ 24.600	20.708
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.04.2024	¥ 8.140.000	62.516	Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % fällig am 27.09.2023	20.000	19.754
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	CAD 79.050	56.296	UBS Group AG 5,959 % fällig am 12.01.2034	17.900	17.918
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.05.2024	¥ 5.580.000	42.040	BNP Paribas S.A. 2,591 % fällig am 20.01.2028	19.553	17.341
Nykredit Realkredit A/S 5,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 250.000	35.975	Boeing Co. 3,625 % fällig am 01.02.2031	19.000	16.986
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,520 % fällig am 13.01.2028	\$ 35.700	35.700	Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % fällig am 17.09.2030	18.200	15.925
U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028	35.400	35.551	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	16.780	15.656
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	32.700	32.314			

(a) Der Global Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond ESG Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥ 16.560.000	\$ 129.911	Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	CAD 63.552	\$ 42.161
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.04.2053	\$ 51.995	51.858	Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	35.830	25.542
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥ 6.820.000	51.185	Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	31.800	23.916
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053	\$ 47.995	48.440	Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	39.460	20.948
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	CAD 63.552	42.126	Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 23.02.2028	€ 12.300	11.827
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 34.323	34.153	Agence Francaise de Developpement 2,875 % fällig am 21.01.2030	9.000	9.644
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.03.2024	¥ 4.110.000	31.831	Communaute Francaise de Belgique 1,625 % fällig am 03.05.2032	10.300	9.247
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW 36.353.420	27.444	Morgan Stanley 3,622 % fällig am 01.04.2031	\$ 9.100	8.232
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 26.580	25.880	U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028	8.100	8.097
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2023	DKK 180.000	25.801	Asian Development Bank 1,500 % fällig am 04.05.2028	CAD 11.700	7.854
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	CAD 35.830	25.510	Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	£ 7.145	7.798
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.01.2053	\$ 24.453	24.989	Province of Ontario 1,550 % fällig am 01.11.2029	CAD 11.600	7.486
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD 31.800	23.900	Goldman Sachs Group, Inc. 2,650 % fällig am 21.10.2032	\$ 8.300	6.805
South Korea Government International Bond 2,000 % fällig am 10.06.2031	KRW 34.358.800	23.680	Region of Ile de France 3,050 % fällig am 03.02.2033	€ 6.000	6.432
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$ 24.374	23.595	Japan Government International Bond 0,200 % fällig am 20.09.2032	¥ 750.000	5.839
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.04.2024	DKK 160.400	22.889	<b>AKTIEN</b>		
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 21.826	22.365	<b>PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Investment Grade Credit ESG Fund (a)</b>	580.000	5.788
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD 39.460	22.116		<b>PAR (000S)</b>	
South Korea Government International Bond 4,250 % fällig am 10.12.2032	KRW 26.799.020	21.926	LeasePlan Corp. NV 0,250 % fällig am 23.02.2026	€ 5.800	5.652
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,000 % fällig am 30.10.2031	€ 20.000	21.914	Thailand Government International Bond 3,450 % fällig am 17.06.2043	THB 177.900	5.624
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053	\$ 18.618	18.790	Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.12.2031	CAD 8.500	5.460
Hana Bank 3,750 % fällig am 04.05.2026	€ 16.200	17.878	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 2,875 % fällig am 25.05.2027	€ 5.000	5.406
Communaute Francaise de Belgique 3,750 % fällig am 22.06.2033	16.300	17.220	Region Wallonne Belgium 1,375 % fällig am 06.04.2032	6.000	5.244
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2053	\$ 17.198	17.153	BNP Paribas S.A. 3,132 % fällig am 20.01.2033	\$ 6.300	5.174
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028	¥ 2.127.708	16.469	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.01.2052	5.819	5.019
			Santander UK Group Holdings PLC 4,750 % fällig am 15.09.2025	5.000	4.827
			JPMorgan Chase & Co. 4,493 % fällig am 24.03.2031	4.700	4.539
			Equinix, Inc. 2,500 % fällig am 15.05.2031	5.500	4.456
			Derwent London PLC 1,875 % fällig am 17.11.2031	£ 5.000	4.435
			HSBC Holdings PLC 1,500 % fällig am 04.12.2024	€ 4.100	4.390
			Towd Point Mortgage Trust 6,150 % fällig am 25.10.2059	\$ 4.310	4.289
			ZF Finance GmbH 2,000 % fällig am 06.05.2027	€ 4.400	3.998
			BNP Paribas S.A. 5,198 % fällig am 10.01.2030	\$ 4.150	3.996
			American Medical Systems Europe BV 0,750 % fällig am 08.03.2025	€ 3.800	3.912
			International Development Association 1,750 % fällig am 05.05.2037	4.000	3.707
			Vonovia SE 0,750 % fällig am 01.09.2032	4.900	3.619

(a) Der Global Bond ESG Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	23.021.423 \$	229.243	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	22.735.689 \$	226.400
	PAR (000S)			PAR (000S)	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥ 2.880.000	22.593	Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	CAD 24.958	16.228
China Government International Bond 2,440 % fällig am 15.10.2027	CNY 149.740	21.921	Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	7.300	5.490
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	CAD 24.958	16.215	Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	7.670	5.476
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥ 1.320.000	9.878	China Government International Bond 3,810 % fällig am 14.09.2050	CNY 24.300	3.921
South Korea Government International Bond 4,250 % fällig am 10.12.2032	KRW 10.509.430	8.589	Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD 6.700	3.603
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 5.920	5.764	Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.12.2051	6.150	3.455
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD 7.300	5.487	Thailand Government International Bond 3,450 % fällig am 17.06.2043	THB 109.900	3.392
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	7.670	5.472	Oracle Corp. 2,300 % fällig am 25.03.2028	\$ 2.400	2.143
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$ 5.487	5.312	Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026	2.100	1.980
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.04.2024	¥ 690.000	5.304	Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN 7.900	1.954
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 5.339	5.302	U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028	\$ 1.800	1.799
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW 6.805.960	5.118	Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % fällig am 27.09.2023	1.800	1.778
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.03.2024	¥ 620.000	4.816	Commerzbank AG 5,125 % fällig am 18.01.2030	€ 1.600	1.715
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD 7.750	4.378	South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW 2.005.660	1.524
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.05.2024	¥ 310.000	2.336	Goldman Sachs Group, Inc. 1,375 % fällig am 15.05.2024	€ 1.400	1.486
Malaysia Government International Bond 3,885 % fällig am 15.08.2029	MYR 10.179	2.335	China Government Bond 3,720 % fällig am 12.04.2051	CNY 9.300	1.480
Barclays PLC 6,224 % fällig am 09.05.2034	\$ 2.300	2.300	IHO Verwaltungs GmbH 8,750 % fällig am 15.05.2028	€ 1.300	1.433
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	2.200	2.174	CaixaBank S.A. 3,625 % fällig am 14.09.2028	1.800	1.426
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 18.01.2028	1.900	1.893	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 12.750	1.389

(a) Der Global Bond Ex-US Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	11.209.301	\$ 111.622	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	13.127.486	\$ 130.726
	PAR (000S)		PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	99.700	9.875
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 39.930	39.441		PAR (000S)	
	AKTIEN		Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,700 % fällig am 01.09.2030	CLP 5.200.000	5.986
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (a)	725.222	7.476	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 80.350	4.961
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	65.900	6.543	Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP 14.473.700	3.332
	PAR (000S)			AKTIEN	
Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP 14.473.700	3.210	Oak Street Health, Inc.	87.200	3.036
	AKTIEN		Horizon Therapeutics PLC	26.500	2.911
Oak Street Health, Inc.	87.200	3.074	Vertex Pharmaceuticals, Inc.	7.913	2.695
Citigroup, Inc.	61.100	2.864	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	3.435	2.627
Wells Fargo & Co.	71.700	2.817		PAR (000S)	
Bank of America Corp.	95.800	2.769	Colombian TES 7,750 % fällig am 18.09.2030	COP 13.677.500	2.619
JPMorgan Chase & Co.	21.000	2.769		AKTIEN	
Radius Global Infrastructure, Inc.	93.700	1.362	TEGNA, Inc.	168.148	2.606
Sands China Ltd.	257.600	969	First Horizon Corp.	161.653	2.592
Galaxy Entertainment Group Ltd.	136.000	946	PNM Resources, Inc.	49.758	2.435
Wuliangye Yibin Co Ltd.	30.800	945	AMETEK, Inc.	16.956	2.430
H World Group Ltd.	20.000	945	Humana, Inc.	4.401	2.144
Li Ning Co Ltd.	101.000	945	Elevance Health, Inc.	4.621	2.120
Trip.com Group Ltd.	25.100	943		PAR (000S)	
ANTA Sports Products Ltd.	62.800	941	Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % fällig am 17.09.2030	\$ 2.100	1.859
Tencent Holdings Ltd.	19.100	938		AKTIEN	
China Resources Beer Holdings Co Ltd.	120.000	937	NetApp, Inc.	26.589	1.817
			MasTec, Inc.	17.777	1.689
			Eaton Corp. PLC	10.206	1.654

(a) Der PIMCO Global Dividend Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global High Yield Bond Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023			VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	22.906.892	\$ 228.105	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	30.297.562	\$ 301.700
	PAR (000S)			PAR (000S)	
Electricite de France S.A. 9,125 % fällig am 15.03.2033	\$ 26.800	27.399	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.11.2027	\$ 55.000	55.442
EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	€ 28.500	22.495	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.10.2027	28.000	27.928
Cidron Aida Finco SARL 5,000 % fällig am 01.04.2028	17.500	17.159	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 30.09.2027	20.000	20.048
United Group BV 3,625 % fällig am 15.02.2028	17.330	14.710	Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032	10.000	12.236
Chrome Bidco SASU 3,500 % fällig am 31.05.2028	11.900	10.661	Sprint LLC 7,625 % fällig am 15.02.2025	10.000	10.255
Allegiant Travel Co. 7,250 % fällig am 15.08.2027	\$ 10.500	10.461	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025	10.000	9.865
Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£ 10.000	10.301	TMNL Holding BV 3,750 % fällig am 15.01.2029	€ 10.000	9.485
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030	\$ 10.000	10.000	Virgin Media Finance PLC 3,750 % fällig am 15.07.2030	10.000	8.789
Market Bidco Finco PLC 5,500 % fällig am 04.11.2027	£ 10.300	9.958	Occidental Petroleum Corp. 8,875 % fällig am 15.07.2030	\$ 5.625	6.435
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 10.200	9.309	Global Medical Response, Inc. 6,500 % fällig am 01.10.2025	10.000	6.050
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % fällig am 01.06.2031	\$ 9.100	9.100	Verallia S.A. 1,875 % fällig am 10.11.2031	€ 7.000	5.923
Cirsa Finance International SARL 4,500 % fällig am 15.03.2027	€ 9.000	8.903	Western Midstream Operating LP 5,500 % fällig am 01.02.2050	\$ 7.000	5.768
CT Investment GmbH 5,500 % fällig am 15.04.2026	8.700	8.749	Occidental Petroleum Corp. 6,625 % fällig am 01.09.2030	5.000	5.188
Medline Borrower LP 5,250 % fällig am 01.10.2029	\$ 9.750	8.313	Occidental Petroleum Corp. 6,450 % fällig am 15.09.2036	5.000	5.063
Kronos International, Inc. 3,750 % fällig am 15.09.2025	€ 8.200	8.291	Accor S.A. 2,375 % fällig am 29.11.2028	€ 5.000	4.897
Altice France S.A. 5,500 % fällig am 15.01.2028	\$ 10.100	7.898	Occidental Petroleum Corp. 6,200 % fällig am 15.03.2040	\$ 5.000	4.888
AMC Networks, Inc. 4,750 % fällig am 01.08.2025	8.300	7.633	Cheniere Energy, Inc. 4,625 % fällig am 15.10.2028	5.000	4.704
TK Elevator Midco GmbH 4,375 % fällig am 15.07.2027	€ 7.400	7.303	United Group BV 3,125 % fällig am 15.02.2026	€ 5.000	4.671
EQM Midstream Partners LP 4,500 % fällig am 15.01.2029	\$ 8.050	7.249	Energizer Gamma Acquisition BV 3,500 % fällig am 30.06.2029	5.000	4.265
Grifols S.A. 3,200 % fällig am 01.05.2025	€ 6.500	6.819			
Grifols Escrow Issuer S.A. 3,875 % fällig am 15.10.2028	7.800	6.781			

(a) Der Global High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN		KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN		ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	26.069.611	\$	259.596	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	24.521.880	\$	244.200
	PAR (000S)				PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	\$	96.458	94.054	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	\$	130.500	105.970
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 18.01.2028		52.000	51.820	U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.11.2051		98.021	64.452
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030		39.500	39.500	U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.02.2052		70.400	50.831
Amgen, Inc. 5,600 % fällig am 02.03.2043		36.650	36.540	Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN	98.387	24.496
UnitedHealth Group, Inc. 5,875 % fällig am 15.02.2053		25.000	27.431	Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	\$	31.800	24.377
Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034		26.900	27.019	Bevco Lux SARL 1,500 % fällig am 16.09.2027	€	23.000	22.536
NatWest Group PLC 6,016 % fällig am 02.03.2034		25.900	25.900	Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027		22.042	21.886
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033		25.000	24.705	Crown Castle, Inc. 4,450 % fällig am 15.02.2026	\$	20.933	20.730
HCA, Inc. 5,500 % fällig am 01.06.2033		22.550	22.535	MH Sub LLC 8,852 % fällig am 13.09.2024		20.277	20.077
National Grid PLC 5,809 % fällig am 12.06.2033		21.500	21.639	Las Vegas Sands Corp. 3,200 % fällig am 08.08.2024		20.000	19.345
Kraft Heinz Foods Co. 4,375 % fällig am 01.06.2046		25.000	21.137	American Tower Corp. 2,950 % fällig am 15.01.2025		20.000	19.293
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 5,110 % fällig am 19.05.2043		18.100	17.738	Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 20.01.2027	€	18.600	18.199
Xcel Energy, Inc. 4,600 % fällig am 01.06.2032		18.000	17.031	Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023	\$	17.000	16.533
Duke Energy Corp. 3,850 % fällig am 15.06.2034	€	16.000	16.179	DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024		16.400	15.719
Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.06.2028	CAD	22.300	15.706	Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.06.2028	CAD	22.300	15.554
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	\$	14.700	14.700	Logicor Financing SARL 1,625 % fällig am 15.07.2027	€	17.550	15.535
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % fällig am 01.06.2031		14.500	14.500	Carnival Corp. 7,168 % fällig am 30.06.2025		13.966	14.902
UBS Group AG 4,750 % fällig am 17.03.2032	€	12.900	13.568	QNB Finance Ltd. 3,500 % fällig am 28.03.2024	\$	14.500	14.256
Comcast Corp. 5,350 % fällig am 15.05.2053	\$	13.100	13.044	MPT Operating Partnership LP 3,692 % fällig am 05.06.2028	£	17.262	14.179

(a) Der Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 31.05.2025	\$ 30.800	\$ 30.734	U.S. Treasury Bonds 1,750 % fällig am 15.08.2041	\$ 37.750	\$ 26.484
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	10.900	11.402	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	8.900	8.840
Arkea Home Loans SFH S.A. 3,250 % fällig am 01.08.2033	€ 9.900	10.524	U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 15.10.2025	8.000	7.934
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.12.2052	\$ 9.993	9.686	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	6.200	5.617
Morgan Stanley 5,123 % fällig am 01.02.2029	8.500	8.500	Nordea Bank Abp 1,500 % fällig am 30.09.2026	6.100	5.329
Hana Bank 3,750 % fällig am 04.05.2026	€ 7.500	8.282	Apple, Inc. 1,400 % fällig am 05.08.2028	6.100	5.291
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.05.2053	\$ 8.513	8.216	Enel Finance International NV 4,625 % fällig am 15.06.2027	5.400	5.243
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2053	8.622	8.122	Zoetis, Inc. 2,000 % fällig am 15.05.2030	6.100	5.067
Nederlandse Waterschapsbank NV 3,000 % fällig am 20.04.2033	€ 6.500	7.124	U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.05.2041	6.500	4.949
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.06.2053	\$ 7.302	7.054	Israel Government International Bond 4,500 % fällig am 17.01.2033	4.400	4.237
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043	7.100	6.958	Owens Corning 3,875 % fällig am 01.06.2030	4.500	4.191
Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % fällig am 01.04.2033	6.760	6.843	Forvia 2,750 % fällig am 15.02.2027	€ 4.000	3.885
Morgan Stanley 6,342 % fällig am 18.10.2033	6.000	6.524	Schaeffler AG 3,375 % fällig am 12.10.2028	3.700	3.571
Region Wallonne Belgium 3,500 % fällig am 15.03.2043	€ 5.800	6.140	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	\$ 4.000	3.441
Land Securities Capital Markets PLC 4,875 % fällig am 15.09.2034	£ 5.000	6.051	Trane Technologies Financing Ltd. 5,250 % fällig am 03.03.2033	3.300	3.330
Truist Financial Corp. 4,873 % fällig am 26.01.2029	\$ 6.000	6.000	Bank of Ireland Group PLC 6,253 % fällig am 16.09.2026	3.250	3.238
PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % fällig am 26.01.2027	5.880	5.880	Haleon U.S. Capital LLC 3,375 % fällig am 24.03.2029	3.500	3.188
United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053	£ 4.700	5.788	Wells Fargo & Co. 4,540 % fällig am 15.08.2026	3.100	3.055
JPMorgan Chase & Co. 4,912 % fällig am 25.07.2033	\$ 5.600	5.547	Cooperatieve Rabobank UA 3,758 % fällig am 06.04.2033	3.450	3.030
Barclays PLC 6,224 % fällig am 09.05.2034	5.400	5.400	Open Text Corp. 6,900 % fällig am 01.12.2027	2.900	2.996
			Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028	€ 3.400	2.925
			KBC Group NV 3,000 % fällig am 25.08.2030	2.900	2.886
			Bank of Ireland Group PLC 1,875 % fällig am 05.06.2026	2.900	2.884

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	26.568.216 \$	264.567	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	27.797.310 \$	276.800
	PAR (000S)			PAR (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$ 43.057	43.717	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	\$ 62.081	60.566
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 27.902	35.555	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	47.987	47.126
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$ 35.743	34.995	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£ 34.928	42.190
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	35.666	34.516	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	\$ 30.692	30.571
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	35.175	33.944	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)	26.720	25.271
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	27.604	26.376	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	25.502	24.609
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	25.015	24.150	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	20.687	19.531
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)	22.665	21.458	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)	19.026	18.112
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.09.2052	19.993	19.567	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	17.942	16.952
France Government International Bond 1,850 % fällig am 25.07.2027	€ 13.761	15.973	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	15.350	15.273
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 15.257	14.989	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	15.829	15.082
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,400 % fällig am 15.05.2039	€ 11.147	11.975	United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 22.10.2029	£ 11.400	11.573
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025	11.357	11.881	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$ 9.970	9.417
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 22.10.2029	£ 11.400	11.544	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b)	6.192	5.848
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)	\$ 9.856	9.488	Ginnie Mae 5,946 % fällig am 20.03.2073	5.716	5.657
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	6.253	5.846	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)	4.709	4.439
Ginnie Mae 5,866 % fällig am 20.04.2073	5.700	5.643	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	4.602	4.415
Ginnie Mae 5,946 % fällig am 20.03.2073	5.700	5.641	France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2038	€ 3.087	3.023
Ginnie Mae 6,067 % fällig am 20.03.2073	5.700	5.631	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 26.900	2.882

(a) Der Global Low Duration Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



BESCHREIBUNG	AKTIEN		KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN		ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	25.429.485	\$	253.215	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	25.116.645	\$	250.100
	PAR (000S)				PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$	56.233	53.359	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	\$	68.906	68.858
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,400 % fällig am 15.05.2039	€	40.068	43.047	France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	€	43.474	47.179
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031		29.778	31.546	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2032	£	23.576	32.480
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$	26.480	25.982	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$	27.458	25.961
France Government International Bond 1,800 % fällig am 25.07.2040	€	19.094	25.075	United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 31.01.2029	£	22.500	23.404
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 31.01.2029	£	22.500	23.421	United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 22.10.2029		20.000	21.141
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 22.10.2029		20.000	20.426	Australia Government International Bond 3,000 % fällig am 20.09.2025	AUD	20.720	20.475
United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.03.2045		16.400	20.327	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,550 % fällig am 15.09.2041	€	16.901	19.055
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b)	\$	15.800	15.126	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	173.918	17.741
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)		14.043	13.726	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2044	£	11.238	12.436
United Kingdom Gilt 1,125 % fällig am 22.11.2037	£	8.330	11.703	United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.11.2042		8.825	11.159
France Government International Bond 0,700 % fällig am 25.07.2030	€	9.979	11.439	France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2038	€	9.945	9.741
France Government International Bond 0,550 % fällig am 01.03.2039		9.325	9.842	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)	\$	10.415	9.252
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.02.2047 (b)	\$	11.327	9.717	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.10.2041	£	10.900	8.878
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)		8.600	8.737	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b)	\$	10.593	8.710
United Kingdom Gilt 4,125 % fällig am 22.07.2030	£	1.900	8.106	Nykredit Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	85.800	8.582
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	\$	8.079	8.046	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.02.2044 (b)	\$	8.793	8.355
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)		9.134	7.987	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b)		7.167	6.702
UniCredit SpA 3,375 % fällig am 31.01.2027	€	7.000	7.463	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b)		6.756	5.994
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	\$	7.676	7.459				

(a) Der Global Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Income Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	92.073.080	\$ 916.871	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	51.790.752	\$ 515.700
	PAR (000S)			PAR (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 589.185	572.494	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.05.2052	\$ 450.387	417.289
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.11.2027	542.910	471.290	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	220.992	228.485
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.06.2053	424.378	437.266	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	138.941	143.630
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	418.948	431.590	Russia Government International Bond 5,930 % fällig am 24.04.2024	RUB 18.336.201	137.644
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.02.2053	415.453	423.328	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.03.2053	\$ 106.806	110.427
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.01.2053	415.060	421.079	Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025	€ 102.118	108.139
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.04.2053	381.907	390.432	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.04.2053	\$ 89.372	92.388
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	392.865	378.114	Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.09.2052	99.336	92.165
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	366.898	377.741	Barclays PLC 7,125 % fällig am 15.06.2025	£ 70.960	79.719
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	344.587	333.015	Boeing Co. 5,805 % fällig am 01.05.2050	\$ 66.762	66.186
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2053	309.361	318.345		AKTIEN	
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.02.2053	306.748	312.487	Noble Corp. PLC	1.786.917	65.526
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2053	292.884	301.958		PAR (000S)	
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.03.2053	287.921	295.749	Netflix, Inc. 4,625 % fällig am 15.05.2029	€ 58.400	64.385
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.01.2053	256.730	260.624	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % fällig am 22.06.2026	\$ 64.007	63.925
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.01.2053	233.483	234.126	Fannie Mae 6,500 % fällig am 01.04.2053	61.117	63.189
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	222.145	217.394	Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 68.400	63.002
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.06.2053	216.217	216.570	Freddie Mac 3,000 % fällig am 01.08.2037	\$ 63.747	61.123
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.12.2027	230.260	199.477	Petroleos Mexicanos 6,700 % fällig am 16.02.2032	79.586	59.758
Credit Suisse AG 5,500 % fällig am 20.08.2026	€ 179.400	190.721	Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 54.919	58.618
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.03.2053	\$ 171.983	175.667	SkyMiles IP Ltd. 8,798 % fällig am 20.10.2027	\$ 55.315	57.312
U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 31.01.2028	199.210	173.214			

(a) Der Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Income Fund II

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023	AKTIEN	KOSTEN (000\$)	BESCHREIBUNG VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023	AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	6.072.281	\$ 60.466	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	5.483.190	\$ 54.600
	PAR (000\$)			PAR (000\$)	
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	\$ 5.550	5.741	Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	\$ 5.244	5.407
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2027	4.600	4.640	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032	4.200	4.462
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.04.2053	4.800	4.490	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2027	3.000	3.064
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.03.2053	4.000	4.022	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.05.2025	2.500	2.453
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052	3.800	3.706	U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 31.10.2029	1.700	1.729
Great Hall Mortgages PLC 5,282 % fällig am 18.06.2038	£ 2.960	3.436	Stratton Mortgage Funding PLC 6,991 % fällig am 20.07.2060	£ 1.000	1.210
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2053	\$ 3.100	2.915	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	\$ 700	707
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.02.2053	3.182	2.906	HSBC Holdings PLC 6,254 % fällig am 09.03.2034	600	624
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032	2.400	2.513	Eurosail PLC 3,766 % fällig am 15.12.2044	€ 504	531
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.01.2053	2.479	2.470	UniCredit SpA 3,875 % fällig am 03.06.2027	500	382
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.04.2053	1.798	1.829	Intesa Sanpaolo SpA 5,875 % fällig am 01.09.2031	300	255
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	1.539	1.495	Dryden Euro CLO DAC 3,987 % fällig am 15.01.2032	239	251
Eurosail PLC 3,919 % fällig am 13.03.2045	€ 1.500	1.349	Mortimer BTL PLC 4,234 % fällig am 21.06.2052	£ 200	245
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 1.274	1.227	Huarong Finance Co. Ltd. 3,375 % fällig am 24.02.2030	\$ 300	237
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	1.247	1.205	Segovia European CLO DAC 4,080 % fällig am 20.07.2032	€ 200	209
Stratton Mortgage Funding PLC 6,991 % fällig am 20.07.2060	£ 1.000	1.184	Russia Government International Bond 4,875 % fällig am 16.09.2023	\$ 200	180
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$ 1.229	1.154	Peru Government International Bond 6,900 % fällig am 12.08.2037	PEN 500	121
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	1.100	1.069	Amgen, Inc. 5,650 % fällig am 02.03.2053	\$ 100	103
Jupiter Mortgage PLC 8,241 % fällig am 20.07.2060	£ 900	1.002	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 240	15

(a) Der Income Fund II legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Inflation Multi-Asset Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	5.295.849	\$ 52.735	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	6.003.816	\$ 59.781
Invesco Physical Gold ETC	83.600	15.496		PAR (000S)	
	PAR (000S)		U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$ 38.637	36.609
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$ 9.336	8.847		AKTIEN	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	7.374	7.251	Invesco Physical Gold ETC	73.541	13.892
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2033	€ 6.158	5.442		PAR (000S)	
Ginnie Mae 5,966 % fällig am 20.01.2073	\$ 4.000	4.000	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	\$ 7.428	7.171
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025	€ 3.751	3.924	MRCD Mark Mortgage Trust 2,718 % fällig am 15.12.2036	2.598	2.404
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	\$ 2.626	2.614	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b)	2.675	2.212
	AKTIEN		U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.02.2047 (b)	2.588	2.206
Prologis, Inc.	9.840	1.180		AKTIEN	
Equinix, Inc.	1.256	887	Invesco Physical Gold ETC	9.670	1.709
Public Storage	1.973	577		PAR (000S)	
Realty Income Corp.	9.136	576	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 15.000	1.619
Simon Property Group, Inc.	5.099	555	Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	9.000	964
	PAR (000S)		U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	\$ 480	476
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$ 506	513		AKTIEN	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	511	499	Nationwide Building Society	2.872	453
	AKTIEN			PAR (000S)	
Invitation Homes, Inc.	13.911	432	Saudi Arabia Government International Bond 4,000 % fällig am 17.04.2025	\$ 380	371
AvalonBay Communities, Inc.	2.440	405	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 3.500	361
Oak Street Health, Inc.	11.000	388		AKTIEN	
Gaming and Leisure Properties, Inc.	6.993	351	Prologis, Inc.	2.857	357
Digital Realty Trust, Inc.	3.384	348	Horizon Therapeutics PLC	2.700	269
			Public Storage	896	266
			Seagen, Inc.	1.275	248
			Invitation Homes, Inc.	7.334	248
			Prometheus Biosciences, Inc.	1.200	238

(a) Der Inflation Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 31.12.2024	\$ 183.100	\$ 183.157	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 31.01.2024	\$ 193.300	\$ 185.780
	<b>AKTIEN</b>		U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 29.02.2024	190.000	183.439
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	16.160.879	160.926		<b>AKTIEN</b>	
	<b>PAR (000S)</b>		PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	16.399.070	163.300
U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 31.01.2026	\$ 139.800	127.362		<b>PAR (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.01.2026	42.000	41.846	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.01.2026	\$ 42.000	41.467
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.01.2025	38.500	38.285	HSBC Holdings PLC 6,161 % fällig am 09.03.2029	5.200	5.283
U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.05.2025	27.900	25.815	JPMorgan Chase & Co. 4,851 % fällig am 25.07.2028	4.300	4.284
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 31.05.2025	19.800	19.753	UBS Group AG 4,488 % fällig am 12.05.2026	4.000	3.908
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€ 6.700	7.155	Global Payments, Inc. 4,950 % fällig am 15.08.2027	3.800	3.719
HSBC Holdings PLC 6,161 % fällig am 09.03.2029	\$ 5.200	5.200	ABN AMRO Bank NV 2,375 % fällig am 01.06.2027	€ 3.600	3.694
Ginnie Mae 6,166 % fällig am 20.05.2073	4.325	4.323	Bank of America Corp. 6,233 % fällig am 23.07.2024	\$ 3.500	3.500
Canadian Imperial Bank of Commerce 3,250 % fällig am 31.03.2027	€ 3.400	3.651	UBS Group AG 5,711 % fällig am 12.01.2027	3.500	3.477
Freddie Mac 3,590 % fällig am 25.01.2025	\$ 3.604	3.532	HSBC Holdings PLC 2,999 % fällig am 10.03.2026	3.600	3.395
UBS Group AG 5,711 % fällig am 12.01.2027	3.500	3.500	Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % fällig am 15.03.2024	3.300	3.226
Palmer Square European Loan Funding DAC 4,727 % fällig am 15.11.2032	€ 3.250	3.444	Deutsche Bank AG 1,000 % fällig am 19.11.2025	€ 3.000	3.070
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,464 % fällig am 13.01.2026	\$ 3.300	3.300	BPCE S.A. 5,975 % fällig am 18.01.2027	\$ 2.900	2.900
BPCE S.A. 5,975 % fällig am 18.01.2027	2.900	2.900	Daimler Truck Finance North America LLC 1,125 % fällig am 14.12.2023	3.000	2.899
Amgen, Inc. 5,250 % fällig am 02.03.2025	2.600	2.601	Mizuho Financial Group, Inc. 5,414 % fällig am 13.09.2028	2.800	2.801
U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 31.01.2024	2.500	2.403	Deutsche Bank AG 5,589 % fällig am 08.11.2023	2.800	2.791
American Honda Finance Corp. 5,000 % fällig am 23.05.2025	2.400	2.398	Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 2.800	2.690
National Bank of Canada 3,500 % fällig am 25.04.2028	€ 2.000	2.191	Bank of America Corp. 4,587 % fällig am 22.09.2026	2.400	2.609

(a) Der Low Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.799.599	\$ 147.370	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.229.718	\$ 141.700
	PAR (000S)			PAR (000S)	
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.01.2025	\$ 41.600	41.459	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2024	\$ 12.100	11.767
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.03.2025	16.500	16.504	SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026	3.900	3.890
United Kingdom Gilt 1,625 % fällig am 22.10.2028	£ 7.200	7.851	Societe Generale S.A. 4,677 % fällig am 15.06.2027	3.500	3.391
Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 13.03.2025	€ 6.700	7.148	Ford Motor Credit Co. LLC 6,860 % fällig am 05.06.2026	£ 2.500	3.115
U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 15.11.2025	\$ 5.100	5.183	Volkswagen Financial Services AG 0,000 % fällig am 12.02.2025	€ 2.700	2.635
Sika Capital BV 3,750 % fällig am 03.11.2026	€ 3.800	4.169	Credit Agricole S.A. 6,570 % fällig am 22.03.2024	\$ 2.600	2.611
Santander Holdings USA, Inc. 6,499 % fällig am 09.03.2029	\$ 4.000	4.000	American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	2.600	2.548
SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026	3.900	3.897	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % fällig am 16.11.2025	2.500	2.438
Ford Motor Credit Co. LLC 6,860 % fällig am 05.06.2026	£ 2.500	3.006	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 1.900	1.996
Morgan Stanley Bank N.A. 4,754 % fällig am 21.04.2026	\$ 3.000	3.000	Lloyds Banking Group PLC 4,716 % fällig am 11.08.2026	\$ 1.900	1.874
Black Hills Corp. 5,950 % fällig am 15.03.2028	3.000	2.997	Standard Chartered PLC 7,767 % fällig am 16.11.2028	1.700	1.850
Credit Suisse AG 7,950 % fällig am 09.01.2025	3.000	2.994	Banco Santander S.A. 1,500 % fällig am 14.04.2026	£ 1.700	1.823
BPCE S.A. 5,975 % fällig am 18.01.2027	2.800	2.800	DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024	\$ 1.600	1.534
Kenvue, Inc. 5,500 % fällig am 22.03.2025	2.600	2.615	International Flavors & Fragrances, Inc. 1,800 % fällig am 25.09.2026	€ 1.400	1.373
BMW Canada, Inc. 4,760 % fällig am 10.02.2025	CAD 3.500	2.601	Vantage Towers AG 0,000 % fällig am 31.03.2025	1.300	1.341
Royal Bank of Canada 4,125 % fällig am 05.07.2028	€ 2.300	2.499	Ford Motor Credit Co. LLC 3,021 % fällig am 06.03.2024	1.100	1.168
Amgen, Inc. 5,250 % fällig am 02.03.2025	\$ 2.500	2.498	Siemens Energy Finance BV 4,000 % fällig am 05.04.2026	1.000	1.089
Mizuho Financial Group, Inc. 5,628 % fällig am 13.06.2028	£ 2.100	2.493	QNB Finance Ltd. 3,500 % fällig am 28.03.2024	\$ 1.100	1.082
ING Belgium S.A. 3,375 % fällig am 31.05.2027	€ 2.300	2.474	Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023	1.100	1.070

(a) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN		KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN		ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>				<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	6.309.071	\$	62.826	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	2.313.916	\$	23.043
	<b>PAR (000S)</b>				<b>PAR (000S)</b>		
Shamrock Residential DAC 4,289 % fällig am 24.01.2061	€	23.831	25.327	Dufry One BV 3,625 % fällig am 15.04.2026	CHF	7.394	7.836
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$	17.535	17.051	Uber Technologies, Inc. 7,500 % fällig am 15.05.2025	\$	7.600	7.714
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)		16.094	15.563	INEOS Finance PLC 7,463 % fällig am 08.11.2027	€	7.059	7.534
Shamrock Residential DAC 4,439 % fällig am 24.06.2071	€	14.000	14.549	American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	\$	6.314	6.181
Dutch Property Finance BV 4,168 % fällig am 28.04.2064		12.400	13.348	Wynn Resorts Finance LLC 7,750 % fällig am 15.04.2025		4.404	4.404
Shamrock Residential DAC 4,689 % fällig am 24.02.2071		12.335	13.233	Pacific Gas & Electric Co. 3,150 % fällig am 01.01.2026		4.474	4.162
Harbour Energy PLC 5,457 % fällig am 28.01.2054	£	10.800	12.739	Sprint LLC 7,125 % fällig am 15.06.2024		3.842	3.895
Twin Bridges PLC 0,000 % fällig am 14.06.2055		10.000	12.427	Petco Health & Wellness Co., Inc. 1,000 % fällig am 03.03.2028		3.767	3.738
Atlas Funding PLC 5,937 % fällig am 20.01.2061		10.000	12.399	Bombardier, Inc. 7,500 % fällig am 15.03.2025		3.108	3.108
Kinbane DAC 4,263 % fällig am 25.09.2062	€	11.522	12.268	SkyMiles IP Ltd. 8,798 % fällig am 20.10.2027		2.992	3.100
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$	8.421	8.109	Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€	2.900	2.975
INEOS Finance PLC 7,463 % fällig am 08.11.2027	€	7.059	7.508	Uber Technologies, Inc. 8,000 % fällig am 01.11.2026	\$	2.585	2.646
T-Mobile USA, Inc. 4,800 % fällig am 15.07.2028	\$	7.000	6.985	Amgen, Inc. 5,150 % fällig am 02.03.2028		2.600	2.644
Brants Bridge PLC 0,000 % fällig am 14.06.2066	£	5.300	6.649	Wynn Macau Ltd. 5,625 % fällig am 26.08.2028		2.700	2.331
Adler Financing SARL 12,500 % fällig am 30.06.2025	€	5.771	5.902	VOC Escrow Ltd. 5,000 % fällig am 15.02.2028		2.600	2.294
Saxon Asset Securities Trust 5,490 % fällig am 25.10.2046	\$	5.136	4.933	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024		2.280	2.259
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)		4.243	4.153	Ford Motor Credit Co. LLC 2,700 % fällig am 10.08.2026		2.600	2.256
Credit Suisse AG 5,500 % fällig am 20.08.2026	€	3.200	3.402	PetSmart, Inc. 1,000 % fällig am 11.02.2028		2.132	2.114
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$	3.511	3.357	Ford Motor Credit Co. LLC 4,535 % fällig am 06.03.2025	£	1.801	2.071
NovaStar Mortgage Funding Trust 6,725 % fällig am 25.12.2034		3.509	3.287	Wynn Las Vegas LLC 5,500 % fällig am 01.03.2025	\$	1.733	1.688
Societe Generale S.A. 6,447 % fällig am 12.01.2027		3.200	3.200	Sunshine Luxembourg SARL 9,092 % fällig am 01.10.2026		1.716	1.685
				Sands China Ltd. 5,900 % fällig am 08.08.2028		1.700	1.617
				Sands China Ltd. 2,800 % fällig am 08.03.2027		1.700	1.483
				Broadcom, Inc. 3,469 % fällig am 15.04.2034		1.764	1.456
				Weir Group PLC 2,200 % fällig am 13.05.2026		1.600	1.419
				HSBC Holdings PLC 4,950 % fällig am 31.03.2030		1.320	1.285

(a) Der Low Duration Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		17.697.047	\$ 176.229	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		20.194.397	\$ 201.100
		PAR (000S)				PAR (000S)	
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF	4.500.000	13.149	Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN	29.700	7.351
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2023		4.484.000	12.922	Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029		27.500	6.597
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€	8.000	8.543	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£	5.200	5.309
Canadian Imperial Bank of Commerce 3,250 % fällig am 31.03.2027		3.200	3.436	Southern California Edison Co. 2,750 % fällig am 01.02.2032	\$	5.900	5.034
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % fällig am 06.04.2026		2.600	2.816	Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % fällig am 17.09.2030		5.400	4.850
Virginia Electric and Power Co. 3,750 % fällig am 15.05.2027	\$	2.900	2.789	Zayo Group Holdings, Inc. 8,217 % fällig am 09.03.2027		5.627	4.657
Goldman Sachs Group, Inc. 4,223 % fällig am 01.05.2029		2.500	2.371	Lazard Group LLC 4,500 % fällig am 19.09.2028		4.000	3.852
BPCE S.A. 4,625 % fällig am 12.09.2028		2.500	2.352	Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£	3.100	3.597
HSBC Holdings PLC 6,254 % fällig am 09.03.2034		2.100	2.106	Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % fällig am 15.03.2024	\$	3.500	3.409
Duke Energy Progress LLC 5,250 % fällig am 15.03.2033		2.000	2.041	HSBC Holdings PLC 2,999 % fällig am 10.03.2026		3.600	3.395
Enbridge, Inc. 5,700 % fällig am 08.03.2033		2.000	2.029	CenturyLink, Inc. 7,467 % fällig am 15.03.2027		4.381	3.330
AES Corp. 5,450 % fällig am 01.06.2028		2.000	1.978	Sagax AB 2,250 % fällig am 13.03.2025	€	2.900	3.004
American Tower Corp. 5,250 % fällig am 15.07.2028		2.000	1.972	Kronos Acquisition Holdings, Inc. 1,000 % fällig am 22.12.2026	\$	2.542	2.465
Wells Fargo & Co. 4,808 % fällig am 25.07.2028		2.000	1.959	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027		2.700	2.458
Humana, Inc. 3,700 % fällig am 23.03.2029		2.000	1.844	Hamburg Commercial Bank AG 0,500 % fällig am 22.09.2026	€	2.500	2.429
Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028		1.700	1.697	U.S. Foods, Inc. 7,943 % fällig am 22.11.2028	\$	2.413	2.419
Bank of America Corp. 4,376 % fällig am 27.04.2028		1.000	963	Grifols Escrow Issuer S.A. 3,875 % fällig am 15.10.2028	€	2.700	2.273
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,242 % fällig am 19.04.2029		600	600	United Airlines, Inc. 9,292 % fällig am 21.04.2028	\$	2.158	2.150
				OneMain Finance Corp. 6,125 % fällig am 15.03.2024		2.150	2.102

(a) Der Low Duration Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>		
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 5,500 % fällig am 09.03.2028	\$ 200	\$ 200
Weyerhaeuser Co. 4,750 % fällig am 15.05.2026	36	36
AES Corp. 5,450 % fällig am 01.06.2028	20	20

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
Weyerhaeuser Co. 3,375 % fällig am 09.03.2033	\$ 36	\$ 31
CommScope, Inc. 8,443 % fällig am 06.04.2026	20	19
U.S. Foods, Inc. 7,943 % fällig am 22.11.2028	16	16
CenturyLink, Inc. 7,467 % fällig am 15.03.2027	20	15

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
Kinder Morgan, Inc.	125.600	\$ 2.292	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	361.531	\$ 3.600
Antero Midstream Corp.	107.900	1.154	Equitrans Midstream Corp.	387.682	3.424
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	112.068	1.116	Enbridge, Inc.	62.400	2.421
ONEOK, Inc.	12.000	825	TC Energy Corp.	44.000	1.781
Hess Midstream LP 'A'	22.700	613	Pembina Pipeline Corp.	52.900	1.753
			Chesapeake Energy Corp.	19.000	1.544
			Pioneer Natural Resources Co.	6.200	1.333
			Diamondback Energy, Inc.	7.800	1.070
			Williams Cos., Inc.	32.100	1.004
			EnLink Midstream LLC	67.500	844
			Cheniere Energy, Inc.	5.000	765
			Targa Resources Corp.	9.700	731
			Antero Resources Corp.	26.400	704
			ONEOK, Inc.	10.400	598
			EQT Corp.	14.100	444
			ConocoPhillips	2.300	232

(a) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Mortgage Opportunities Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 198.308	\$ 201.259	Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 198.308	\$ 200.349
Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.02.2053	198.454	190.027	Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.02.2053	197.704	193.854
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052	193.733	189.987	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052	193.733	185.568
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053	109.386	109.767	Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053	108.295	108.145
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.07.2053	100.000	98.254	Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.01.2053	99.467	99.750
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.04.2053	98.975	96.876	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.12.2052	99.248	94.999
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.01.2053	98.116	96.035	Fannie Mae 4,500 % fällig am 01.10.2052	97.237	93.138
Fannie Mae 4,500 % fällig am 01.10.2052	97.237	95.357	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.04.2053	85.000	81.882
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2053	94.223	88.632	Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.02.2053	74.655	75.424
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.02.2053	74.655	75.696	Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.01.2053	74.876	73.347
Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.01.2053	74.876	73.569	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.06.2051	21.807	20.043
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.03.2053	49.662	47.553	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.06.2051	21.386	19.656
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.06.2053	14.926	14.880	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.12.2050	15.540	14.283
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.05.2053	10.945	11.158	Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC 6,404 % fällig am 21.10.2028	£ 11.400	14.067
Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.10.2052	8.500	7.872	Trinity Square PLC 5,866 % fällig am 15.07.2059	9.600	11.671
Chester B1 Issuer PLC 5,766 % fällig am 17.01.2058	£ 5.888	7.337	Ashford Hospitality Trust 7,419 % fällig am 15.04.2035	\$ 12.000	11.475
Freddie Mac 4,660 % fällig am 25.01.2031	\$ 2.200	2.200	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.06.2051	11.638	10.697
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.04.2050	2.264	2.099	Stratton Mortgage Funding PLC 5,991 % fällig am 20.07.2060	£ 8.100	9.955
Fannie Mae 4,500 % fällig am 01.11.2032	2.000	2.021	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,440 % fällig am 25.10.2047	\$ 10.000	8.588
Fannie Mae 4,374 % fällig am 01.02.2028	2.000	1.990	Long Beach Mortgage Loan Trust 5,470 % fällig am 25.10.2036	22.577	7.462

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		7.918.177	\$ 78.848	Ripon Mortgages PLC 5,491 % fällig am 28.08.2056	£	12.228	\$ 14.381
				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 6,245 % fällig am 25.04.2036	\$	11.300	10.622
				AKTIEN			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$	31.988	31.148	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		863.561	8.600
Bumper FR 4,113 % fällig am 27.04.2032	€	14.200	15.378				
Jupiter Mortgage PLC 5,291 % fällig am 20.07.2060	£	11.540	14.424				
LT Autorahoitus DAC 4,250 % fällig am 17.12.2032	€	12.869	14.113	Taurus FR DAC 4,787 % fällig am 22.12.2030	€	7.079	7.500
Silver Arrow Athlon NL BV 4,139 % fällig am 26.04.2031		12.757	13.805	Stratton Mortgage Funding PLC 5,565 % fällig am 12.12.2043	£	5.578	6.521
LT Autorahoitus DAC 4,040 % fällig am 18.07.2033		10.400	11.371	Logicor Financing S.A.R.L. 2,250 % fällig am 13.05.2025	€	6.000	5.851
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.11.2027	\$	12.800	11.112	Quanta Services, Inc. 0,950 % fällig am 01.10.2024	\$	6.300	5.813
Tower Bridge Funding PLC 5,399 % fällig am 21.07.2064	£	7.994	10.073	Frost CMBS DAC 4,533 % fällig am 20.11.2033	€	4.870	4.967
Hill FL BV 4,050 % fällig am 18.05.2030	€	8.544	9.360	Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	\$	6.500	4.696
Twin Bridges PLC 5,635 % fällig am 01.12.2055	£	7.588	9.321	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,440 % fällig am 25.10.2047		5.400	4.686
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.12.2027	\$	10.700	9.269	Hyatt Hotels Corp. 1,800 % fällig am 01.10.2024		4.600	4.321
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 4,200 % fällig am 15.07.2046		9.084	9.039	Park Place Securities, Inc. 6,080 % fällig am 25.05.2035		4.326	3.899
Toronto-Dominion Bank 4,701 % fällig am 05.06.2027		9.000	9.000	Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	€	5.000	3.864
WFRBS Commercial Mortgage Trust 3,073 % fällig am 15.06.2046		8.856	8.815	Broadcom, Inc. 4,000 % fällig am 15.04.2029	\$	4.000	3.757
London Wall Mortgage Capital PLC 5,452 % fällig am 15.05.2051	£	6.695	8.227	Nomura Resecuritization Trust 6,050 % fällig am 25.03.2037		3.691	3.567
Hill FL BV 4,110 % fällig am 18.05.2031	€	7.400	8.129	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,430 % fällig am 25.12.2046		3.353	3.068
Silver Arrow S.A. 3,768 % fällig am 15.02.2030		7.245	7.926	RAMP Series Trust 5,510 % fällig am 25.08.2046		3.188	2.879
Towd Point Mortgage Trust 3,750 % fällig am 25.10.2056	\$	8.100	7.642	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 5,590 % fällig am 25.07.2036		3.200	2.845
UniCredit SpA 3,375 % fällig am 31.01.2027	€	6.200	6.610	Option One Mortgage Loan Trust 5,280 % fällig am 25.07.2037		4.220	2.767
Nykredit Realkredit A/S 5,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	42.800	6.126	Long Beach Mortgage Loan Trust 6,065 % fällig am 25.08.2035		3.000	2.674
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 3,602 % fällig am 16.02.2026	€	5.000	5.496	Countrywide Alternative Loan Trust 5,347 % fällig am 20.09.2046		2.718	2.636
Bank of Nova Scotia 3,050 % fällig am 31.10.2024		5.000	5.453	Home Equity Asset Trust 5,450 % fällig am 25.01.2037		2.936	2.525
Korea Housing Finance Corp. 0,010 % fällig am 05.02.2025		5.000	5.123	European Loan Conduit DAC 4,358 % fällig am 17.02.2030	€	2.293	2.427
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 4,218 % fällig am 15.07.2046	\$	5.150	5.111	Jackson National Life Global Funding 6,242 % fällig am 28.06.2024	\$	2.200	2.203
Korea Housing Finance Corp. 0,010 % fällig am 07.07.2025	€	5.000	5.051	Fremont Home Loan Trust 5,765 % fällig am 25.11.2035		2.400	2.085
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 4,675 % fällig am 15.06.2026	\$	5.000	5.000	245 Park Avenue Trust 3,508 % fällig am 05.06.2037		2.300	2.037
Hops Hill PLC 0,000 % fällig am 21.12.2055	£	3.400	4.219	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 6,320 % fällig am 25.03.2035		2.100	1.906
American Honda Finance Corp. 5,000 % fällig am 23.05.2025	\$	4.100	4.097	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 7,100 % fällig am 25.08.2035		2.000	1.861
Ginkgo Sales Finance 4,113 % fällig am 25.11.2049	€	3.652	4.008	Credit Suisse Mortgage Capital Trust 1,115 % fällig am 25.01.2060		2.174	1.819
Barclays PLC 5,829 % fällig am 09.05.2027	\$	3.900	3.900	Credit Suisse Mortgage Capital Trust 2,688 % fällig am 25.03.2059		1.674	1.622
				Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % fällig am 17.09.2030		1.600	1.377

(a) Der StocksPLUS™ Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	41.362	\$ 412	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	20.084	\$ 200
	PAR (000S)			PAR (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	\$ 307	292	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.02.2044 (b)	\$ 128	127
Palmer Square European Loan Funding DAC 4,727 % fällig am 15.11.2032	€ 100	106	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	103	97
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 4,200 % fällig am 15.07.2046	\$ 100	100	VICI Properties LP 3,750 % fällig am 15.02.2027	100	92
CSAIL Commercial Mortgage Trust 3,504 % fällig am 15.06.2057	100	96	245 Park Avenue Trust 3,508 % fällig am 05.06.2037	100	89
WFRBS Commercial Mortgage Trust 3,073 % fällig am 15.06.2046	81	81	Warnermedia Holdings, Inc. 4,279 % fällig am 15.03.2032	100	88
			Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 71	8

(a) Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Strategic Income Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	11.067.226	\$ 110.199	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	11.709.681	\$ 116.600
	<b>PAR (000S)</b>			<b>PAR (000S)</b>	
UBS Group AG 5,959 % fällig am 12.01.2034	\$ 3.458	3.463	INEOS Finance PLC 7,463 % fällig am 08.11.2027	€ 4.307	4.591
	<b>AKTIEN</b>		GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2031	\$ 3.748	3.316
Coca-Cola Co.	53.447	3.227	Community Health Systems, Inc. 5,625 % fällig am 15.03.2027	3.611	3.121
ConocoPhillips Co.	19.251	1.969		<b>AKTIEN</b>	
Amgen, Inc.	7.620	1.817	Philip Morris International, Inc.	27.716	2.584
	<b>PAR (000S)</b>		Merck & Co., Inc.	21.585	2.361
Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034	\$ 1.800	1.806	Iberdrola S.A.	166.615	2.125
Amgen, Inc. 5,250 % fällig am 02.03.2033	1.800	1.794	KDDI Corp.	65.000	2.055
Societe Generale S.A. 6,446 % fällig am 10.01.2029	1.700	1.700	General Dynamics Corp.	8.832	2.041
	<b>AKTIEN</b>		ConocoPhillips Co.	19.251	1.873
Unilever PLC	30.120	1.640		<b>PAR (000S)</b>	
	<b>PAR (000S)</b>		Amgen, Inc. 5,250 % fällig am 02.03.2033	\$ 1.800	1.857
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.11.2027	\$ 1.860	1.615	Pacific Gas & Electric Co. 3,500 % fällig am 15.06.2025	1.891	1.801
	<b>AKTIEN</b>		Petroleos Mexicanos 6,700 % fällig am 16.02.2032	2.234	1.677
PACCAR, Inc.	21.032	1.603	Turkey Government International Bond 4,250 % fällig am 13.03.2025	1.800	1.667
Park Hotels & Resorts, Inc.	110.723	1.435		<b>AKTIEN</b>	
3M Co.	14.293	1.412	General Mills, Inc.	19.941	1.609
Kimberly-Clark Corp.	10.372	1.407	Exxon Mobil Corp.	14.569	1.560
Iberdrola S.A.	116.097	1.321		<b>PAR (000S)</b>	
AbbVie, Inc.	9.122	1.319	Wynn Macau Ltd. 5,125 % fällig am 15.12.2029	\$ 1.840	1.537
Valero Energy Corp.	10.385	1.318		<b>AKTIEN</b>	
	<b>PAR (000S)</b>		Novartis AG	15.483	1.524
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	\$ 1.329	1.301		<b>PAR (000S)</b>	
	<b>AKTIEN</b>		Russia Government International Bond 5,930 % fällig am 24.04.2024	RUB 187.500	1.408
Holcim AG	20.846	1.291	Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 6,896 % fällig am 15.01.2025	\$ 1.400	1.396
MediaTek, Inc.	49.000	1.201			

(a) Der Strategic Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	70.671.667	\$ 703.727	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	74.150.247	\$ 738.400
	PAR (000S)			PAR (000S)	
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.04.2053	\$ 62.864	62.714	U.S. Treasury Bonds 3,625 % fällig am 15.02.2053	\$ 27.300	26.208
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2053	40.982	41.034	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032	25.000	23.683
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	38.037	37.206	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % fällig am 15.01.2026	€ 15.000	15.832
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.06.2053	34.340	34.377	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 28.02.2027	\$ 16.700	15.716
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2052	30.800	33.069	U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.08.2050	26.000	14.853
U.S. Treasury Bonds 3,625 % fällig am 15.02.2053	27.300	27.414	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	13.175	13.817
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	21.480	20.693	Logicor Financing SARL 2,250 % fällig am 13.05.2025	€ 11.000	10.930
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2053	20.000	19.916	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	\$ 11.300	10.519
Ginnie Mae 5,966 % fällig am 20.01.2073	17.000	16.983	Goldman Sachs Group, Inc. 5,700 % fällig am 01.11.2024	9.900	10.017
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b)	19.203	16.026	Prologis International Funding S.A. 3,125 % fällig am 01.06.2031	€ 10.000	9.978
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,250 % fällig am 15.04.2028 (b)	13.951	13.543	Deutsche Bank AG 1,000 % fällig am 19.11.2025	10.000	9.937
TP ICAP Finance PLC 7,875 % fällig am 17.04.2030	£ 9.800	12.133	Digital Intrepid Holding BV 0,625 % fällig am 15.07.2031	10.300	8.167
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043	\$ 12.400	12.130	Equinix, Inc. 1,000 % fällig am 15.09.2025	\$ 8.600	7.765
Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc. 4,231 % fällig am 15.09.2060	10.900	10.574	Volkswagen Bank GmbH 1,875 % fällig am 31.01.2024	€ 7.500	7.765
Benchmark Mortgage Trust 3,666 % fällig am 15.01.2051	11.100	10.541	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	7.000	7.358
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030	10.500	10.500	Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,375 % fällig am 27.07.2029	7.400	6.531
Ginnie Mae 5,966 % fällig am 20.01.2073	9.442	9.440	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,125 % fällig am 04.09.2026	7.600	5.736
Mercedes-Benz Finance North America LLC 4,800 % fällig am 30.03.2028	9.300	9.287	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,710 % fällig am 13.01.2030	\$ 4.800	5.009
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.05.2053	9.390	9.219	Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 10.06.2026	€ 4.450	4.514

(a) Der Total Return Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.253.620	\$ 141.935	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	13.426.751	\$ 133.700
	PAR (000S)		PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	201.340	20.003
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥ 3.784.000	29.685		PAR (000S)	
CPPIB Capital, Inc. 6,338 % fällig am 11.03.2026	\$ 11.000	11.240	CPPIB Capital, Inc. 6,338 % fällig am 11.03.2026	\$ 11.000	11.238
Federal Home Loan Bank 5,370 % fällig am 21.05.2024	8.500	8.500	Federal Home Loan Bank 5,370 % fällig am 21.05.2024	8.500	8.499
Svensk Exportkredit AB 6,090 % fällig am 23.02.2024	8.000	8.065	Svensk Exportkredit AB 6,090 % fällig am 23.02.2024	8.000	8.049
Federal Home Loan Bank 5,350 % fällig am 17.05.2024	8.000	8.000	Federal Home Loan Bank 5,350 % fällig am 17.05.2024	8.000	7.998
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,400 % fällig am 15.07.2031	5.996	5.939	Freddie Mac 5,375 % fällig am 24.04.2025	4.300	4.300
Morgan Stanley 5,519 % fällig am 25.01.2024	4.500	4.497	KeyBank N.A. 5,432 % fällig am 03.01.2024	2.000	1.968
Freddie Mac 5,375 % fällig am 24.04.2025	4.300	4.300	Gilead Sciences, Inc. 0,750 % fällig am 29.09.2023	1.900	1.868
Toyota Motor Credit Corp. 5,569 % fällig am 10.01.2025	4.200	4.200	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 0,750 % fällig am 02.09.2023	1.500	1.480
Transpower New Zealand Ltd. 5,750 % fällig am 28.08.2023	AUD 6.000	4.159	Huntington National Bank 6,260 % fällig am 16.05.2025	1.100	1.055
Federal Home Loan Bank 5,360 % fällig am 10.05.2024	\$ 4.000	4.000	Bank of Nova Scotia 0,550 % fällig am 15.09.2023	1.000	983
Bank of America Corp. 3,550 % fällig am 05.03.2024	4.000	3.994	Central Japan Railway Co. 3,400 % fällig am 06.09.2023	900	894
RELX Capital, Inc. 3,500 % fällig am 16.03.2023	4.000	3.992	Mercedes-Benz Finance North America LLC 5,500 % fällig am 27.11.2024	800	808
Eni SpA 4,000 % fällig am 12.09.2023	4.000	3.973	MassMutual Global Funding 5,068 % fällig am 02.06.2023	800	800
Thermo Fisher Scientific, Inc. 5,562 % fällig am 18.10.2024	3.800	3.798	Mitsubishi Corp. 3,375 % fällig am 23.07.2024	600	588
Export-Import Bank of Korea 4,628 % fällig am 30.10.2023	AUD 5.700	3.773	SK Hynix, Inc. 1,000 % fällig am 19.01.2024	600	581
Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd. 3,100 % fällig am 17.04.2023	5.000	3.547	Duke Energy Corp. 0,260 % fällig am 10.06.2023	500	500
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,850 % fällig am 25.03.2024	\$ 3.700	3.517	Province of Quebec 5,520 % fällig am 21.05.2024	500	500
National Bank of Canada 5,579 % fällig am 06.08.2024	3.500	3.489	Coöperatieve Rabobank UA 1,980 % fällig am 15.12.2027	500	445

(a) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
United Kingdom Gilt 1,625 % fällig am 22.10.2028	£ 17.700	£ 15.897	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 31.01.2023	£ 47.450	£ 47.365
United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.10.2025	14.900	14.650	<b>AKTIEN</b>		
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 30.01.2026	14.100	12.761	PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)	51.000	5.189
United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049	4.600	4.754	<b>PAR (000S)</b>		
United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053	3.300	3.082	United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049	£ 4.300	4.656
Credit Suisse AG 7,750 % fällig am 10.03.2026	1.900	1.897	HSBC Holdings PLC 2,625 % fällig am 16.08.2028	1.400	1.270
Barclays PLC 6,369 % fällig am 31.01.2031	1.800	1.807	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 1,125 % fällig am 11.02.2027	1.400	1.252
Weir Group PLC 6,875 % fällig am 14.06.2028	1.800	1.796	East Japan Railway Co. 1,162 % fällig am 15.09.2028	1.500	1.230
CPPIB Capital, Inc. 6,000 % fällig am 07.06.2025	1.700	1.698	Informa PLC 3,125 % fällig am 05.07.2026	1.345	1.226
Royal Bank of Canada 5,000 % fällig am 24.01.2028	1.700	1.696	Standard Chartered PLC 7,767 % fällig am 16.11.2028	\$ 1.300	1.159
ENW Finance PLC 4,893 % fällig am 24.11.2032	1.700	1.687	Rentokil Initial PLC 5,000 % fällig am 27.06.2032	£ 1.200	1.121
Motability Operations Group PLC 4,875 % fällig am 17.01.2043	1.500	1.495	MPT Operating Partnership LP 2,500 % fällig am 24.03.2026	1.400	1.105
HSBC Holdings PLC 3,000 % fällig am 22.07.2028	1.400	1.287	Hamburg Commercial Bank AG 6,250 % fällig am 18.11.2024	€ 1.100	1.003
Lloyds Banking Group PLC 2,000 % fällig am 12.04.2028	1.400	1.201	Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 22.12.2028	£ 1.200	991
BP Capital Markets PLC 5,773 % fällig am 25.05.2038	1.200	1.200	Northumbrian Water Finance PLC 6,375 % fällig am 28.10.2034	950	969
Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 25.01.2035	1.200	1.181	Oracle Corp. 6,150 % fällig am 09.11.2029	\$ 1.100	954
National Grid Electricity Transmission PLC 5,272 % fällig am 18.01.2043	1.100	1.100	UBS Group AG 7,375 % fällig am 07.09.2033	£ 1.000	946
BNP Paribas S.A. 5,750 % fällig am 13.06.2032	1.100	1.099	Commerzbank AG 8,625 % fällig am 28.02.2033	900	905
Deutsche Bank AG 6,125 % fällig am 12.12.2030	1.100	1.096	Heathrow Funding Ltd. 4,625 % fällig am 31.10.2046	1.100	903
Heathrow Funding Ltd. 2,750 % fällig am 09.08.2051	1.600	1.025	Citigroup, Inc. 4,500 % fällig am 03.03.2031	1.000	892
			Deutsche Bank AG 6,125 % fällig am 12.12.2030	900	877
			Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 1.300	873

(a) Der UK Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des UK Long Term Corporate Bond Fund 30. Juni 2023

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 31.07.2051	£ 25.300	£ 14.813	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 31.01.2023	£ 5.060	£ 5.054
United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049	3.900	4.031	United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049	3.900	4.223
United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053	2.800	2.615	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % fällig am 15.09.2026	3.400	3.047
British Telecommunications PLC 5,750 % fällig am 13.02.2041	2.500	2.372	Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 22.12.2028	3.600	2.982
Cooperatieve Rabobank UA 5,250 % fällig am 23.05.2041	2.050	2.187	United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2046	2.600	2.477
National Grid Electricity Transmission PLC 5,272 % fällig am 18.01.2043	2.000	2.000	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 31.07.2051	4.900	2.406
Walmart, Inc. 5,250 % fällig am 28.09.2035	1.800	1.856	United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 22.07.2047	3.800	2.194
Electricite de France S.A. 5,625 % fällig am 25.01.2053	1.900	1.846	United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.03.2036	1.900	1.962
Tesco Corporate Treasury Services PLC 5,500 % fällig am 27.02.2035	1.800	1.785	Europäische Investitionsbank 6,000 % fällig am 07.12.2028	1.700	1.877
National Gas Transmission PLC 5,750 % fällig am 05.04.2035	1.850	1.778	Oracle Corp. 6,900 % fällig am 09.11.2052	\$ 1.900	1.639
United Utilities Water Finance PLC 5,750 % fällig am 26.06.2036	1.700	1.693	United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.01.2045	£ 1.900	1.635
Credit Agricole S.A. 4,875 % fällig am 23.10.2029	1.600	1.589	Credit Agricole S.A. 4,875 % fällig am 23.10.2029	1.600	1.596
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3,750 % fällig am 10.09.2042	1.800	1.509	Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % fällig am 29.12.2049	€ 1.481	1.237
Walmart, Inc. 5,625 % fällig am 27.03.2034	1.400	1.496	Virgin Money UK PLC 4,000 % fällig am 03.09.2027	£ 1.235	1.108
Pfizer, Inc. 2,735 % fällig am 15.06.2043	2.000	1.402	MPT Operating Partnership LP 3,692 % fällig am 05.06.2028	1.400	1.039
Tesco Property Finance PLC 5,411 % fällig am 13.07.2044	1.449	1.365	Citigroup, Inc. 3,878 % fällig am 24.01.2039	\$ 1.500	1.006
Comcast Corp. 1,875 % fällig am 20.02.2036	1.900	1.335	MPT Operating Partnership LP 3,375 % fällig am 24.04.2030	£ 1.600	1.004
McDonald's Corp. 3,750 % fällig am 31.05.2038	1.600	1.312	Cooperatieve Rabobank UA 5,250 % fällig am 14.09.2027	1.050	995
Yorkshire Water Finance PLC 5,500 % fällig am 28.04.2035	1.300	1.278	CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 2,625 % fällig am 17.10.2034	1.350	916
Enel SpA 5,750 % fällig am 22.06.2037	1.300	1.270	NatWest Group PLC 2,057 % fällig am 09.11.2028	1.000	860
Tesco Property Finance PLC 5,744 % fällig am 13.04.2040	1.220	1.211			
Diageo Finance PLC 2,750 % fällig am 08.06.2038	1.600	1.204			
Southern Water Services Finance Ltd. 3,000 % fällig am 28.05.2037	1.700	1.200			
Clarion Funding PLC 1,875 % fällig am 22.01.2035	1.600	1.116			
Motability Operations Group PLC 4,875 % fällig am 17.01.2043	1.100	1.098			
Deutsche Telekom AG 3,125 % fällig am 06.02.2034	1.300	1.064			
Gatwick Funding Ltd. 2,875 % fällig am 05.07.2051	1.800	1.049			
Investor AB 5,500 % fällig am 05.05.2037	1.000	1.023			

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	44.264.451	\$ 440.792	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	41.382.866	\$ 412.100
	PAR (000S)			PAR (000S)	
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	\$ 25.000	24.384	U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 15.10.2025	\$ 23.000	22.700
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2027	10.000	10.149	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.11.2027	15.700	15.734
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % fällig am 01.06.2031	10.100	10.100	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025	10.000	9.865
Trident TPI Holdings, Inc. 12,750 % fällig am 31.12.2028	9.750	9.647	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.10.2027	9.000	9.006
Medline Borrower LP 5,250 % fällig am 01.10.2029	10.750	9.297	Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032	7.000	8.565
Grifols Escrow Issuer S.A. 4,750 % fällig am 15.10.2028	8.700	7.496	Heartland Dental LLC 8,500 % fällig am 01.05.2026	9.000	8.010
Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % fällig am 01.07.2031	6.250	6.164	Global Medical Response, Inc. 6,500 % fällig am 01.10.2025	10.000	6.050
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	6.000	6.000	White Cap Buyer LLC 6,875 % fällig am 15.10.2028	6.800	6.001
American Airlines, Inc. 5,750 % fällig am 20.04.2029	5.700	5.441	Sprint Capital Corp. 6,875 % fällig am 15.11.2028	5.000	5.410
Triumph Group, Inc. 9,000 % fällig am 15.03.2028	5.250	5.250	LBM Acquisition LLC 6,250 % fällig am 15.01.2029	6.725	5.274
AMC Networks, Inc. 4,750 % fällig am 01.08.2025	5.700	5.248	Park River Holdings, Inc. 5,625 % fällig am 01.02.2029	7.000	5.140
Clarios Global LP 6,750 % fällig am 15.05.2028	5.000	5.000	Sprint LLC 7,625 % fällig am 15.02.2025	5.000	5.128
Albertsons Cos., Inc. 6,500 % fällig am 15.02.2028	5.000	5.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 6,750 % fällig am 15.10.2027	5.000	4.602
TransDigm, Inc. 6,750 % fällig am 15.08.2028	5.000	4.975	McAfee Corp. 7,375 % fällig am 15.02.2030	5.000	4.275
NGL Energy Operating LLC 7,500 % fällig am 01.02.2026	4.575	4.492	Occidental Petroleum Corp. 6,450 % fällig am 15.09.2036	4.000	4.072
EQM Midstream Partners LP 4,500 % fällig am 15.01.2029	4.700	4.234	Virgin Media Finance PLC 5,000 % fällig am 15.07.2030	5.000	3.968
Transocean Titan Financing Ltd. 8,375 % fällig am 01.02.2028	4.000	4.000	Occidental Petroleum Corp. 5,500 % fällig am 01.12.2025	4.000	3.955
Radiate Holdco LLC 4,500 % fällig am 15.09.2026	5.000	3.900	Park River Holdings, Inc. 6,750 % fällig am 01.08.2029	5.000	3.863
MajorDrive Holdings LLC 6,375 % fällig am 01.06.2029	4.800	3.808	BCPE Ulysses Intermediate, Inc. 7,750 % fällig am 01.04.2027	5.000	3.856

(a) Der US High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	869.780	\$ 8.661	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	\$ 6.200	\$ 6.249
	PAR (000S)		U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2045	7.300	5.736
U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.05.2033	\$ 7.700	7.473	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032	5.300	5.559
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032	5.300	5.542	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2052	5.100	5.230
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2052	5.100	5.509		AKTIEN	
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.02.2033	4.400	4.452	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	381.593	3.800
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.02.2043	4.400	4.416		PAR (000S)	
U.S. Treasury Bonds 3,625 % fällig am 15.02.2053	3.800	3.722	U.S. Treasury Bonds 3,625 % fällig am 15.02.2053	\$ 3.800	3.634
Morgan Stanley 5,250 % fällig am 21.04.2034	3.600	3.600	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032	2.900	2.760
Synchrony Financial 7,250 % fällig am 02.02.2033	3.600	3.587	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	2.764	2.518
Bank of America Corp. 5,268 % fällig am 25.04.2034	3.500	3.500	U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.08.2042	2.800	2.490
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	3.452	3.365	Vonovia SE 0,000 % fällig am 01.12.2025	€ 2.300	2.175
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	3.200	3.348	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	\$ 2.600	2.154
Amgen, Inc. 5,600 % fällig am 02.03.2043	3.075	3.066	Synchrony Financial 7,250 % fällig am 02.02.2033	2.400	2.127
Duke Energy Ohio, Inc. 5,650 % fällig am 01.04.2053	2.400	2.437	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % fällig am 16.11.2025	2.006	1.954
Apple, Inc. 4,850 % fällig am 10.05.2053	2.100	2.089	DaVita, Inc. 4,625 % fällig am 01.06.2030	2.200	1.829
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030	2.000	2.000	Elanco Animal Health, Inc. 1,000 % fällig am 01.08.2027	1.543	1.520
Philip Morris International, Inc. 5,125 % fällig am 15.02.2030	2.000	1.984	Wynn Resorts Finance LLC 7,125 % fällig am 15.02.2031	1.500	1.493
Elevance Health, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2033	1.800	1.797	U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043	1.300	1.268
Wynn Resorts Finance LLC 7,125 % fällig am 15.02.2031	1.500	1.500	DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024	1.250	1.198
CVS Health Corp. 5,125 % fällig am 21.02.2030	1.500	1.490	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.08.2028	1.188	1.002
UBS Group AG 5,959 % fällig am 12.01.2034	1.400	1.400	JPMorgan Chase & Co. 4,851 % fällig am 25.07.2028	1.000	1.001
Southern California Gas Co. 5,200 % fällig am 01.06.2033	1.300	1.297	Citizens Bank N.A. 4,575 % fällig am 09.08.2028	1.000	977
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 5,340 % fällig am 19.05.2063	1.300	1.275	Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	1.200	947
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043	1.300	1.257	Lloyds Banking Group PLC 4,716 % fällig am 11.08.2026	900	888
			Freedom Mortgage Corp. 8,125 % fällig am 15.11.2024	900	868
			Lloyds Banking Group PLC 4,976 % fällig am 11.08.2033	900	859
			U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.02.2043	800	783
			UDR, Inc. 3,000 % fällig am 15.08.2031	900	771
			Lloyds Banking Group PLC 4,375 % fällig am 22.03.2028	800	759
			Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.03.2029	800	707

(a) Der US Investment Grade Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2023</b>		
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	\$ 71.500	\$ 71.193	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	\$ 71.500	\$ 71.556
Federal Home Loan Bank 5,500 % fällig am 08.05.2025	38.000	38.000	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025	63.700	62.354
Freddie Mac 5,950 % fällig am 21.03.2025	33.000	33.000	Federal Home Loan Bank 1,115 % fällig am 26.02.2027	31.500	27.837
Freddie Mac 5,550 % fällig am 09.05.2025	25.000	25.000	Federal Home Loan Bank 0,900 % fällig am 26.02.2027	26.500	22.994
Federal Home Loan Bank 5,480 % fällig am 26.02.2025	22.400	22.400	Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.07.2051	25.968	22.345
Freddie Mac 5,520 % fällig am 28.05.2025	22.400	22.400	Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.06.2051	22.856	19.763
Freddie Mac 5,820 % fällig am 20.03.2025	21.000	21.000	AKTIEN		
Freddie Mac 5,680 % fällig am 03.04.2025	21.000	21.000	<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)</b>	198.700	19.741
Freddie Mac 5,730 % fällig am 03.04.2025	21.000	21.000	PAR (000S)		
Federal Home Loan Bank 5,650 % fällig am 28.05.2025	21.000	21.000	Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung		
Morgan Stanley 0,790 % fällig am 30.05.2025	21.500	20.390	0,850 % fällig am 10.02.2027	\$ 18.800	16.711
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. 6,395 % fällig am 19.10.2031	20.250	20.136	Bayer U.S. Finance LLC 3,875 % fällig am 15.12.2023	15.979	15.819
Federal Home Loan Bank 5,710 % fällig am 14.03.2025	20.000	20.000	Danske Bank A/S 5,375 % fällig am 12.01.2024	14.850	14.765
Freddie Mac 5,800 % fällig am 03.07.2025	20.000	20.000	Wells Fargo & Co. 6,372 % fällig am 25.04.2026	14.500	14.617
Athene Global Funding 5,790 % fällig am 24.05.2024	14.200	14.073	BAT Capital Corp. 3,222 % fällig am 15.08.2024	14.750	14.315
HCA, Inc. 5,000 % fällig am 15.03.2024	14.000	13.906	AerCap Ireland Capital DAC 1,150 % fällig am 29.10.2023	12.950	12.734
CIFC Funding Ltd. 6,323 % fällig am 24.04.2030	13.891	13.791	Santander UK Group Holdings PLC 1,089 % fällig am 15.03.2025	12.800	12.249
Westpac Banking Corp. 4,862 % fällig am 16.11.2023	AUD 20.000	13.782	Eni SpA 4,000 % fällig am 12.09.2023	11.800	11.743
Goldman Sachs Group, Inc. 1,757 % fällig am 24.01.2025	\$ 13.100	12.714	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.06.2051	13.399	11.253
Barclays PLC 3,932 % fällig am 07.05.2025	12.800	12.522	AerCap Ireland Capital DAC 4,500 % fällig am 15.09.2023	10.000	9.940
Bank of America Corp. 0,976 % fällig am 22.04.2025	12.500	11.926	Credit Agricole S.A. 6,570 % fällig am 22.03.2024	9.400	9.439
Boeing Co. 1,433 % fällig am 04.02.2024	10.900	10.557	Bank of America Corp. 5,791 % fällig am 24.10.2024	7.500	7.502
Freddie Mac 5,375 % fällig am 24.04.2025	10.000	10.000	BPCE S.A. 4,000 % fällig am 15.04.2024	7.500	7.385
Warnermedia Holdings, Inc. 3,428 % fällig am 15.03.2024	10.125	9.921	BNP Paribas S.A. 3,800 % fällig am 10.01.2024	7.280	7.195
JPMorgan Chase & Co. 4,023 % fällig am 05.12.2024	10.000	9.877	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,875 % fällig am 18.09.2023	7.200	7.106
AerCap Ireland Capital DAC 1,150 % fällig am 29.10.2023	10.000	9.752	Goldman Sachs Group, Inc. 0,925 % fällig am 21.10.2024	6.700	6.546
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 6,439 % fällig am 13.01.2026	9.700	9.700	Nordea Bank Abp 6,403 % fällig am 30.08.2023	6.000	6.007
Morgan Stanley 3,737 % fällig am 24.04.2024	9.350	9.323	7-Eleven, Inc. 0,800 % fällig am 10.02.2024	6.000	5.779
CNH Industrial Capital LLC 4,200 % fällig am 15.01.2024	9.000	8.924			
Bayer U.S. Finance LLC 3,875 % fällig am 15.12.2023	8.479	8.391			

(a) Der US Short-Term Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



## Glossar: (möglicherweise im vorstehenden Abschluss verwendete Abkürzungen)

### Abkürzungen der Kontrahenten:

AZD	Australia and New Zealand Banking Group	DUB	Deutsche Bank AG	MSC	Morgan Stanley & Co. LLC.
BOA	Bank of America N.A.	FAR	Wells Fargo Bank National Association	MYC	Morgan Stanley Capital Services LLC
BOM	Bank of Montreal	FBF	Credit Suisse International	MYI	Morgan Stanley & Co. International PLC
BOS	BofA Securities, Inc.	FCT	Credit Suisse Capital LLC	NOM	Nomura Securities International, Inc.
BPG	BNP Paribas Securities Corp.	FICC	Fixed Income Clearing Corporation	NXN	Natixis New York
BPS	BNP Paribas S.A.	GLM	Goldman Sachs Bank USA	PER	Pershing LLC
BRC	Barclays Bank PLC	GRE	NatWest Markets Securities, Inc.	RBC	Royal Bank of Canada
				RCY	Royal Bank of Canada
BSH	Banco Santander S.A. - New York Branch	GSC	Goldman Sachs & Co. LLC	RDR	RBC Capital Markets LLC
BSN	The Bank of Nova Scotia - Toronto	GST	Goldman Sachs International	RVM	Barclays Capital, Inc.
BSS	Banco Santander S.A.	HUS	HSBC Bank USA N.A.	RYL	NatWest Markets Plc
BYL	Barclays Bank PLC Niederlassung London	IND	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	SAL	Citigroup Global Markets, Inc.
BYR	The Bank of Nova Scotia - Toronto				
CBK	Citibank N.A.	JLN	JP Morgan Chase Bank N.A. London	SCX	Standard Chartered Bank, London
CDI	Natixis Singapore	JML	JP Morgan Securities Plc	SOG	Societe Generale Paris
CIB	Canadian Imperial Bank of Commerce	JPM	JP Morgan Chase Bank N.A.	SSB	State Street Bank and Trust Co.
CKL	Citibank N.A. London	JPS	J.P. Morgan Securities LLC	TDM	TD Securities (USA) LLC
CLY	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	MAC	Macquarie Bank Limited	TOR	The Toronto-Dominion Bank
COM	Commerz Bank AG	MBC	HSBC Bank Plc	UAG	UBS AG Stamford
CSN	Credit Suisse AG (New York)	MEI	Merrill Lynch International	UBS	UBS Securities LLC
DBL	Deutsche Bank AG London	MFK	Barclays Capital, Inc.		
DEU	Deutsche Bank Securities, Inc.				

### Währungskürzel:

AED	Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	GHS	Ghanaischer Cedi	PHP	Philippinischer Peso
ARS	Argentinischer Peso	HKD	Hongkong-Dollar	PLN	Polnischer Zloty
AUD	Australischer Dollar	HUF	Ungarischer Forint	RON	Rumänischer neuer Leu
BRL	Brasilianischer Real	IDR	Indonesische Rupie	RSD	Serbischer Dinar
CAD	Kanadischer Dollar	ILS	Israelischer Shekel	RUB	Russischer Rubel
CHF	Schweizer Franken	INR	Indische Rupie	SEK	Schwedische Krone
CLP	Chilenischer Peso	JPY (oder ¥)	Japanischer Yen	SGD	Singapur-Dollar
CNH	Chinese Renminbi (Offshore)	KES	Kenia-Schilling	THB	Thailändischer Baht
CNY	Chinese Renminbi (Mainland)	KRW	Südkoreanischer Won	TRY	Türkische neue Lira
COP	Kolumbianischer Peso	KZT	Kasachischer Tenge	TWD	Taiwanesischer Dollar
CZK	Tschechische Krone	MXN	Mexikanischer Peso	UGX	Uganda-Schilling
DKK	Dänische Krone	MYR	Malaysischer Ringgit	USD (oder \$)	US-Dollar
DOP	Dominikanischer Peso	NGN	Nigerianische Naira	UYU	Uruguayischer Peso
EGP	Ägyptisches Pfund	NOK	Norwegische Krone	VND	Vietnamesischer Dong
EUR (oder €)	Euro	NZD	Neuseeländischer Dollar	ZAR	Südafrikanischer Rand
GBP (oder £)	Britisches Pfund	PEN	Peruanischer neuer Sol	ZMW	Sambischer Kwacha

### Börsenkürzel:

BIST	Borsa Istanbul Exchange	CME	Chicago Mercantile Exchange	OTC	Over the Counter
CBOT	Chicago Board of Trade	FTSE	Financial Times Stock Exchange		

### Index-/Spread-Kürzel:

ABX.HE	Asset-Backed Securities Index - Home Equity	CPTFEMU	Eurozone HICP ex-Tobacco Index	NDUEACWF	MSCI ACWI Index Future
ACS	Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures Index	CPURNSA	Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index	NDUEEGF	iShares MSCI Emerging Markets ETF
AMZX	Alerian MLP Total Return Index	DAX	Deutscher Aktien Index 30	OMXS30	Stockholm 30 Index
BCOMF1TC	Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return	DWRTFT	Dow Jones Wilshire REIT Total Return Index	PIMCODBU	PIMCO Custom Commodity Basket
BCOMTR	Bloomberg Commodity Index Total Return	FRCPXTOB	Französischer Verbraucherpreisindex ohne Tabak	PrimeX.ARM	Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage
BCOMTR1	Bloomberg Custom Commodity Index	FTSE/JSE	South African Performance Index	S&P 500	Standard & Poor's 500 Index
BOVESPA	Brazil Bovespa Index	FTSE/MIB	Index der 40 italienischen Aktien mit der höchsten Liquidität/Marktkapitalisierung der Borsa Italiana	S&P CNX Nifty	Standard & Poor's Nifty 50 Index
CAC	Cotation Assistée en Continu	IBEX 35	Spanish Continuous Exchange Index	SIBCSORA	Singapore Overnight Rate Average
CAONREPO	Canadian Overnight Repo Rate Average	IBR	Indicador Bancario de Referencia	SONIO	Sterling Overnight Interbank Average Rate
CDX.EM	Credit Derivatives Index - Emerging Markets	IXTR	S&P's Industrials Select Sector Index	SPI 200	Australian Equity Futures Index
CDX.HY	Credit Derivatives Index - High Yield	JMABDEWU	J.P. Morgan Custom Commodity Index	SFRXON3	Swiss Overnight Rate Average (6PM)
CDX.IG	Credit Derivatives Index - Investment Grade	JMABNIU5	J.P. Morgan Custom Commodity Index	TOPIX	Tokyo Price Index
CIXBSTR3	Individuell zusammengestellter Rohstoffindex	KOSPI	Korea Composite Stock Price Index	TRNGLU	FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD
CMBX	Commercial Mortgage-Backed Index	KOSPI2	Korea Stock Exchange KOSPI 200 Index	UKRPI	United Kingdom Retail Prices Index
CNREPOFIX	China Fixing Repo Rates 7-Day	MUTKCALM	Tokyo Overnight Average Rate	VSTOXX	Euro Stoxx 50 Volatility Index
CPALEMU	Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index	NASDAQ	National Association of Securities Dealers Automated Quotations	WIG20	Nach Marktkapitalisierung gewichteter Börsenindex der 20 größten Unternehmen an der Warschauer Börse

### Kommunalanleihen- oder Behördenkürzel:

AGM	Assured Guaranty Municipal	ST	State
-----	----------------------------	----	-------

**Sonstige Kürzel:**

<b>ABS</b>	Asset-Backed Security (forderungsbesichertes Wertpapier)	<b>EURIBOR</b>	Euro Interbank Offered Rate	<b>PRIBOR</b>	Prague Interbank Offered Rate
<b>ALT</b>	Alternate Loan Trust	<b>HIBOR</b>	Hong Kong Interbank Offered Rate	<b>REIT</b>	Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds)
<b>BABs</b>	Build America Bonds	<b>JIBAR</b>	Johannesburg Interbank Agreed Rate	<b>REMIC</b>	Real Estate Mortgage Investment Conduit
<b>BBR</b>	Bank Bill Rate	<b>JSC</b>	Joint Stock Company	<b>RMBS</b>	Residential Mortgage-Backed Security
<b>BBSW</b>	Bank Bill Swap Reference Rate	<b>KLIBOR</b>	Kuala Lumpur Interbank Offered Rate	<b>STIBOR</b>	Stockholm Interbank Offered Rate
<b>BRL-CDI</b>	Brazil Interbank Deposit Rate	<b>KORIBOR</b>	Korea Interbank Offered Rate	<b>TAIBOR</b>	Taipei Interbank Offered Rate
<b>BTP</b>	Buoni del Tesoro Poliennali "Long-term Treasury Bond"	<b>LIBOR</b>	London Interbank Offered Rate	<b>TBA</b>	To-Be-Announced
<b>CBO</b>	Collateralised Bond Obligation	<b>MIBOR</b>	Mumbai Interbank Offered Rate	<b>TBD</b>	To-Be-Determined
<b>CDO</b>	Collateralised Debt Obligation (besicherte Schuldverschreibungen)	<b>MSCI</b>	Morgan Stanley Capital International	<b>TBD%</b>	Bei Abrechnung des Darlehens oder zum Zeitpunkt der Finanzierung zu ermittelnder Zinssatz
<b>CHILIBOR</b>	Chile Interbank Offered Rate	<b>NIBOR</b>	Norwegian Interbank Offered Rate	<b>TELBOR</b>	Tel Aviv Inter-Bank Offered Rate
<b>CLO</b>	Collateralised Loan Obligation (durch Kreditportfolio besicherte Wertpapiere)				
<b>CMBS</b>	Collateralised Mortgage-Backed Security	<b>OAT</b>	Obligations Assimilables du Trésor	<b>THB-THORON</b>	Thai Overnight Repurchase Rate
<b>DAC</b>	Designated Activity Company	<b>OIS</b>	Overnight Index Swap	<b>TIIE</b>	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio „Gleichgewichtszinssatz im Interbankengeschäft“
<b>EUR-ESTRON</b>	Euro Short-Term Rate	<b>PIK</b>	Payment-in-Kind (Sachausschüttung)	<b>WIBOR</b>	Warsaw Interbank Offered Rate

## Allgemeine Informationen

### VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited,  
Third Floor,  
Harcourt Building,  
Harcourt Street,  
Dublin,  
D02 F721,  
Irland.

### ANLAGEBERATUNGSGESELLSCHAFT

Pacific Investment Management  
Company LLC,  
650 Newport Center Drive,  
Newport Beach, California 92660,  
USA.

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
Großbritannien.

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapur 018960.

PIMCO Europe GmbH,  
Seidlstraße 24-24a,  
80335 München  
Deutschland.

### ADMINISTRATOR

State Street Fund Services (Ireland) Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

### VERWAHRSTELLE

State Street Custodial Services (Ireland)  
Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

### VERTRIEBSSTELLEN

PIMCO Europe GmbH,  
Seidlstraße 24-24a,  
80335 München  
Deutschland.

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
Großbritannien.

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapur 018960.

PIMCO Asia Limited,  
22nd Floor, Suite 2201,  
Two International Finance Centre,  
8 Finance Street, Central,  
Hongkong.

PIMCO Australia Pty Ltd.,  
Level 19, 5 Martin Place,  
363 George Street,  
Sydney, New South Wales 2000,  
Australien.

### ÖSTERREICHISCHE ZAHLSTELLE

UniCredit Bank Austria AG,  
Schottengasse 6-8,  
1010 Wien,  
Österreich.

### REPRÄSENTANT IN SINGAPUR

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapur 018960.

### ITALIENISCHE KORRESPONDENZBANKEN

Allianz Bank Financial Advisors S.p.A.,  
Piazza Velasca, 7/9,  
20122 Mailand,  
Italien.

State Street Bank International GmbH  
– Succursale Italia,  
Via Ferrante Aporti, 10,  
Mailand,  
Italien.

Société Générale Securities Services  
S.p.A. („SGSS“),  
Via Santa Chiara, 19,  
Turin,  
Italien.

AllFunds Bank S.A.U.,  
Succursale di Milano,  
Via Bocchetto, 6,  
20123 Mailand,  
Italien.

Banca Sella Holding S.p.A.,  
Piazza Gaudenzio Sella, 1,  
13900 Biella,  
Italien.

Monte dei Paschi di Siena S.p.A.,  
Via Verrii, 14,  
Mantua,  
Italien.

RBC Investor Services Bank S.A.,  
Niederlassung Mailand,  
Via Vittor Pisani, 26,  
20124 Mailand,  
Italien.

CACEIS Bank, Niederlassung Italien,  
Piazza Cavour 2,  
20121 Mailand,  
Italien.

### REPRÄSENTANT IN HONGKONG

PIMCO Asia Limited,  
22nd Floor, Suite 2201,  
Two International Finance Centre,  
8 Finance Street,  
Hongkong.

### LUXEMBURGER ZAHLSTELLE UND VERTRETUNGSSTELLE

Société Générale Luxembourg,  
(Centre Opérationel/FED),  
28-32, Place de la Gare,  
L-1616, Luxemburg.

### SCHWEIZER ZAHLSTELLE UND REPRÄSENTANZ

BNP PARIBAS Paris,  
Niederlassung Zürich,  
Selnaustrasse 16,  
8002 Zürich,  
Schweiz.

### BRITISCHER REPRÄSENTANT

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
Großbritannien.

### BELGISCHE ZAHLSTELLE

ABN AMRO BANK S.A.,  
Borsbeeksebrug 30,  
2600 Antwerpen,  
Belgien.

### DEUTSCHE ZAHL- UND INFORMATIONSTELLE

Marcard, Stein & Co AG,  
Ballindamm 36,  
20095 Hamburg,  
Deutschland.

### PORTUGIESISCHE ZAHLSTELLE

Banco Activobank (Portugal) S.A.,  
Rua Augusta 86,  
1149-023, Lissabon,  
Portugal.

### SCHWEDISCHE ZAHLSTELLE

SEB Merchant Banking,  
SE-106 40,  
Stockholm,  
Schweden.

### GRIECHISCHE ZAHLSTELLE

Eurobank Asset Management M.F.M.C.,  
10 Stadiou Street,  
GR 10564 Athen,  
Griechenland.

**UNGARISCHE ZAHLSTELLE**

European Investment Centre,  
Tomasikova 64,  
831 04 Bratislava,  
Slowakische Republik.

**ZAHLSTELLE IN DER TSCHECHISCHEN REPUBLIK**

European Investment Centre,  
Veveří 2581/102,  
616 00 Brno,  
Tschechische Republik.

**FRANZÖSISCHE ZENTRALISIERUNGS- UND FINANZSTELLE**

Société Générale,  
29, Boulevard Haussmann,  
75009 Paris,  
Frankreich.

**ZAHLSTELLE IN LIECHTENSTEIN**

LGT Bank Ltd.,  
Herrengasse 12,  
FL-9490 Vaduz,  
Liechtenstein.

**ZAHLSTELLE AUF ZYPERN**

EUROBANK CYPRUS LTD.,  
28, Spyrou Kyprianou Avenue,  
1075 Nikosia,  
Zypern.

**RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT**

Dillon Eustace LLP,  
33 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 XK09,  
Irland.

**RECHTSBERATER FÜR US-RECHT**

Dechert LLP,  
1900 K Street N.W.,  
Washington, D.C. 20006,  
USA.

**UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER**

PricewaterhouseCoopers  
Chartered Accountants und Statutory  
Audit Firm,  
One Spencer Dock,  
North Wall Quay,  
Dublin 1,  
D01 X9R7,  
Irland.

**SEKRETÄR**

(bis zum 25. Januar 2023)  
State Street Fund Services (Ireland) Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

(mit Wirkung zum 26. Januar 2023)  
Walkers Corporate Services (Ireland) Limited,  
The Exchange,  
George's Dock,  
Dublin D01 P2V6,  
Irland.

**BETREUENDER MAKLER**

Dillon Eustace LLP,  
33 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 XK09,  
Irland.

**EINGETRAGENER GESCHÄFTSSITZ**

PIMCO Funds: Global Investors  
Series plc,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

**VERWALTUNGSRAT DER GESELLSCHAFT UND VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

V. Mangala Ananthanarayanan<sup>1</sup> (Indien)  
Ryan P. Blute<sup>1</sup> (USA)  
John Bruton (unabhängiges  
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)  
Craig A. Dawson<sup>1</sup> (USA)  
David M. Kennedy (unabhängiges  
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)  
Frances Ruane (unabhängiges  
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)

Der Prospekt, Prospektergänzungen, die Gründungsurkunde und Satzung, die wesentlichen Anlegerinformationen sowie Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos beim Repräsentanten oder Agenten eines jeden Rechtsraums bezogen werden. Eine Kopie der Liste der Portfolioveränderungen in dem am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum kann von den Anteilhabern kostenlos bei der Verwahrstelle oder den Zahlstellen sowie bei der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland und der Vertretungsstelle in der Schweiz bezogen werden.

<sup>1</sup> Mitarbeiter von PIMCO.

**PIMCO Europe Ltd (Registernummer 2604517)** wurde von der Financial Conduct Authority (12 Endeavour Square, London, E20 1JN) im Vereinigten Königreich zugelassen und steht unter deren Aufsicht. Die von PIMCO Europe Ltd erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Kleinanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen, sondern ihren Finanzberater kontaktieren sollten.

**PIMCO Europe GmbH (Registernummer 192083, Seidlstr. 24-24a, 80335 München, Deutschland), PIMCO Europe GmbH Niederlassung Italien (Registernummer 10005170963), PIMCO Europe GmbH Niederlassung Irland (Registernummer 909462), PIMCO Europe GmbH Niederlassung Vereinigtes Königreich (Registernummer 2604517) und PIMCO Europe GmbH Niederlassung Spanien (N.I.F. W2765338E)** sind von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) (Marie-Curie-Str. 24-28, 60439 Frankfurt am Main) in Deutschland zugelassen und werden von dieser gemäß § 15 des Wertpapierinstitutsgesetz (WpIG) reguliert. Die Niederlassungen Italien, Irland, Vereinigtes Königreich und Spanien werden zusätzlich beaufsichtigt von: (1) Niederlassung Italien: Die Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) gemäß Artikel 27 des italienischen Einheitsgesetzes über die Finanzvermittlung; (2) Niederlassung Irland: Die Zentralbank von Irland gemäß Verordnung 43 der EU-Verordnungen (Märkte für Finanzinstrumente) von 2017 in der jeweils gültigen Fassung; (3) Niederlassung Vereinigtes Königreich: die Financial Conduct Authority und (4) Niederlassung Spanien: der Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) gemäß den Verpflichtungen der Artikel 168 und 203 bis 224 sowie den Verpflichtungen aus Abschnitt V, Abschnitt I des Gesetzes über den Wertpapiermarkt (LSM) und den Artikeln 111, 114 und 117 des Königlichen Dekrets 217/2008. Die von PIMCO Europe GmbH erbrachten Dienstleistungen stehen nur professionellen Kunden im Sinne von § 67 Abs. 2 WpHG (Wertpapierhandelsgesetz) zur Verfügung. Sie sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten.

**PIMCO (Schweiz) GmbH (eingetragen in der Schweiz, Registernummer CH-020.4.038.582-2).** Die von PIMCO (Schweiz) GmbH erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Kleinanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen, sondern ihren Finanzberater kontaktieren sollten.