

PIMCO Funds: Global Investors Series plc

---

# Halbjahresbericht

30. Juni 2018

---

Eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und gesonderter Haftung der einzelnen Teilfonds, die mit beschränkter Haftung gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 eingetragen wurde und von der Central Bank of Ireland als Organismus für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren), in der jeweils geltenden Fassung, und nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren, OGAW) von 2011 genehmigt wurde.

ALLGEMEINE KENNDATEN

**Fondstyp:**  
OGAW

**Anzahl an Teilfonds der Gesellschaft:**  
54 Teilfonds

**Anteilstklassen der Gesellschaft:\***

Institutional Class  
 Institutional AUD (Hedged) Class  
 Institutional BRL (Hedged) Class  
 Institutional CAD (Hedged) Class  
 Institutional CHF (Hedged) Class  
 Institutional CHF (Partially Hedged) Class  
 Institutional CHF (Unhedged) Class  
 Institutional CZK (Hedged) Class  
 Institutional DKK (Partially Hedged) Class  
 Institutional EUR (Currency Exposure) Class  
 Institutional EUR (Hedged) Class  
 Institutional EUR (Partially Hedged) Class  
 Institutional EUR (Unhedged) Class  
 Institutional GBP (Currency Exposure) Class  
 Institutional GBP (Hedged) Class  
 Institutional GBP (Partially Hedged) Class  
 Institutional GBP (Unhedged) Class  
 Institutional HKD (Unhedged) Class  
 Institutional HUF (Hedged) Class  
 Institutional ILS (Hedged) Class  
 Institutional JPY (Hedged) Class  
 Institutional NOK (Hedged) Class  
 Institutional NOK (Partially Hedged) Class  
 Institutional NZD (Hedged) Class  
 Institutional PLN (Hedged) Class  
 Institutional SEK (Hedged) Class  
 Institutional SGD (Hedged) Class  
 Institutional USD (Currency Exposure) Class  
 Institutional USD (Hedged) Class  
 Institutional USD (Unhedged) Class  
 Investor Class  
 Investor AUD (Hedged) Class  
 Investor CAD (Hedged) Class  
 Investor CHF (Hedged) Class  
 Investor CHF (Unhedged) Class  
 Investor CNH (Hedged) Class  
 Investor EUR (Hedged) Class  
 Investor EUR (Unhedged) Class  
 Investor GBP (Hedged) Class  
 Investor NOK (Hedged) Class  
 Investor RMB (Hedged) Class  
 Investor SEK (Hedged) Class  
 Investor SGD (Hedged) Class  
 Investor USD (Currency Exposure) Class  
 Administrative Class  
 Administrative AUD (Hedged) Class  
 Administrative CHF (Hedged) Class  
 Administrative EUR (Hedged) Class  
 Administrative GBP (Hedged) Class  
 Administrative HKD (Unhedged) Class  
 Administrative SEK (Hedged) Class  
 Administrative SGD (Hedged) Class  
 Class E  
 Class E AUD (Hedged)  
 Class E CHF (Hedged)  
 Class E CNH (Hedged)  
 Class E EUR (Hedged)  
 Class E EUR (Partially Hedged)  
 Class E EUR (Unhedged)  
 Class E GBP (Hedged)  
 Class E HKD (Unhedged)  
 Class E JPY (Hedged)  
 Class E SGD (Hedged)  
 Class E USD (Currency Exposure)  
 Class E USD (Hedged)  
 Class E USD (Unhedged)  
 Class G Institutional  
 Class G Institutional EUR (Hedged)

Class G Institutional EUR (Partially Hedged)  
 Class G Institutional EUR (Unhedged)  
 Class G Retail EUR (Currency Exposure)  
 Class G Retail EUR (Hedged)  
 Class G Retail EUR (Unhedged)  
 Class H Institutional  
 Class H Institutional USD (Hedged)  
 Class H Institutional EUR (Hedged)  
 Class M Retail  
 Class M Retail AUD (Hedged)  
 Class M Retail HKD (Unhedged)  
 Class M Retail SGD (Hedged)  
 Class R  
 Class R EUR (Hedged)  
 Class R GBP (Hedged)  
 Class R GBP (Unhedged)  
 Class R USD (Currency Exposure)  
 Class T  
 Class T EUR (Hedged)  
 Class T EUR (Unhedged)  
 Class T USD (Unhedged)  
 Class Z  
 Class Z AUD (Hedged)  
 Class Z EUR (Hedged)  
 Class Z EUR (Unhedged)  
 Class Z GBP (Hedged)

**Anteilsarten:**

Innerhalb jeder Klasse darf die Gesellschaft, vorbehaltlich der jeweiligen Ergänzung, ausschüttende Anteile (Einkommen ausschüttende Anteile), thesaurierende Anteile (Einkommen thesaurierende Anteile) und/oder Income II-Anteile (Anteile, die eine höhere Rendite liefern sollen) ausgeben. Innerhalb der Investor Classes dürfen der Income Fund und der Low Duration Income Fund auch ausschüttende A-Anteile (Anteile, die auf jährlicher Basis einen Ertrag ausschütten) ausgeben.

**Nettovermögen (Angaben in Tausend):**

159.406.724 USD

**Mindestbestand:**

Der Mindestbestand für die Anteilstklassen Institutional, Investor, Administrative sowie Class G Institutional und Class H Institutional liegt bei 500.000 USD oder dem gleichen Betrag in der Währung der jeweiligen Anteilstklasse. Der Mindestbestand für Anteile der Class E, Class G Retail, Class M Retail, Class R und Class T liegt bei 1.000 USD oder dem Gegenwert in der jeweiligen Anteilstklassenwährung je Teilfonds. Der Mindestbestand für die Anteile der Class Z liegt bei 20 Mio. USD oder dem Gegenwert in der jeweiligen Anteilstklassenwährung. Die Pacific Investment Management Company LLC ist nach eigenem Ermessen befugt, auf das Erfordernis der Mindestanfangszeichnung und des Mindestbestandes gemäß dem aktuellen Verkaufsprospekt zu verzichten.

**Handelstag:**

Für einen Teilfonds bezeichnet er den Tag oder die Tage, die die jeweilige Ergänzung zu diesem Teilfonds 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, und dies wird den Anteilinhabern des/der betroffenen Teilfonds im Voraus mitgeteilt.

Ungeachtet der vorangehenden Ausführungen ist ein Tag für einen Teilfonds kein Handelstag, wenn es entweder aufgrund von Feiertagen oder einer Markt- bzw. Börsenschließung in jeglichem Rechtsgebiet schwierig ist, (i) einen Teilfonds zu verwalten oder (ii) einen Teil des Fondsvermögens zu bewerten. Weitere Einzelheiten über geplante Schließungen von Teilfonds während des Jahres können von Anteilinhabern und potenziellen Anlegern beim Administrator erfragt oder dem Feiertagskalender der Teilfonds entnommen werden (eine Kopie desselben kann beim Administrator angefordert werden).

**Funktionswährung der Teilfonds:**

USD (\$), ausgenommen der Teilfonds UK Corporate Bond Fund und UK Long Term Corporate Bond Fund, die auf Pfund Sterling (£) lauten, sowie der Teilfonds Dynamic Multi-Asset Fund, Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, Euro Low Duration Fund, Euro Short-Term Fund und PIMCO RAE Fundamental Europe Fund, die auf Euro (€) lauten.

\* Nicht jeder Fonds bietet alle aufgeführten Anteilstklassen an.

## ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

### Zulassung in Hongkong:

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

PIMCO Capital Securities Fund  
PIMCO Credit Absolute Return Fund  
Dynamic Multi-Asset Fund  
Diversified Income Duration Hedged Fund  
Emerging Markets 2018 Fund  
Emerging Markets Corporate Bond Fund  
Euro Bond Fund  
Euro Credit Fund  
Euro Income Bond Fund  
Euro Long Average Duration Fund  
Euro Low Duration Fund  
Euro Short-Term Fund  
Global Advantage Fund  
Global Advantage Real Return Fund  
Global Bond ESG Fund  
Global Bond Ex-US Fund  
Global Libor Plus Bond Fund  
Global Low Duration Real Return Fund  
Global Multi-Asset Fund  
Inflation Strategy Fund  
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund  
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund  
Mortgage Opportunities Fund  
PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund  
PIMCO RAE Fundamental Europe Fund  
PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund  
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund  
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund  
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund  
PIMCO RAE Fundamental US Fund  
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund  
StocksPLUS™ Fund  
Strategic Income Fund  
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund  
UK Corporate Bond Fund  
UK Long Term Corporate Bond Fund  
UK Low Duration Fund  
Unconstrained Bond Fund  
US Investment Grade Corporate Bond Fund  
US Short-Term Fund

### Zulassung in Singapur

Die folgenden Teilfonds werden von der Monetary Authority of Singapore gemäß dem Securities and Futures Act, Chapter 289 von Singapur, nicht anerkannt und stehen Privatanlegern in Singapur nicht zur Verfügung:

PIMCO Capital Securities Fund  
PIMCO Credit Absolute Return Fund  
Dynamic Multi-Asset Fund  
Emerging Markets 2018 Fund  
Euro Credit Fund  
Euro Income Bond Fund  
Euro Long Average Duration Fund  
Euro Low Duration Fund  
Euro Short-Term Fund  
Global Bond ESG Fund  
Global Libor Plus Bond Fund  
Global Low Duration Real Return Fund  
Inflation Strategy Fund  
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund  
Mortgage Opportunities Fund  
PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund  
PIMCO RAE Fundamental Europe Fund  
PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund  
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund  
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund  
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund  
PIMCO RAE Fundamental US Fund  
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund  
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund  
UK Corporate Bond Fund  
UK Long Term Corporate Bond Fund  
UK Low Duration 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
Schreiben des Vorsitzenden	4
Wichtige Angaben zu den Teilfonds	6
Beschreibungen der Vergleichsindizes	67
Finanzstatus	72
Betriebsergebnisrechnung	92
Ausweis der Nettovermögensänderungen	112
Aufstellung der Wertpapieranlagen & Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung	118
Erläuterungen zum Abschluss	715
Begriffsbestimmungen	765
Allgemeine Informationen	767

TEILFONDS	Teilfonds- überblick	Aufstellung der Wertpapier- anlagen
PIMCO Capital Securities Fund	7	118
Commodity Real Return Fund	9	127
PIMCO Credit Absolute Return Fund	10	139
Diversified Income Fund	11	149
Diversified Income Duration Hedged Fund	13	165
Dynamic Multi-Asset Fund	14	177
Emerging Asia Bond Fund	15	185
Emerging Local Bond Fund	16	190
Emerging Markets 2018 Fund	17	202
Emerging Markets Bond Fund	18	206
Emerging Markets Corporate Bond Fund	19	218
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	20	225
Euro Bond Fund	21	233
Euro Credit Fund	22	243
Euro Income Bond Fund	23	251
Euro Long Average Duration Fund	24	261
Euro Low Duration Fund	25	268
Euro Short-Term Fund	26	274
Global Advantage Fund	27	280
Global Advantage Real Return Fund	28	298
Global Bond ESG Fund	29	310
Global Bond Fund	30	322
Global Bond Ex-US Fund	32	344
Global High Yield Bond Fund	33	360
Global Investment Grade Credit Fund	34	371
Global Libor Plus Bond Fund	36	399
Global Low Duration Real Return Fund	37	409
Global Multi-Asset Fund	38	421
Global Real Return Fund	39	435
Income Fund	40	448
Inflation Strategy Fund	42	488
Low Average Duration Fund	43	500
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	44	511
Low Duration Income Fund	45	523
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	46	529
Mortgage Opportunities Fund	47	534
PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund	48	545
PIMCO RAE Fundamental Europe Fund	49	552
PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund	50	557
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund	51	565
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund	52	574
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund	53	583
PIMCO RAE Fundamental US Fund	54	590

---

TEILFONDS	Teilfonds- überblick	Aufstellung der Wertpapier- anlagen
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund	55	594
StocksPLUS™ Fund	56	603
Strategic Income Fund	57	614
Total Return Bond Fund	58	630
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	60	645
UK Corporate Bond Fund	61	654
UK Long Term Corporate Bond Fund	62	662
Unconstrained Bond Fund	63	670
US High Yield Bond Fund	64	684
US Investment Grade Corporate Bond Fund	65	694
US Short-Term Fund	66	705

## Schreiben des Vorsitzenden

---

### Sehr geehrte Anteilinhaber,

nachfolgend präsentieren wir den Halbjahresbericht der PIMCO Funds: Global Investors Series plc, der den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2018 abdeckt. Auf den nachfolgenden Seiten finden Sie nähere Einzelheiten zu den Anlageergebnissen sowie eine Erörterung der Faktoren, die während des Berichtszeitraums den stärksten Einfluss auf die Wertentwicklung hatten.

### Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2018

Die US-Wirtschaft setzte ihre Expansion während des Berichtszeitraums fort. Das Bruttoinlandsprodukt (BIP) der USA verzeichnete im vierten Quartal 2017 und im ersten Quartal 2018 eine korrigierte jährliche Wachstumsrate von jeweils 2,3 % bzw. 2,2 %. Den (nach Ablauf des Berichtszeitraums veröffentlichten) vorläufigen Zahlen des Handelsministeriums zufolge lag die jährliche BIP-Wachstumsrate im zweiten Quartal 2018 bei 4,1 %.

Die US-Notenbank (Federal Reserve, Fed) setzte während des Berichtszeitraums die Normalisierung ihrer Geldpolitik fort. Nachdem sie ihre Zinsen 2017 bereits dreimal angehoben hatte, nahm sie bei Ihrer Sitzung im März 2018 eine weitere Zinserhöhung vor, wodurch der Leitzins (Federal Funds Rate) auf eine Spanne von 1,50 % bis 1,75 % stieg. Bei ihrer am 13. Juni 2018 abgehaltenen Sitzung erhöhte die Fed ihre Zinsen dann schließlich auf eine Spanne von 1,75 % bis 2,00 %.

Außerhalb der USA schwächte sich die Wirtschaftstätigkeit während des Berichtszeitraums leicht ab. Vor diesem Hintergrund hielten die Europäische Zentralbank (EZB), die Bank of Japan und die Bank of England weitgehend an ihrer äußerst lockeren Geldpolitik fest. Andere Zentralbanken schwenkten auf eine restriktivere Haltung um, darunter die Bank of Canada, die ihre Zinsen im Januar 2018 anhub. Im Juni 2018 ließ die EZB derweil durchblicken, dass sie beabsichtigt, ihr Programm zur quantitativen Lockerung Ende des Jahres auslaufen zu lassen. Allerdings rechnet sie damit, ihre Zinsen „frühestens nach dem Sommer 2019“ anzuheben.

Die Zinsstrukturkurve für US-Staatsanleihen flachte sich während des Berichtszeitraums ab, da die kurzfristigen Zinsen stärker stiegen als ihre längerfristigen Pendanten. Der Anstieg der Zinsen am kurzen Ende der Zinsstrukturkurve war vor allem den Zinserhöhungen der Fed zuzuschreiben. Die Rendite auf die als Benchmark angesetzten 10-jährigen US-Staatsanleihen lag zum Ende des Berichtszeitraums bei 2,85 %, nachdem sie zum 30. Juni 2017 noch 2,40 % betragen hatte. Am Bloomberg Barclays U.S. Treasury Index gemessen erzielten US-Staatsanleihen während der sechs Monate zum 30. Juni 2018 eine Rendite von -1,08 %. Der Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Bond Index, ein weitläufig verwendeter Index für US-amerikanische Anleihen mit Investment Grade-Rating, rentierte derweil während des Berichtszeitraums mit -1,62 %. Mit höherem Risiko behaftete festverzinsliche Anlageklassen wie etwa hochverzinsliche Unternehmensanleihen und Schuldtitel aus Schwellenländern lieferten im Vergleich zum breiten US-Markt durchwachsene Ergebnisse. Der ICE BofAML U.S. High Yield Index legte während des Berichtszeitraums um 0,08 % zu, während auf Fremdwährungen lautende Schwellenmarktanleihen, die vom JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global abgebildet werden, während des Berichtszeitraums mit -5,23 % rentierten. Auf Landeswährungen lautende Schwellenmarktanleihen, die vom JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) abgebildet werden, rentierten im Berichtszeitraum mit -6,44 %.

Globale Aktien lieferten während des Berichtszeitraums durchwachsene Ergebnisse. Der US-Markt setzte im ersten Monat des Berichtszeitraums zu einer starken Rally an. Unterstützung erhielt der Markt durch das besser werdende globale Wachstum, die insgesamt soliden Unternehmensgewinne und die Verabschiedung eines Steuerreformgesetzes gegen Ende des Jahres 2017. Diese Gewinne wurden im Februar und März 2018 dann wieder zunichte gemacht. Teilweise war dies auf Befürchtungen zurückzuführen, die Fed könne bei ihren Zinsanhebungen einen aggressiveren Kurs einschlagen. Darüber hinaus kamen Sorgen über einen möglichen Handelskrieg auf. Während der letzten drei Monate des Berichtszeitraums legten US-Aktien jedoch leicht zu. US-Aktien verzeichneten gemessen am S&P 500-Index über den Berichtszeitraum hinweg insgesamt ein Plus von 2,65 %. Die am MSCI Emerging Markets Index gemessenen Schwellenmarktaktien verbuchten während des Berichtszeitraums eine Rendite von -6,66 %, während globale Aktien gemessen am MSCI World Index um 0,43 % zulegten. Japanische Aktien verbuchten derweil am Nikkei 225 Index (in JPY) gemessen eine Rendite von -1,05 %, während die vom MSCI Europe Index (in EUR) abgebildeten europäischen Aktien während des Berichtszeitraums mit -0,48 % rentierten.

Die Rohstoffpreise waren Schwankungen ausgesetzt und lieferten während der sechs Monate zum 30. Juni 2018 uneinheitliche Ergebnisse. Zu Beginn des Berichtszeitraums notierte Rohöl noch bei etwa 60 USD je Barrel, zum Ende des Berichtszeitraums war der Preis auf ca. 74 USD je Barrel gestiegen. Dieser Anstieg war teilweise den geplanten und auch eingehaltenen Produktionskürzungen der OPEC zu verdanken, teilweise aber auch dem Einbruch der venezolanischen Ölförderung sowie dem weltweiten Wachstum, das der Nachfrage Unterstützung bot. Auch die Gold- und Kupferpreise gaben während des Berichtszeitraums nach.

An den Devisenmärkten schließlich wurden während des Berichtszeitraums Phasen erhöhter Volatilität verzeichnet, was teilweise auf Anzeichen auf eine Verbesserung des weltweiten Wachstums, eine Entkopplung der Geldpolitik der Zentralbanken und eine Reihe geopolitischer Ereignisse zurückzuführen war. Unter dem Strich verbuchte der US-Dollar gegenüber dem Euro, dem britischen Pfund und dem japanischen Yen während der sechs Monate zum 30. Juni 2018 jeweils eine Rendite von 2,73 %, 2,26 % und -1,71 %.

Vielen Dank für das Vertrauen, das Sie PIMCO entgegengebracht haben. Wir wissen Ihr Vertrauen sehr zu schätzen und werden weiterhin daran arbeiten, Ihren breit gefächerten Anlagebedarf zu erfüllen. Bei Fragen bezüglich PIMCO Funds: Global Investors Series plc, wenden Sie sich bitte an den Verwalter **+353 (1) 776 9990**.

---

Mit freundlichem Gruß



Craig A. Dawson  
Vorsitzender  
23. August 2018

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.

## Wichtige Angaben zu den Teilfonds

Dieses Dokument darf nur in Verbindung mit dem aktuellen Verkaufsprospekt der PIMCO Funds: Global Investors Series plc verwendet werden. Anleger sollten vor einer Anlage in den Teilfonds 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 Teilfonds gehaltenen Rentenpapiere voraussichtlich an Wert verlieren. Die Kursschwankungsintensität von Rentenpapieren kann in Zeiten steigender Zinsen ebenfalls zunehmen und dadurch zu erhöhten Verlusten für die Teilfonds 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 Teilfonds 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 Teilfonds können zusätzlich zu den vorstehend 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 sowie die mit einem bestimmten Sektor einhergehenden Anlagerisiken. Die Teilfonds 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 Teilfonds eine Position nicht dann glattstellen kann, wenn es für ihn am vorteilhaftesten wäre. Teilfonds, 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 Teilfonds mit einem zusätzlichen Risiko und einer zusätzlichen Volatilität einhergehen.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit bietet keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Überblicksseiten der einzelnen Teilfonds in diesem Bericht bieten eine Übersicht über den Gesamtertrag der Anlageentwicklung, in der die Wertentwicklung – davon ausgehend, dass alle Dividenden und Kapitalgewinnausschüttungen wiederangelegt wurden – gemessen wird. Anlageerträge und der Kapitalwert schwanken, sodass der Wert der Fonds-Anteile bei Rücknahme über oder unter ihrem ursprünglichen Wert liegen kann. In den Erträgen ist der Abzug von Steuern, die ein Anteilinhaber auf (i) Ausschüttungen des Teilfonds oder (ii) die Rückgabe von Investmentanteilen des Teilfonds zu zahlen hat, nicht berücksichtigt. Die aktuelle Wertentwicklung kann geringer oder höher ausfallen als die angeführten Wertentwicklungsdaten. Sämtliche Teilfondserträge verstehen sich nach Gebühren und Aufwendungen.

Anlagen in einem Teilfonds gelten nicht als Bankeinlagen und werden nicht von einer behördlichen Stelle verbürgt oder versichert. Der Wert der und die Einkünfte aus den Anteilen am Teilfonds können steigen oder sinken und eventuell erhalten Sie nicht den ursprünglich in den Teilfonds investierten Betrag zurück.

PIMCO Funds: Global Investors Series plc wird vertrieben von PIMCO Europe Ltd., 11 Baker Street, London W1U 3AH, England; PIMCO Asia Pte Ltd., 8 Marina View #30-01, Asian 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).

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2013)	(2,95 %)	6,32 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Sept. 2014)	(3,00 %)	4,71 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Mai 2014)	(3,19 %)	4,15 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (19. Mai 2014)	(3,10 %)	4,17 %
Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(3,20 %)	5,64 %
Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(3,21 %)	5,63 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2013)	(3,41 %)	4,80 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 19. Mai 2014)	(3,37 %)	3,62 %
Class M Retail, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(3,39 %)	4,38 %
Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. März 2014)	(3,04 %)	4,63 %
Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(3,61 %)	4,09 %
Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2013)	(2,52 %)	6,51 %
3 Month USD LIBOR Index	1,00 %	0,71 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Investor AUD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Mai 2018)	—	(1,60 %)
Class Z AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Aug 2015)	(2,69 %)	6,19 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	0,92 %	1,94 % <sup>2</sup>
<b>Auf BRL lautende Klassen</b>		
Institutional BRL (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 02. Jan. 2018)	—	(16,30 %)
ICE BofAML 3 Month USD Libor Index Hedged BRL, auf USD lautend	—	(12,86 %)
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Investor CAD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Juni 2018)	—	(0,40 %)
3 Month USD LIBOR (CAD Hedged) Index	—	0,02 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(4,47 %)	4,55 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Juni 2014)	(4,86 %)	1,41 %
3 Month USD LIBOR (in CHF besichert)	(0,47 %)	(0,85 %) <sup>2</sup>
<b>Auf CNH lautende Klassen</b>		
Investor CNH (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Juni 2018)	—	(0,29 %)
3 Month USD LIBOR (CNH Hedged) Index	—	0,06 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(4,31 %)	5,02 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(4,28 %)	5,03 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 29. Juli 2014)	(4,19 %)	3,11 %
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 26. Feb. 2016)	(4,46 %)	6,38 %
Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Aug. 2013)	(4,50 %)	4,49 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2013)	(4,68 %)	3,64 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung 30. Okt. 2015)	(4,67 %)	2,20 %
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Apr. 2016)	(4,25 %)	4,72 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Juni 2014)	(4,35 %)	2,67 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(4,89 %)	2,30 %
3 Month Euribor	(0,16 %)	(0,08 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Aug. 2013)	(3,82 %)	5,66 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2013)	(3,82 %)	5,81 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Juni 2014)	(3,93 %)	3,35 %
3 Month GBP-LIBOR-Index	0,31 %	0,51 % <sup>2</sup>

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 Teilfonds angegebenen Richtlinien mindestens 80 % in Capital Securities angelegt werden.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Schutzkäufe auf Einzeltitel- und Index-CDS trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads erweiterten.
- » Ein Long-Engagement bei zusätzlichen Tier-1-Anleihen belastete die Wertentwicklung aufgrund der breiteren Spreads und einer risikoscheuen Marktstimmung.
- » Ein Long-Engagement bei vorrangigen Bankenschildtiteln belastete die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen und die Spreads sich erweiterten.
- » Ein taktisches Engagement bei Bankaktien, die angesichts der risikofreudlichen Marktstimmung negative Renditen verbuchten, schmälerte die Wertentwicklung.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>  
(Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class M Retail HKD (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Juli 2017)	(3,10 %)	(0,09 %)
3 Month HIBOR Index	0,63 %	0,96 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Administrative SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Feb. 2015)	(4,64 %)	2,44 %
3 Month STIBOR Index	(0,22 %)	(0,41 %)
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(3,32 %)	5,02 %
Investor SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Mai 2018)	—	(1,60 %)
Class M Retail SGD (Hedged), ausschüttende Anteile II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(3,83 %)	4,48 %
3 Month SGD LIBOR Index	0,72 %	0,98 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

# Commodity Real Return Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Aug. 2006)	(0,30 %)	(3,29 %)
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Aug. 2011)	(0,51 %)	(7,40 %)
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Sept. 2007)	(0,88 %)	(5,03 %)
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2006)	(1,02 %)	(4,09 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return	0,00 %	(4,67 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Juni 2010)	(1,63 %)	(3,93 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. März 2012)	(2,20 %)	(8,34 %)
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 20. März 2018)	—	0,50 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Hedged)	(2,13 %)	(5,47 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 01. März 2017)	(1,20 %)	(0,75 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Hedged)	(0,85 %)	(0,81 %)

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit 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 bei 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 den Anlageverwaltungsgesellschaften 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Engagements bei Rohstoffen waren der absoluten Wertentwicklung abträglich, da Rohstoffe während des Berichtszeitraums gemessen am Bloomberg Commodity Index negative Renditen aufwiesen.
- » Ein Engagement bei der Realduration in den USA und Italien belastete die absolute Wertentwicklung, da die Realrenditen in diesen Ländern anstiegen.
- » Eine Untergewichtung der nominalen US-Duration kam der relativen Wertentwicklung zugute, da die nominalen Renditen in den USA anstiegen.
- » Ein erhöhtes Engagement bei Auslandsschulden von Schwellenländern in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums belastete die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere während dieses Zeitraums negative Renditen verbuchten.
- » Ein Engagement bei RMBS belastete die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere negative Renditen verbuchten.
- » Ein übergewichtetes Engagement im argentinischen Peso schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung an Wert verlor.

# PIMCO Credit Absolute Return Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Okt. 2011)	(0,55 %)	3,49 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 01. März 2017)	(0,86 %)	3,06 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 01. März 2017)	(0,80 %)	3,09 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Dez. 2012)	(1,10 %)	1,44 %
3 Month USD LIBOR Index	1,00 %	0,63 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Dez. 2012)	(2,13 %)	0,99 %
3 Month USD LIBOR (in CHF besichert)	(0,47 %)	(0,77 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Okt. 2011)	(1,97 %)	2,68 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 1. Okt. 2013)	(1,90 %)	1,71 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Dez. 2012)	(2,37 %)	0,52 %
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(1,90 %)	1,30 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(2,44 %)	0,00 %
3 Month Euribor	(0,16 %)	0,12 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Credit Absolute Return Fund strebt unter Schutz des Kapitals und umsichtiger Anlageverwaltung in verschiedenen Marktumgebungen eine positive Gesamtrendite an, indem er mindestens 80 % seines Nettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten investiert. Der Teilfonds bemüht sich um einen positiven Gesamtertrag, und nicht um einen Ertrag, der einen bestimmten Vergleichsindex übertrifft. Er zielt unabhängig davon, ob die Märkte steigen oder sinken, auf die Generierung absoluter Erträge ab.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Engagement bei Non-Agency-Hypotheken in den USA wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich der Sektor hervorragend entwickelte.
- » Ein Engagement bei hochverzinslichen Titeln von Finanzunternehmen trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor positive Überschussrenditen verbuchte.
- » Ein Engagement bei hochverzinslichen Titeln aus dem Gesundheitssektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor positive Überschussrenditen verbuchte.
- » Das Engagement bei US-Duration belastete die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.
- » Ein Long-Engagement bei externen und auf Lokalwährungen lautenden Schultiteln aus Schwellenländern, die abverkauft wurden, belastete die Wertentwicklung.
- » Ein Long-Engagement beim ARS belastete die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem USD abgewertet wurde.

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2005)	(2,12 %)	6,48 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 8. Sept. 2008)	(2,09 %)	6,92 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. April 2013)	(2,27 %)	3,00 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. April 2013)	(2,25 %)	2,98 %
Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 21. Juli 2011)	(2,34 %)	4,57 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2006)	(2,55 %)	5,58 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2006)	(2,50 %)	5,68 %
Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Juni 2011)	(2,22 %)	4,88 %
Class M Retail, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2010)	(2,48 %)	4,49 %
Class M Retail, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(2,53 %)	3,69 %
Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(2,21 %)	3,61 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(2,79 %)	2,96 %
Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(2,75 %)	2,97 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays 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>	(2,38 %)	6,08 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Class M Retail AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 19. Dez. 2012)	(2,62 %)	4,34 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays 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>	(2,47 %)	5,09 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Juni 2011)	(3,58 %)	3,74 %
Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Aug. 2012)	(3,49 %)	2,75 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays 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>	(3,88 %)	3,66 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Feb. 2007)	(3,34 %)	5,81 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 17. Okt. 2007)	(3,37 %)	5,94 %
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Juli 2007)	(3,58 %)	5,73 %
Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2013)	(3,55 %)	2,29 %
Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Juli 2007)	(3,64 %)	5,58 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Juli 2007)	(3,84 %)	5,19 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung 16. Okt. 2009)	(3,84 %)	4,77 %
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(3,41 %)	3,02 %
Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. März 2012)	(3,76 %)	2,97 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(4,01 %)	1,41 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(3,94 %)	1,42 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays 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>	(3,69 %)	5,09 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Mai 2006)	(2,93 %)	6,63 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Feb. 2006)	(2,86 %)	6,51 %
Administrative GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 21. Juli 2011)	(3,13 %)	4,30 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays 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>	(3,22 %)	5,90 % <sup>2</sup>

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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine Untergewichtung von Auslandsschulden von Schwellenländern, die abverkauft wurden, trug zur Wertentwicklung bei.
- » Ein Engagement bei Non-Agency-Hypothesen in den USA wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich der Sektor hervorragend entwickelte.
- » Die Positionierung in Bezug auf die Zinsstrukturkurve in den USA, insbesondere eine Untergewichtung des langen Endes, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Zinsen stiegen.
- » Long-Engagements bei Schwellenmarktwährungen schmälerten die Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar abverkauft wurden.
- » Ein Long-Engagement bei zusätzlichen Tier-1-Anleihen, die schlechter abschnitten als der Gesamtmarkt, schmälerte die Wertentwicklung.

## Diversified Income Fund (Forts.)

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>  
(Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) jeweils 1/3 Bloomberg Barclays 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>	(3,45 %)	6,10 %
	(3,77 %)	5,41 %

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

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

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex repräsentiert: Von der Auflegung bis zum 9. November 2015 jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Component USD Hdgd; ICE BofAML Global High Yield BB-B Rated Constrained USD Hdgd; JPMorgan EMBI Global. Seit dem 10. November 2015 jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged; ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged.

# Diversified Income Duration Hedged Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2011)	(0,53 %)	4,00 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (am 30. Okt. 2015 aufgelegt)	(0,56 %)	5,88 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(0,71 %)	2,57 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(0,78 %)	2,56 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Aug. 2013)	(0,97 %)	2,33 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2011)	(0,94 %)	3,11 %
Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,67 %)	2,95 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(1,18 %)	2,33 %
Gleichgewichtete Mischung von drei Indizes mit einer konstanten Duration von 0,25 Jahren, wie von PIMCO berechnet: Bloomberg Barclays 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>	(0,43 %)	3,46 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Aug. 2011)	(1,84 %)	3,67 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 1. Okt. 2013)	(1,82 %)	2,12 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Aug. 2011)	(2,24 %)	2,94 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. Mai 2013)	(2,28 %)	0,66 %
Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 0,25 Jahren: jeweils 1/3 Bloomberg Barclays 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>	(1,80 %)	3,41 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 23. Aug. 2011)	(1,39 %)	4,46 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Jan. 2013)	(1,39 %)	2,44 %
Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 0,25 Jahren: jeweils 1/3 Bloomberg Barclays 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>	(1,33 %)	3,99 % <sup>2</sup>

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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine Untergewichtung von Auslandsschulden von Schwellenländern, die abverkauft wurden, trug zur Wertentwicklung bei.
- » Ein Engagement bei Non-Agency-Hypotheken in den USA wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich der Sektor hervorragend entwickelte.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei hochverzinslichen Gesundheitswerten wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich der Sektor überdurchschnittlich entwickelte.
- » Long-Engagements bei Schwellenmarktwährungen schmälerten die Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar abverkauft wurden.
- » Ein Long-Engagement bei zusätzlichen Tier-1-Anleihen, die schlechter abschnitten als der Gesamtmarkt, schmälerte die Wertentwicklung.

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit 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: Bogley 4309 (Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit USD Hdgd; ICE BofAML High Yield BB-B Rated Developed Markets Constrained USD Hdgd; JPMorgan EMBI Global. Seit dem 10. November 2015: eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged; ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged).

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(1,40 %)	5,27 %
Institutional, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(1,27 %)	5,31 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(1,87 %)	4,15 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 8. Dez. 2017)	(1,81 %)	(2,40 %)
Class G Institutional, ausschüttende Anteile (Auflegung: 26. Apr. 2017)	(1,26 %)	1,44 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Okt. 2016)	(1,99 %)	1,99 %
1 Month Euribor Rate Index	(0,19 %)	(0,36 %) <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. März 2018)	—	(1,00 %)
1 Month CHF LIBOR Index	—	(0,23 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(0,86 %)	6,22 %
1 Month GBP-LIBOR-Index	0,25 %	0,38 %
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional USD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Feb. 2016)	0,00 %	7,39 %
Class E USD (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. März 2017)	(0,57 %)	3,39 %
Class E USD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. März 2017)	(0,48 %)	3,46 %
1 Month USD LIBOR Index	0,88 %	1,01 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

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 Teilfonds vorsieht.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Long-Engagement bei ausgewählten Schwellenmarktwährungen, insbesondere beim argentinischen Peso, beim russischen Rubel und beim brasilianischen Real, belastete die Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem Euro abgewertet wurden.
- » Das Engagement bei US-Duration belastete die Wertentwicklung, da die Renditen auf US-Schatzpapiere stiegen.
- » Ein Long-Engagement bei japanischen Banken war der Wertentwicklung abträglich, da diese an Wert einbüßten.
- » Ein Short-Engagement bei europäischen Aktienoptionen verstärkte die Rendite, da die Kurse während des Berichtszeitraums sanken.
- » Eine Long-Position bei deutscher Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen sanken.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Juni 2011)	(2,66 %)	0,85 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 1. Juni 2010)	(2,99 %)	3,15 %
JPMorgan Asia Credit Index <sup>3</sup>	(2,55 %)	4,11 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 1. Okt. 2010)	0,15 %	4,14 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Juni 2011)	(0,32 %)	3,19 %
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Unhedged) <sup>3</sup>	0,23 %	4,68 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class M Retail HKD (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 1. März 2011)	(2,76 %)	0,94 %
JPMorgan Asia Credit Index (HKD Unhedged) <sup>3</sup>	(2,15 %)	2,43 %

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

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

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Emerging Asia Bond Fund repräsentiert: Von der Auflegung bis zum 31. Mai 2016: [90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % 1 month USD LIBOR] \* [JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)] / [3 month USD LIBOR]. Seit dem 1. Juni 2016: JPMorgan Asia Credit Index.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Asia Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds legt in einen Mix aus Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten, die wirtschaftlich mit asiatischen Ländern mit Schwellenwertpapiermärkten, ausgenommen Japan, verbunden sind, Derivaten (wie im Verkaufsprospekt definiert) auf diese Wertpapiere sowie Schwellenmarktwährungen an. Vom Teilfonds gekaufte Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) sind von Moody's mindestens mit Caa oder von S&P mit CCC oder von Fitch gleichwertig bewertet (oder die, falls sie kein Rating haben, nach Meinung der Anlageberatungsgesellschaft eine vergleichbare Qualität aufweisen). Ausgenommen davon sind hypothekarisch gesicherte Wertpapiere, für die es kein vorgeschriebenes Mindest-Kreditrating gibt.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Die Positionierung bei Auslandsanleihen chinesischer Unternehmen wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.
- » Eine Untergewichtung externer Unternehmensanleihen aus Hongkong trug zur Wertentwicklung bei.
- » Eine Übergewichtung von Auslandsanleihen indischer Unternehmen sowie von Auslandsschulden indischer quasi-staatlicher Stellen belastete die Wertentwicklung.
- » Eine Übergewichtung der Auslandsschulden chinesischer quasi-staatlicher Stellen belastete die Wertentwicklung.

# Emerging Local Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Dez. 2007)	(6,85 %)	2,04 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. April 2008)	(6,82 %)	1,73 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Aug. 2010)	(7,07 %)	(0,69 %)
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Nov. 2008)	(7,33 %)	3,69 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 8. Juli 2010)	(7,31 %)	(0,75 %)
Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2008)	(6,37 %)	5,52 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	(6,44 %)	2,60 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Okt. 2012)	(5,14 %)	(1,76 %)
Investor CHF (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. März 2011)	(5,17 %)	(0,12 %)
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (CHF Unhedged)	(4,67 %)	0,87 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Apr. 2010)	(4,18 %)	1,92 %
Institutional EUR (Unhedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Juni 2010)	(4,18 %)	1,01 %
Investor EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. März 2011)	(4,37 %)	1,23 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Juli 2009)	(4,66 %)	3,21 %
Class G Institutional EUR (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(4,23 %)	2,27 %
Class G Retail EUR (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Dez. 2010)	(4,66 %)	0,17 %
Class T EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Jan. 2017)	(4,88 %)	(4,35 %)
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	(3,78 %)	4,86 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 27. Juni 2008)	(4,59 %)	6,34 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	(4,14 %)	6,92 %

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit 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 Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine Untergewichtung der lokalen ungarischen Duration und des ungarischen Forint trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen Renditen stiegen und die Währung gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurde.
- » Ein nicht im Vergleichsindex enthaltenes Engagement bei kurzfristigen, auf ägyptische Pfund lautenden Schatzanleihen lieferte eine positive Gesamtrendite, was vor allem dem hohen Carry im ersten Halbjahr 2018 zu verdanken war.
- » Eine Übergewichtung des argentinischen Pesos schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Eine Übergewichtung der lokalen indonesischen Duration belastete die relative Wertentwicklung, da die lokalen Renditen im ersten Halbjahr 2018 stiegen.
- » Eine Übergewichtung der türkischen Lira schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014)	0,87 %	4,14 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 9. Dez. 2014)	0,98 %	4,79 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014)	0,54 %	3,29 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014)	(0,54 %)	2,66 %
Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014)	(0,73 %)	2,15 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014)	(0,83 %)	1,84 %
Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Dez. 2014)	(0,82 %)	1,84 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Class R GBP (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014)	0,09 %	3,29 %

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets 2018 Fund möchte in Übereinstimmung mit einer umsichtigen Anlageverwaltung und dem Fälligkeitsdatum des Fonds eine maximale Gesamtrendite erzielen (wie im Verkaufsprospekt des Teilfonds am oder um den 30. November 2018 definiert), indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Nettovermögens in Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) unterschiedlicher Laufzeiten und von Emittenten anlegt, die wirtschaftlich mit Schwellenländern verbunden sind und die von deren Regierungen, Behörden oder Organen und Unternehmen ausgegeben werden. Diese Instrumente können auf andere Währungen als den USD lauten, unter anderem auf Währungen von Schwellenmärkten. Die Anlageberatungsgesellschaften können das gewünschte Engagement durch direkte Anlagen in Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) und/oder durch Anlagen in Derivate erreichen, wie im Verkaufsprospekt näher erläutert. Der Teilfonds kann außerdem in Wertpapiere anlegen, die nicht mit Schwellenländern verbunden sind. Während der zwölf Monate vor dem Fälligkeitsdatum des Fonds können die Anlageberatungsgesellschaften in ihrem Ermessen entscheiden, dass es nicht im besten Interesse des Teilfonds ist, mit Schwellenländern verbundene Rentenwerte zu erwerben (z.B. bei ungünstigen Marktbedingungen). Unter diesen Umständen und nur während des letzten Zwölf-Monats-Zeitraums können die Anlageberatungsgesellschaften die Anlage in nicht mit Schwellenländern verbundene Rentenwerte durchführen; sie sind dann nicht an die oben genannte Beschränkung von 80 % gebunden. Die Laufzeit von während dieses Zeitraums gekaufter Rentenwerte ist jedoch nicht länger als das Fälligkeitsdatum des Teilfonds.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Allokation auf kurzfristige brasilianische Anleihen quasi-staatlicher Emittenten und Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da diese im ersten Halbjahr 2018 dank ihres hohen Carry eine positive absolute Wertentwicklung verbuchten.
- » Eine Allokation auf kurzfristige russische Anleihen quasi-staatlicher Emittenten trug zur Wertentwicklung bei, da diese im ersten Halbjahr 2018 dank ihres hohen Carry eine positive absolute Wertentwicklung verbuchten.
- » Eine Allokation auf kurzfristige türkische Anleihen quasi-staatlicher Emittenten und Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da diese im ersten Halbjahr 2018 dank ihres hohen Carry eine positive absolute Wertentwicklung verbuchten.
- » Eine Aufwärtsbewegung der US-Zinsstrukturkurve belastete die absolute Wertentwicklung, da der Anstieg der kurzfristigen US-Renditen negative Auswirkungen auf externe Schwellenmarktanleihen mit ähnlicher Laufzeit hatte.

# Emerging Markets Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2001)	(4,62 %)	9,27 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 13. Dez. 2001)	(4,63 %)	8,50 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. April 2002)	(4,79 %)	7,68 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. April 2002)	(4,81 %)	7,64 %
Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Mai 2003)	(4,84 %)	6,43 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(5,05 %)	5,10 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(5,12 %)	5,26 %
Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Okt. 2002)	(4,70 %)	8,85 %
Class M Retail, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2010)	(5,09 %)	3,73 %
Class M Retail, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(4,98 %)	3,08 %
Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2008)	(4,24 %)	9,58 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	(5,23 %)	8,36 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Class M Retail AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 19. Dez. 2012)	(5,11 %)	2,65 %
JPMorgan EMBI Global (AUD Hedged)	(5,38 %)	3,76 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2005)	(6,05 %)	4,36 %
JPMorgan EMBI Global (CHF Hedged)	(6,72 %)	4,66 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Dez. 2002)	(5,91 %)	7,50 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 20. Dez. 2010)	(5,93 %)	3,99 %
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 4. Aug. 2009)	(6,08 %)	5,15 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(6,35 %)	4,19 %
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 26. Apr. 2017)	(5,91 %)	(2,77 %)
Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Jan. 2017)	(6,57 %)	(0,34 %)
JPMorgan EMBI Global (Euro Hedged)	(6,55 %)	7,40 % <sup>2</sup>
JPMorgan EMBI Global (EUR Unhedged)	—	2,15 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Feb. 2018)	—	2,10 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Feb. 2004)	(5,46 %)	6,89 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(5,48 %)	5,76 %
JPMorgan EMBI Global (GBP Hedged)	(6,12 %)	7,25 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Class E SGD (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2007)	(5,49 %)	4,14 %
JPMorgan EMBI Global (SGD Hedged)	(5,61 %)	5,67 %

## 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 Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten anlegt, die wirtschaftlich an Länder mit aufstrebenden Wertpapiermärkten gebunden sind. Der Teilfonds wird aktiv verwaltet, um das Gesamtrenditepotenzial zu maximieren.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung der US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen auf US-Schatzpapiere stiegen.
- » Eine Untergewichtung libanesischer Staatsanleihen, die im ersten Halbjahr 2018 eine negative Gesamtrendite verbuchten, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.
- » Eine Untergewichtung philippinischer Staatsanleihen, die im ersten Halbjahr 2018 eine negative Gesamtrendite verbuchten, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.
- » Eine Übergewichtung argentinischer Staatsanleihen, die im ersten Halbjahr 2018 eine negative Gesamtrendite verbuchten, schmälerte die relative Wertentwicklung.
- » Eine Übergewichtung venezolanischer Staatsanleihen, die im ersten Halbjahr 2018 eine negative Gesamtrendite verbuchten, schmälerte die relative Wertentwicklung.

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

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

# Emerging Markets Corporate Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 12. Nov. 2009)	(2,67 %)	4,79 %
Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Aug. 2012)	(3,00 %)	2,38 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 27. Feb. 2012)	(3,12 %)	2,63 %
Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Dez. 2009)	(2,14 %)	5,91 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	(3,06 %)	6,14 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Mai 2012)	(4,59 %)	1,30 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (CHF Hedged)	(4,55 %)	3,51 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Feb. 2010)	(3,98 %)	3,88 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. März 2010)	(4,41 %)	2,77 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (EUR Hedged)	(4,36 %)	5,16 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Juni 2011)	(3,44 %)	3,16 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (GBP Hedged)	(3,90 %)	4,68 %

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine Untergewichtung der US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen auf US-Schatzpapiere stiegen.
- » Eine Übergewichtung brasilianischer Unternehmensanleihen, die im ersten Halbjahr 2018 eine positive Gesamtrendite verbuchten, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.
- » Eine Untergewichtung von Schuldtiteln quasi-staatlicher russischer Körperschaften, die im ersten Halbjahr 2018 eine negative Gesamtrendite verbuchten, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.
- » Eine Übergewichtung nigerianischer Unternehmensanleihen, die im ersten Halbjahr 2018 eine negative Gesamtrendite verbuchten, schmälerte die relative Wertentwicklung.
- » Eine Übergewichtung argentinischer Unternehmensanleihen und ein Engagement bei argentinischen Staatsanleihen, die im ersten Halbjahr 2018 jeweils eine negative Gesamtrendite verbuchten, belasteten die relative Wertentwicklung.

# Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Sept. 2006)	(3,82 %)	2,48 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Nov. 2008)	(4,23 %)	1,87 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2006)	(4,24 %)	1,40 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	(3,41 %)	2,54 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Jan. 2010)	(1,08 %)	2,95 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Juli 2009)	(1,56 %)	2,62 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged)	(0,65 %)	3,62 % <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 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 Teilfonds nach Ländern und Währungen auf der Grundlage seiner 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 Teilfonds wird wahrscheinlich auf Asien, Afrika, dem Nahen Osten, Lateinamerika und den aufstrebenden Ländern Europas liegen. Der Teilfonds 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 Teilfonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaften. Unter normalen Marktbedingungen wird davon ausgegangen, dass sie nicht länger als zwei Jahre ist. Der Teilfonds 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).

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung des ungarischen Forint verstärkte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Ein nicht im Vergleichsindex enthaltenes Engagement im ägyptischen Pfund, das über kurzfristige Schatzanleihen erzielt wurde, lieferte eine positive Gesamtrendite, was vor allem dem hohen Carry im ersten Halbjahr 2018 zu verdanken war.
- » Eine Übergewichtung des argentinischen Pesos schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Eine Übergewichtung der türkischen Lira schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Eine Übergewichtung des polnischen Zloty schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Dez. 1998)	0,58 %	4,65 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. Jan. 2003)	0,62 %	4,53 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Mai 2002)	0,44 %	4,50 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 29. April 2002)	0,39 %	4,47 %
Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. Juni 2001)	0,36 %	4,33 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	0,14 %	3,38 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 10. Okt. 2005)	0,09 %	3,03 %
Class G Institutional, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	0,63 %	3,88 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	0,00 %	1,41 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	0,30 %	4,41 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2006)	0,42 %	3,47 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade (CHF Hedged) Index	0,14 %	3,50 %

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit 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 Teilfonds 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.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Übergewichtung deutscher Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.
- » Eine Untergewichtung italienischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen stiegen.
- » Ein Engagement bei Non-Agency-MBS trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Gesamtrenditen dieser Wertpapiere positiv ausfielen.
- » Eine Untergewichtung der Spread-Risiken von Kreditwerten mit Investment Grade trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads erweiterten.
- » Das Engagement bei US-Duration belastete die relative Wertentwicklung, da die Renditen anstiegen.
- » Ein Short-Engagement beim US-Dollar schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem Euro an Wert gewann.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Auflegung von Klassen
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Jan. 2008)	0,19 %	4,60 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 1. Okt. 2013)	0,15 %	3,93 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Mai 2010)	(0,38 %)	3,38 %
Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index	(0,53 %)	4,30 % <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 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 Teilfonds 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.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Übergewichtetes Engagement bei der Duration europäischer Kernländer trug zur Wertentwicklung bei, da deutsche Zinsen während des Berichtszeitraums sanken.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Versicherungssektor trug zur Wertentwicklung bei, da dieser Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Ein untergewichtetes Engagement bei Auslandsschulden von Schwellenländern, die sich unterdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.
- » Ein Engagement bei US-Duration war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen während des Berichtszeitraums anstiegen.
- » Tendenzielle Short-Positionen beim US-Dollar belasteten die Wertentwicklung, da der USD gegenüber dem EUR aufgewertet wurde.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2011)	(0,82 %)	5,25 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2011)	(0,79 %)	5,25 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (29. Mai 2012)	(0,99 %)	5,24 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2011)	(1,31 %)	4,29 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2011)	(1,32 %)	4,29 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(1,48 %)	1,75 %
Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(1,50 %)	1,75 %
Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index	(0,11 %)	3,60 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional USD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Feb. 2018)	—	0,40 %
Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index (USD Hedged)	—	1,47 %

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit 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 Teilfonds 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 Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein Engagement bei europäischer Duration trug zur positiven Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.
- » Ein Engagement bei Non-Agency-MBS trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Gesamrenditen dieser Wertpapiere positiv ausfielen.
- » Ein Short-Engagement bei britischer Duration trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Renditen stiegen.
- » Ein Engagement bei Finanzwerten mit Investment Grade belastete die absolute Wertentwicklung, da diese Wertpapiere negative Überschussrenditen verbuchten.
- » Ein Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die absolute Wertentwicklung, da diese Wertpapiere negative Überschussrenditen verbuchten.
- » Ein Engagement bei auf Hartwährungen lautenden Staatsanleihen aus Schwellenländern belastete die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

# Euro Long Average Duration Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Auflegung von Klassen
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. April 2006)	3,79 %	7,87 %
Bloomberg Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index <sup>2</sup>	4,46 %	6,54 %

<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: 21. April 2006 bis 31. März 2011 — (FTSE Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond > 15 Years Index); 31. März 2011 bis 31. Januar 2012 — (FTSE Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond AAA rated > 15 Years Index); seit dem 31. Januar 2012 — (Bloomberg Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 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 Teilfonds 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 Teilfonds von Engagements bei auf Euro lautenden staatlichen und/oder regierungsnahen Rentenwerten ab.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Ein übergewichtetes Engagement bei US-Duration belastete die relative Wertentwicklung, da die Renditen für sämtliche Laufzeiten anstiegen.
- » Allokationen auf ausgewählte Unternehmensanleihen, insbesondere aus dem Industriesektor, schmälerten die Wertentwicklung, da sich die Spreads dieses Sektors während des ersten Halbjahres erweiterten.
- » Ein Short-Engagement beim US-Dollar gegenüber einem Korb von Schwellenmarktwährungen belastete die Wertentwicklung, da der US-Dollar aufgewertet wurde.
- » Eine Untergewichtung italienischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Auflegung von Klassen
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Juli 2011)	(0,61 %)	1,88 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. März 2013)	(0,99 %)	0,08 %
Bloomberg Barclays Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index <sup>2</sup>	(0,04 %)	1,71 % <sup>3</sup>

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Low Duration Fund repräsentiert Folgendes: 30. Juni 2011 bis 30. September 2012 — (PIMCO European Advantage Government 1-3 Year Bond Index); seit dem 30. September 2012 — (Barcap Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index). Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem 30. Juni 2011 berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Low Duration Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds 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. Die durchschnittliche Portfolio-Duration des Teilfonds liegt grundsätzlich innerhalb eines Bereichs von etwa zwei Jahren über oder unter der Duration des Bloomberg Barclays Euro Aggregate ex-Treasury 1-3 Year Index.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Long-Engagement bei ausgewählten schwedischen gedeckten Anleihen wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere positive Gesamtrenditen lieferten.
- » Ein Long-Engagement bei ausgewählten Wertpapieren regierungsnaher Einrichtungen wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere positive Gesamtrenditen lieferten.
- » Ein Long-Engagement beim MXN wirkte sich angesichts des positiven Carry und der Aufwertung gegenüber dem EUR positiv auf die relative Wertentwicklung aus.
- » Ein Engagement bei italienischen Staatsanleihen mit kurzer Laufzeit wirkte sich negativ auf die relative Wertentwicklung aus, da Renditen abverkauft wurden.
- » Eine Untergewichtung des langen Endes der japanischen Zinsstrukturkurve belastete die relative Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.
- » Ein Long-Engagement bei ausgewählten Schwellenmarktwährungen, unter anderem beim RUB und der TRY, belastete die relative Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem EUR abgewertet wurden.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Auflegung von Klassen
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Jan. 2006)	(0,82 %)	1,56 %
Institutional, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 06. Mai 2016)	(0,87 %)	(0,51 %)
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(1,25 %)	0,79 %
1 Month Euribor Rate Index	(0,19 %)	1,09 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Short-Term Fund ist bestrebt, bei Kapitalerhaltung und täglicher Liquidität höchstmögliche laufende Erträge zu erzielen. Der Teilfonds 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.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Long-Engagement bei ausgewählten schwedischen gedeckten Anleihen wirkte sich positiv auf die absolute Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere positive Gesamtrenditen lieferten.
- » Ein Long-Engagement beim MXN wirkte sich angesichts des positiven Carry positiv auf die absolute Wertentwicklung aus.
- » Ein Long-Engagement bei der NOK wirkte sich positiv auf die absolute Wertentwicklung aus, da die Währung gegenüber dem EUR aufgewertet wurde.
- » Ein Long-Engagement bei italienischer Duration belastete die absolute Wertentwicklung, da die Renditen abverkauft wurden.
- » Ein Long-Engagement bei europäischer Duration war der absoluten Wertentwicklung aufgrund negativer kurzfristiger Renditen in der Eurozone abträglich.
- » Ein Long-Engagement bei ausgewählten Schwellenmarktwährungen, unter anderem beim RUB und der TRY, belastete die absolute Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem EUR abgewertet wurden.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Juni 2009)	(2,10 %)	3,40 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. Dez. 2010)	(2,61 %)	1,07 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 10. Dez. 2010)	(2,54 %)	1,07 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	(2,44 %)	2,82 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Partially Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 2. Aug. 2011)	(1,41 %)	2,59 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (CHF, Partially Hedged) (London Close)	(1,86 %)	1,97 %
<b>Auf DKK lautende Klassen</b>		
Institutional DKK (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. März 2013)	(1,18 %)	1,59 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (DKK, Partially Hedged) (London Close)	(1,53 %)	0,88 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Mai 2010)	(1,16 %)	3,12 %
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 6. Mai 2010)	(1,66 %)	2,10 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (EUR, Partially Hedged) (London Close)	(1,51 %)	2,63 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Juli 2012)	(0,83 %)	2,97 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (GBP, Partially Hedged) (London Close)	(1,20 %)	2,44 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. März 2012)	(1,31 %)	4,46 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (NOK, Partially Hedged) (London Close)	(1,63 %)	3,90 %

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » US-Zinsstrategien trugen zur relativen Wertentwicklung bei, vor allem aufgrund des Carry und der Titelauswahl.
- » Eine Untergewichtung italienischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen stiegen.
- » Eine Untergewichtung der Spread-Risiken von Kreditwerten mit Investment Grade trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads erweiterten.
- » Ein Engagement bei Non-Agency-MBS trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Gesamtrenditen dieser Wertpapiere positiv ausfielen.
- » Ein Long-Engagement bei einem Korb von Schwellenmarktwährungen mit hohem Carry (ARS, TRY, RUB) belastete die relative Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurden.
- » Ein Engagement bei auf Hartwährungen lautenden Staatsanleihen aus Schwellenländern belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.
- » Eine Untergewichtung japanischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Renditen sanken.

# Global Advantage Real Return Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Juli 2011)	(4,30 %)	(1,31 %)
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Dez. 2012)	(4,67 %)	(3,61 %)
Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 8. Nov. 2012)	(3,92 %)	(1,74 %)
PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged)	(3,61 %)	(0,72 %) <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 27. März 2012)	(3,14 %)	(0,22 %)
PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (CHF Partial Hedged)	(2,56 %)	0,30 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Juli 2011)	(2,75 %)	0,85 %
Institutional EUR (Partially Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 5. März 2013)	(2,72 %)	(1,42 %)
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Dez. 2012)	(3,13 %)	(1,93 %)
Class G Institutional EUR (Partially Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(2,70 %)	0,77 %
PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (EUR Partial Hedged)	(2,09 %)	1,47 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Partially Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2012)	(2,53 %)	0,90 %
PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (GBP Partial Hedged)	(1,97 %)	1,49 %

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Advantage Real Return Fund versucht, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung eine höchstmögliche reale Rendite zu erzielen, indem er mindestens 70 % seines Nettovermögens in internationale, inflationsindexierte Rentenwerte in Landeswährung aus Industrie- und Schwellenmärkten anlegt (wie im Verkaufsprospekt definiert).

## Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung des langen Endes der brasilianischen Realrenditekurve wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da die entsprechenden Realrenditen stiegen.
- » Eine Untergewichtung der nominalen US-Duration kam der relativen Wertentwicklung zugute, da die Renditen anstiegen.
- » Die Positionierung entlang der britischen nominalen Renditekurve, insbesondere die Untergewichtung des 10-jährigen Teils im Januar, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da die britische 10-jährige Nominalrendite anstieg.
- » Eine Übergewichtung der brasilianischen nominalen Duration belastete die relative Wertentwicklung, da brasilianische Nominalrenditen allgemein zulegten.
- » Eine Übergewichtung der US-Realduration belastete die relative Wertentwicklung, da die US-Realrenditen zulegten.
- » Eine Übergewichtung italienischer ILBs belastete die relative Wertentwicklung, da italienische Realrenditen allgemein zulegten.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 12. Jan. 2017)	0,00 %	2,58 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(0,46 %)	1,70 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index	0,07 %	2,01 %
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 12. Jan. 2017)	0,26 %	3,53 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (AUD Hedged)	0,06 %	2,42 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(1,48 %)	0,00 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (CHF Hedged) Index	(1,42 %)	(0,63 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(1,18 %)	0,48 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung 12. Jan. 2017)	(1,22 %)	0,41 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Feb. 2017)	(1,68 %)	(0,29 %)
Bloomberg Barclays Global Aggregate (EUR Hedged) Index	(1,21 %)	(0,16 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(0,71 %)	1,33 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Hedged) Index	(0,71 %)	0,75 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(0,58 %)	1,77 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (NOK Hedged) Index	(0,51 %)	1,15 %
<b>Auf NZD lautende Klassen</b>		
Institutional NZD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 05. April 2017)	0,09 %	2,86 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (NZD Hedged) Index	0,21 %	2,57 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond ESG Fund beabsichtigt, einen höchstmöglichen 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) anlegt, die auf weltweit führende Währungen lauten.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung italienischer Duration wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da die Renditen anstiegen.
- » Eine Untergewichtung britischer Duration wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da die Renditen abverkauft wurden.
- » Ein Engagement bei Non-Agency-MBS trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Gesamterträge dieser Wertpapiere positiv ausfielen.
- » Eine Untergewichtung der Spread-Risiken von Kreditwerten mit Investment Grade trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads erweiterten.
- » Ein Long-Engagement bei einem Korb von Schwellenmarktwährungen (ARS, CNH, TRY, RUB) belastete die relative Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem USD abgewertet wurden.
- » Eine Untergewichtung des langen Endes der japanischen Zinsstrukturkurve belastete die relative Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.
- » Ein Engagement bei hochverzinslichen Finanzwerten wirkte sich negativ auf die relative Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere negative Renditen verbuchten.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 12. März 1998)	0,29 %	5,70 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. April 2001)	0,31 %	5,42 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 1. März 1999)	0,14 %	5,19 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Jan. 2001)	0,15 %	5,06 %
Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Juni 2004)	0,04 %	4,87 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(0,11 %)	4,46 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(0,15 %)	4,36 %
Class G Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. Apr. 2015)	0,28 %	2,62 %
Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Okt. 2002)	0,20 %	5,13 %
Class H Institutional, ausschüttende Anteile (Auflegung: 12. Apr. 2016)	0,25 %	3,46 %
Class M Retail, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 26. April 2017)	(0,23 %)	1,82 %
Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,17 %	3,31 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(0,27 %)	2,40 %
Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(0,26 %)	2,41 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index <sup>3</sup>	0,07 %	4,85 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional USD (Unhedged Exposure) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Dez. 2002)	(1,16 %)	5,12 %
Institutional USD (Currency Exposure) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. März 2006)	(1,14 %)	4,88 %
Investor USD (Currency Exposure) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2005)	(1,35 %)	3,94 %
Class E USD (Currency Exposure), thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Mai 2010)	(1,62 %)	3,04 %
Class E USD (Currency Exposure), ausschüttende Anteile (Auflegung: 19. Mai 2010)	(1,63 %)	3,03 %
Class R USD (Currency Exposure), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,31 %)	0,90 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index	(1,46 %)	4,10 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Mai 2003)	(1,16 %)	3,48 %
Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 10. April 2003)	(1,16 %)	3,53 %
Investor CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Juni 2011)	(1,32 %)	3,44 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Juni 2018)	—	0,50 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (CHF Hedged) Index	(1,42 %)	2,49 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 4. April 2003)	(0,96 %)	4,61 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 12. April 2005)	(0,97 %)	4,59 %
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Feb. 2005)	(1,16 %)	4,21 %
Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. Mai 2016)	(1,26 %)	0,84 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(1,44 %)	3,92 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(1,50 %)	1,07 %
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Apr. 2016)	(0,99 %)	1,53 %
Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 12. Dez. 2012)	(1,36 %)	1,70 %
Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,13 %)	2,31 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(1,60 %)	1,13 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 9. Aug. 2017)	(1,07 %)	(0,77 %)
Bloomberg Barclays Global Aggregate (EUR Hedged) Index	(1,21 %)	3,53 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional EUR (Currency Exposure) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Feb. 2013)	1,64 %	4,13 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (EUR Unhedged) Index	1,35 %	3,42 %

Der Global Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » US-Zinsstrategien trugen zur relativen Wertentwicklung bei, vor allem aufgrund des Carry und der Titelauswahl.
- » Ein Engagement bei Non-Agency-MBS trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Gesamtrenditen dieser Wertpapiere positiv ausfielen.
- » Eine Untergewichtung italienischer Duration wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da die Renditen anstiegen.
- » Eine Untergewichtung der Spread-Risiken von Kreditwerten mit Investment Grade trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads erweiterten.
- » Ein Long-Engagement bei einem Korb von Schwellenmarktwährungen mit hohem Carry (ARS, TRY, RUB) belastete die relative Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurden.
- » Ein Engagement bei auf Hartwährungen lautenden Staatsanleihen aus Schwellenländern belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.
- » Ein Engagement bei hochverzinslichen Finanzwerten wirkte sich negativ auf die relative Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere negative Renditen verbuchten.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>  
(Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. April 2003)	(0,47 %)	5,57 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 1. Juni 2004)	(0,49 %)	5,68 %
Investor GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. April 2005)	(0,64 %)	5,02 %
Administrative GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 2. Feb. 2007)	(0,66 %)	5,14 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Nov. 2009)	(0,92 %)	4,57 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,63 %)	3,04 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Hedged) Index	(0,71 %)	4,57 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional GBP (Currency Exposure) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 09. März 2018)	—	2,80 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Unhedged) Index	—	2,94 %
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class M Retail HKD (Unhedged), ausschüttende Anteile II (Auflegung: 26. April 2017)	0,17 %	2,51 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (HKD Unhedged) Index	(1,10 %)	3,33 %
<b>Auf ILS lautende Klassen</b>		
Institutional ILS (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Mai 2010)	(0,59 %)	5,25 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (ILS Hedged) Index	(0,93 %)	3,72 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2005)	(0,31 %)	5,76 %
Investor NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 26. Juli 2006)	(0,49 %)	5,99 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (NOK Hedged) Index	(0,51 %)	4,60 % <sup>2</sup>
<b>Auf NZD lautende Klassen</b>		
Institutional NZD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 1. Nov. 2004)	0,43 %	8,09 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (NZD Hedged) Index	0,21 %	6,94 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Nov. 2004)	(1,01 %)	4,87 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (SEK Hedged) Index	(1,26 %)	3,68 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. Aug. 2009)	(0,12 %)	6,09 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (SGD Hedged) Index	(0,26 %)	3,89 %

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

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

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. November 2000: JPMorgan GBI Global Index Hedged in USD. Seit dem 1. Dezember 2000: Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2003)	1,90 %	5,30 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 9. Nov. 2005)	1,85 %	5,58 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2006)	1,69 %	5,18 %
Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Sep. 2004)	1,63 %	5,09 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. April 2008)	1,43 %	5,00 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index <sup>3</sup>	1,42 %	4,14 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Class E USD (Currency Exposure), ausschüttende Anteile (Auflegung: 4. Oktober 2016)	(1,21 %)	(0,01 %)
Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Unhedged) Index	(1,31 %)	(0,57 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 4. April 2006)	0,59 %	5,29 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (EUR Hedged) Index <sup>4</sup>	0,12 %	3,76 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.  
<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit 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: Von der Auflegung bis zum 19. Januar 2016: FTSE World Government Bond Ex-U.S. Index (USD Hedged). Seit dem 20. Januar 2016: Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index.  
<sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Ex-US Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 19. Januar 2016: FTSE World Government Bond Ex-U.S. Index (EUR Hedged). Seit dem 20. Januar 2016: Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (EUR 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 Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine Untergewichtung britischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen stiegen.
- » Eine Untergewichtung italienischer Duration wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da die Renditen anstiegen.
- » Ein Engagement bei Non-Agency-MBS trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen dieser Wertpapiere positiv ausfielen.
- » Eine untergewichtete Engagement der Spread-Risiken von Kreditwerten mit Investment Grade trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads erweiterten.
- » Ein Long-Engagement bei einem Korb von Schwellenmarktwährungen mit hohem Carry (ARS, TRY, RUB) belastete die relative Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurden.
- » Ein Engagement bei hochverzinslichen Finanzwerten wirkte sich negativ auf die relative Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere negative Renditen verbuchten.
- » Positionen bei auf Hartwährungen lautenden Schuldtiteln aus Schwellenländern belasteten die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2005)	(0,93 %)	6,79 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(0,88 %)	6,84 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Juni 2016)	(1,15 %)	5,81 %
Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 27. Juni 2008)	(1,15 %)	6,62 %
Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Dez. 2015)	(1,20 %)	6,97 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2006)	(1,35 %)	5,82 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2006)	(1,38 %)	5,91 %
Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Aug. 2008)	(1,00 %)	7,17 %
Class H Institutional, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. März 2013)	(0,99 %)	4,55 %
Class M Retail, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2010)	(1,34 %)	5,44 %
Class M Retail, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(1,36 %)	3,72 %
Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,06 %)	4,89 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(1,55 %)	3,72 %
Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(1,54 %)	3,71 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD <sup>2</sup>	(0,42 %)	7,09 % <sup>3</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Feb. 2010)	(2,37 %)	5,86 %
Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Aug. 2012)	(2,36 %)	4,11 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into CHF	(1,94 %)	6,16 % <sup>3</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Mai 2008)	(2,16 %)	6,09 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(2,11 %)	6,12 %
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 05. Jan. 2011)	(2,35 %)	4,92 %
Administrative EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 4. Aug. 2010)	(2,35 %)	5,26 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(2,61 %)	5,07 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 29. April 2016)	(2,62 %)	3,19 %
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2015)	(2,19 %)	3,68 %
Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. März 2012)	(2,59 %)	4,00 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Okt. 2016)	(2,76 %)	1,17 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into EUR <sup>2</sup>	(1,75 %)	6,15 % <sup>3</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Mai 2012)	(1,74 %)	5,86 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(1,76 %)	6,77 %
Administrative GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 21. Juli 2010)	(1,86 %)	5,93 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Juni 2009)	(2,16 %)	7,59 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,79 %)	4,50 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into GBP <sup>2</sup>	(1,26 %)	6,83 % <sup>3</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Class E SGD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Apr. 2016)	(1,72 %)	5,17 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into SGD <sup>2</sup>	(0,76 %)	6,48 %

Der Global High Yield Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl im Einzelhandelssektor kam der Wertentwicklung zugute, da die Beteiligungen des Fonds im Einzelhandelssektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Gesundheitssektor verstärkte die Wertentwicklung, da der Sektor den Gesamtmarkt übertraf.
- » Die Titelauswahl im Finanz- und Versicherungssektor wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Beteiligungen des Fonds im Finanz- und Versicherungssektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Telekommunikationssektor war der Wertentwicklung abträglich, da die Beteiligungen des Fonds im Telekommunikationssektor schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl bei nicht zyklischen Konsumgütern belastete die Wertentwicklung, da die Beteiligungen des Fonds im Sektor für nicht zyklische Konsumgüter schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Bankensektor belastete die Wertentwicklung, da die Beteiligungen des Fonds im Bankensektor schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global High Yield Fund repräsentiert Folgendes: Seit Auflegung bis zum 31. März 2014 — (BofA Merrill Lynch Global High Yield, BB-B Rated, Constrained Index); seit dem 1. April 2014 — (BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD).

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Apr. 2008)	(1,59 %)	5,85 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Juli 2003)	(1,63 %)	5,59 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2005)	(1,77 %)	5,01 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(1,82 %)	6,56 %
Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Jan. 2009)	(1,83 %)	6,39 %
Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 21. Jan. 2009)	(1,86 %)	6,40 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. Dez. 2008)	(2,01 %)	6,25 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. April 2008)	(2,03 %)	4,82 %
Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Aug. 2008)	(1,66 %)	5,94 %
Class H Institutional, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Mai 2018)	—	(0,20 %)
Class M Retail, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Sept. 2012)	(2,01 %)	2,83 %
Class M Retail, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(2,03 %)	3,48 %
Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,73 %)	3,24 %
Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,74 %)	3,26 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(2,25 %)	2,28 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	(1,54 %)	4,45 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional USD (Currency Exposure) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Aug. 2013)	(2,98 %)	2,92 %
Institutional USD (Currency Exposure) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 6. Sept. 2016)	(3,00 %)	1,25 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Unhedged)	(2,94 %)	2,23 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Investor AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Juni 2018)	—	0,00 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (AUD Hedged)	—	0,10 %
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Investor CAD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Juni 2018)	—	0,00 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (CAD Hedged)	—	0,10 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. Dez. 2009)	(3,06 %)	4,19 %
Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 6. Feb. 2015)	(3,12 %)	1,03 %
Investor CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. Mai 2011)	(3,23 %)	2,91 %
Investor CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(3,27 %)	5,38 %
Administrative CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Jan. 2013)	(3,29 %)	1,55 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile, (Auflegung: 6. März 2012)	(3,46 %)	2,14 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)	(3,04 %)	4,26 % <sup>2</sup>
<b>Auf CNH lautende Klassen</b>		
Investor CNH (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Juni 2018)	—	0,11 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (CNH Hedged)	—	—
<b>Auf CZK lautende Klassen</b>		
Institutional CZK (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 19. Mai 2015)	(2,73 %)	1,36 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (CZK Hedged)	(2,55 %)	0,82 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Sept. 2003)	(2,90 %)	5,04 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Sept. 2008)	(2,91 %)	5,75 %
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Mai 2006)	(3,07 %)	4,79 %
Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(3,02 %)	6,01 %
Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Feb. 2009)	(3,12 %)	5,69 %
Administrative EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 17. Feb. 2009)	(3,18 %)	5,68 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(3,28 %)	4,13 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 9. Sept. 2010)	(3,33 %)	3,15 %
Class G Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Apr. 2016)	(2,94 %)	1,67 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(3,05 %)	2,21 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(3,44 %)	1,00 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)	(2,82 %)	3,85 % <sup>2</sup>

Der Global Investment Grade Credit Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel 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, deren Emittenten ihren eingetragenen Geschäftssitz oder ihre überwiegende Geschäftstätigkeit in mindestens drei Ländern haben, von denen eines die USA sein können.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Engagement bei Non-Agency-Hypotheken in den USA wirkte sich positiv aus, da der Sektor besser abschnitt als der Markt insgesamt.
- » Eine Übergewichtung des Pipeline-Sektors wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da der Sektor besser abschnitt als der Markt insgesamt.
- » Eine Untergewichtung des Versorgungssektors wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da der Sektor schlechter abschnitt als der Markt insgesamt.
- » Ein Long-Engagement bei Schwellenmarktwährungen und auf Lokalwährungen lautenden Schuldtiteln, die sich unterdurchschnittlich entwickelten, belastete die Wertentwicklung.
- » Ein Long-Engagement bei zusätzlichen Tier-1-Anleihen, die schlechter abschnitten als der Gesamtmarkt, schmälerte die Wertentwicklung.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>  
(Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional EUR (Currency Exposure) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Aug. 2012)	(0,24 %)	3,53 %
Class G Retail EUR (Currency Exposure), ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Juli 2014)	(0,64 %)	4,45 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (EUR Unhedged)	(0,17 %)	3,30 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Sept. 2005)	(2,38 %)	5,41 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Juli 2008)	(2,42 %)	6,10 %
Investor GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(2,56 %)	6,44 %
Administrative GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Jan. 2009)	(2,66 %)	6,24 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. März 2009)	(2,83 %)	6,02 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(2,55 %)	2,95 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)	(2,34 %)	4,37 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class M Retail HKD (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Juli 2017)	(1,74 %)	(0,32 %)
Administrative HKD (Unhedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Juli 2017)	(1,56 %)	0,09 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (HKD Unhedged) Credit Index	(2,59 %)	(0,50 %)
<b>Auf HUF lautende Klassen</b>		
Institutional HUF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. April 2015)	(2,84 %)	2,02 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (HUF Hedged)	(2,69 %)	1,36 %
<b>Auf ILS lautende Klassen</b>		
Institutional ILS (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Mai 2010)	(2,53 %)	5,16 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (ILS Hedged)	(2,56 %)	4,43 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Jan. 2012)	(2,23 %)	5,31 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (NOK Hedged)	(2,13 %)	4,48 %
<b>Auf PLN lautende Klassen</b>		
Institutional PLN (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 10. Juni 2015)	(2,18 %)	4,28 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (PLN Hedged)	(1,78 %)	3,65 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 4. Dez. 2009)	(2,93 %)	5,29 %
Administrative SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Dez. 2012)	(3,18 %)	2,15 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)	(2,91 %)	4,27 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(2,00 %)	4,16 %
Investor SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Mai 2018)	—	0,10 %
Administrative SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Sept. 2017)	(2,27 %)	(1,68 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Juli 2012)	(2,44 %)	3,07 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (SGD Hedged)	(1,88 %)	3,34 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Jan. 2016)	0,19 %	3,03 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Jan. 2018)	—	0,00 %
1 Month USD LIBOR Index	0,88 %	0,99 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(1,15 %)	1,11 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 04. Apr. 2018)	—	(0,31 %)
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Jan. 2018)	—	(1,00 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Okt. 2017)	(1,41 %)	(2,00 %)
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 20. März 2018)	—	(0,30 %)
1 Month Euribor Index	(0,19 %)	(0,36 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(0,57 %)	2,08 %
1 Month GBP-LIBOR-Index	0,25 %	0,38 %

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der 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 Teilfonds strebt Renditen an, die mittel- bis langfristig den 1-Monats-USD-LIBOR (ein Maß der Rendite von Geldmarktpapieren) übersteigen. Hierfür investiert er auf Basis der Beurteilung globaler Rentenwerte durch die Anlageberatungsgesellschaft flexibel in eine Vielzahl festverzinslicher Instrumente.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Short-Engagement bei italienischer Duration wirkte sich positiv auf die absolute Wertentwicklung aus, da die Renditen anstiegen.
- » Ein Engagement bei Non-Agency-MBS trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Gesamtrenditen dieser Wertpapiere positiv ausfielen.
- » Short-Engagements beim Euro trugen zur absoluten Wertentwicklung bei, da dieser gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Ein Engagement bei US-Barzinsen wirkte sich positiv auf die absolute Wertentwicklung aus.
- » Das Engagement bei US-Duration belastete die absolute Wertentwicklung, da die Renditen anstiegen.
- » Long-Engagements beim argentinischen Peso belasteten die absolute Wertentwicklung, da dieser gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Ein Engagement bei auf Hartwährungen lautenden Schuldtiteln aus Schwellenländern belastete die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere erweiterten.

# Global Low Duration Real Return Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,48 %	0,88 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. März 2018)	—	0,48 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Okt. 2016)	0,39 %	1,26 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,10 %	(0,02 %)
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	0,92 %	0,99 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(0,92 %)	(0,81 %)
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (CHF Hedged)	(0,57 %)	(0,81 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(0,80 %)	(0,32 %)
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung 17. Jan. 2017)	(0,77 %)	(0,87 %)
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 9. Dez. 2014)	(0,79 %)	(0,37 %)
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Okt. 2016)	(0,91 %)	(0,87 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(1,25 %)	(1,22 %)
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (EUR Hedged)	(0,37 %)	(0,22 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Jan. 2017)	(0,30 %)	0,07 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(0,35 %)	0,44 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (GBP Hedged)	0,13 %	0,56 % <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 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.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Engagement bei der Realduration in den USA sowie in Großbritannien und Italien belastete die absolute Wertentwicklung, da die Realrenditen in diesen Ländern anstiegen.
- » Eine Untergewichtung der nominalen US-Duration kam der relativen Wertentwicklung zugute, da die nominalen Renditen in den USA anstiegen.
- » Eine Übergewichtung der italienischen Realduration belastete die relative Wertentwicklung, da die italienischen Realrenditen zulegten.
- » Eine Übergewichtung der US-Realduration belastete die relative Wertentwicklung, da die US-Realrenditen zulegten.
- » Ein erhöhtes Engagement bei Auslandsschulden von Schwellenländern in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums belastete die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere während dieses Zeitraums negative Renditen verbuchten.
- » Eine Untergewichtung des Bauchs der französischen nominalen Renditekurve belastete die relative Wertentwicklung, da die entsprechenden Renditen sanken.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. April 2009)	(0,88 %)	5,88 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Sept. 2010)	(0,93 %)	3,18 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Juni 2009)	(1,43 %)	4,26 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Jan. 2011)	(1,39 %)	1,91 %
Class Z, thesaurierende Anteile (Auflegung: 6. Jul. 2016)	(0,41 %)	10,04 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged	(0,15 %)	8,88 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. April 2009)	(1,28 %)	5,36 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 26. Juli 2010)	(1,25 %)	3,62 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Juni 2009)	(1,96 %)	3,75 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 24. Juni 2011)	(1,90 %)	1,25 %
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2015)	(1,30 %)	4,52 %
Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Sept. 2011)	(1,89 %)	1,64 %
60 % MSCI All Country World Index EUR Hedged /40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate EUR Hedged	(0,63 %)	8,06 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Dez. 2012)	(0,84 %)	3,08 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. April 2010)	(0,76 %)	3,80 %
60 % MSCI All Country World Index GBP Hedged /40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate GBP Hedged	(0,16 %)	6,67 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Multi-Asset 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 Verkaufsprospekt beschrieben). Der Teifonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein übergewichtetes Engagement bei verbrieften Schuldtiteln, insbesondere bei Non-Agency-MBS, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere allgemein positive Renditen verbuchten.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei Schwellenmarktduration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere allgemein positive Renditen verbuchten.
- » Ein untergewichtetes Engagement bei Spreads von Titeln mit Investment Grade trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere allgemein negative Renditen verbuchten.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei Schwellenmarktwährungen, insbesondere beim argentinischen Peso, belastete die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere allgemein negative Renditen verbuchten.
- » Ein untergewichtetes Engagement bei US-Aktien schmälerte die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere allgemein einen Wertzuwachs verbuchten.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2003)	0,20 %	4,99 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005)	0,23 %	4,64 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 4. März 2004)	0,00 %	4,42 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 24. Feb. 2009)	(0,06 %)	5,55 %
Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Dez. 2004)	(0,05 %)	4,17 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(0,27 %)	3,93 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(0,28 %)	3,76 %
Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Mai 2004)	0,10 %	4,82 %
Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,00 %	2,36 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	0,40 %	4,79 %
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungseingagement)</b>		
Institutional USD (Unhedged Exposure) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 1. Sept. 2017)	(1,95 %)	0,50 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Unhedged Index	0,40 %	4,79 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. März 2014)	0,36 %	6,28 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond AUD Hedged Index	0,44 %	5,94 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Mai 2008)	(1,27 %)	3,34 %
Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(1,28 %)	2,52 %
Investor CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 24. Feb. 2009)	(1,43 %)	4,34 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond CHF Hedged Index	(1,05 %)	3,01 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2003)	(1,10 %)	4,39 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(1,08 %)	3,98 %
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. April 2004)	(1,27 %)	3,92 %
Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 24. Feb. 2009)	(1,30 %)	4,95 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(1,52 %)	3,32 %
Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,29 %)	1,30 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Jan. 2017)	(1,68 %)	(0,40 %)
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond EUR Hedged Index	(0,86 %)	4,12 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Feb. 2004)	(0,59 %)	5,36 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 27. April 2005)	(0,60 %)	4,85 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Juni 2009)	(1,09 %)	4,43 %
Class R GBP (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,71 %)	2,08 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,78 %)	2,07 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond GBP Hedged Index	(0,35 %)	5,17 % <sup>2</sup>
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. Juli 2017)	(1,11 %)	1,76 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond SEK Hedged Index	(0,88 %)	1,89 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Feb. 2008)	(0,26 %)	4,16 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond SGD Hedged Index	0,09 %	4,06 %

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit 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 Teilfonds 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.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Engagement bei der Realduration in den USA sowie in Großbritannien und Italien belastete die absolute Wertentwicklung, da die Realrenditen in diesen Ländern anstiegen.
- » Eine Untergewichtung der nominalen US-Duration kam der relativen Wertentwicklung zugute, da die Renditen anstiegen.
- » Die Positionierung entlang der britischen nominalen Renditekurve, die unter anderem ein untergewichtetes Engagement beim 10-jährigen Teil umfasste, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da die britische 10-jährige Nominalrendite anstieg.
- » Eine Übergewichtung der US-Realduration belastete die relative Wertentwicklung, da die US-Realrenditen zulegten.
- » Die Positionierung entlang der britischen Realrenditekurve, die unter anderem ein übergewichtetes Engagement am Bauch der Kurve umfasste, belastete die relative Wertentwicklung, da die Realrenditen in Großbritannien anstiegen.
- » Ein erhöhtes Engagement bei Auslandsschulden von Schwellenländern in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums belastete die relative Wertentwicklung, da der Sektor während dieses Zeitraums negative Renditen verbuchte.

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,84 %)	6,44 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,86 %)	6,46 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Jan. 2015)	(1,02 %)	4,67 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. April 2013)	(1,03 %)	4,58 %
Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Feb. 2017)	(1,14 %)	3,11 %
Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,06 %)	5,92 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,32 %)	5,50 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,36 %)	5,49 %
Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Mai 2018)	—	(0,10 %)
Class H Institutional, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Mai 2018)	—	(0,07 %)
Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. April 2015)	(0,96 %)	4,34 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(1,49 %)	3,28 %
Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(1,50 %)	3,29 %
Class Z, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,54 %)	7,02 %
Bloomberg Barclays US Aggregate Index	(1,62 %)	1,56 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Jan. 2018)	—	(0,90 %)
Investor AUD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Mai 2018)	—	0,13 %
Administrative AUD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 8. Juni 2016)	(1,15 %)	5,26 %
Class E AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Feb. 2017)	(1,28 %)	3,21 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2015)	(0,54 %)	6,57 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (AUD Hedged) Index	(1,65 %)	2,14 % <sup>2</sup>
<b>Auf BRL lautende Klassen</b>		
Institutional BRL (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Feb. 2016)	(12,93 %)	15,73 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (BRL Hedged) Index	1,93 %	10,68 %
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 1. Apr. 2016)	(1,14 %)	5,42 %
Bloomberg Barclays US Aggregate Index (CAD Hedged)	(1,98 %)	0,22 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Dez. 2014)	(2,38 %)	2,97 %
Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(2,30 %)	2,74 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(2,72 %)	2,42 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(2,78 %)	2,41 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (CHF Hedged) Index	(3,10 %)	0,26 % <sup>2</sup>
<b>Auf CNH lautende Klassen</b>		
Class E CNH (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Mai 2013)	(0,28 %)	6,46 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (CNH Hedged) Index	(0,67 %)	4,86 %
Investor CNH (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Jan. 2018)	—	(0,18 %)

Der Income Fund ist bestrebt, unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung hohe laufende Erträge zu erzielen, wobei das sekundäre Ziel der langfristige Kapitalzuwachs ist. Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Teilfonds strebt hohe Dividenden erträge 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Positionen bei Non-Agency-MBS trugen zur Wertentwicklung bei, da die Gesamtrenditen dieser Wertpapiere positiv ausfielen.
- » Tendenzielle Long-Positionen beim US-Dollar gegenüber dem japanischen Yen trugen zur Wertentwicklung bei, da der US-Dollar aufgewertet wurde.
- » Ein Engagement bei US-Barzinsen wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die kurzfristigen Zinsen weiter anstiegen.
- » Ein Engagement bei US-Zinsen war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze anstiegen.
- » Ein Long-Engagement im argentinischen Peso schmälerte die Wertentwicklung, da der argentinische Peso an Wert verlor.
- » Ein Long-Engagement bei der türkischen Lira belastete die Wertentwicklung, da die türkische Lira an Wert verlor.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>  
(Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(2,11 %)	5,43 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(2,16 %)	5,40 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 29. Juli 2014)	(2,19 %)	3,21 %
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. April 2015)	(2,26 %)	2,51 %
Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. Mai 2015)	(2,30 %)	2,71 %
Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende A-Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2015)	(2,33 %)	3,45 %
Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Aug. 2015)	(2,34 %)	2,81 %
Administrative EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 08. Juni 2016)	(2,39 %)	2,64 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(2,59 %)	4,48 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(2,57 %)	4,47 %
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(2,16 %)	3,79 %
Class H Institutional EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Juni 2017)	(2,27 %)	(0,88 %)
Class R EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(2,26 %)	3,74 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(2,72 %)	1,92 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(2,81 %)	1,90 %
Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Aug. 2017)	(2,53 %)	(2,33 %)
Bloomberg Barclays US Aggregate (EUR Hedged) Index	(2,88 %)	0,58 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2013)	(1,64 %)	4,72 %
Administrative GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 2. Sept. 2016)	(1,89 %)	2,70 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. März 2017)	(2,11 %)	1,09 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,68 %)	5,83 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (GBP Hedged) Index	(2,39 %)	1,31 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Institutional HKD (Unhedged) Class, ausschüttende Anteile (am 30. Okt. 2015 aufgelegt)	(0,56 %)	5,60 %
Administrative HKD (Unhedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 26. April 2017)	(0,80 %)	2,85 %
Class E HKD (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 4. Feb. 2013)	(1,01 %)	4,39 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (HKD Unhedged) Index	(1,26 %)	1,98 % <sup>2</sup>
<b>Auf JPY lautende Klassen</b>		
Institutional JPY (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 1. Sept. 2017)	(1,99 %)	(1,50 %)
Class E JPY (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 01. Sept. 2017)	(2,50 %)	(2,30 %)
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index	(2,71 %)	(3,23 %)
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. April 2017)	(1,47 %)	1,78 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (NOK Hedged) Index	(2,18 %)	(1,05 %)
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2015)	(1,21 %)	5,71 %
Investor SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Mai 2018)	—	0,13 %
Administrative SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,49 %)	6,01 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 19. Feb. 2013)	(1,70 %)	4,25 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (SGD Hedged) Index	(1,95 %)	1,66 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

# Inflation Strategy Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Feb. 2013)	(2,11 %)	(1,34 %)
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Feb. 2013)	(2,68 %)	(2,52 %)
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung, 14. Feb. 2013)	(2,58 %)	(2,51 %)
45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1-30 Year Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government ILB 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 <sup>4</sup>	(1,14 %)	(0,97 %)
OECD CPI + 3 % (3 Month Lag) <sup>2</sup>	2,74 %	4,53 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 23. Mai 2013)	(2,33 %)	(1,54 %)
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. April 2013)	(2,93 %)	(2,83 %)
Class E EUR (Partially Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. April 2013)	(2,83 %)	(2,83 %)
45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1-30 Year Index (EUR Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government ILB Index (EUR Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (EUR Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return <sup>4</sup>	(1,45 %)	(0,82 %) <sup>3</sup>
OECD CPI + 3 % (3 Month Lag) <sup>2</sup>	2,74 %	4,56 % <sup>3</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Mai 2014)	(2,01 %)	(0,57 %)
45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1-30 Year Index (GBP Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government ILB Index (GBP Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (GBP Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return <sup>4</sup>	(1,23 %)	(0,13 %)
OECD CPI + 3 % (3 Month Lag) <sup>2</sup>	2,74 %	4,63 %

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

<sup>2</sup> OECD CPI + 3 % (3 Month Lag) - Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem 31. Januar 2013 berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Inflation Strategy Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 31. März 2017: 45 % Global Advantage ILB Index (USD Partial Hdg), 30 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD), 15 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % Bloomberg Gold Total Return Index. Seit dem 1. April 2017: 45 % BBG Barclays Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD hedged), 15 % BBG Barclays Emerging Market Government ILB Index (USD unhedged), 10 % BBG Commodity TR Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed TR Index (USD unhedged), 15 % Alerian MLP TR Index, 5 % BBG Gold Subindex TR.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Inflation Strategy Fund beabsichtigt, den realen Kapitalwert mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu erhalten. Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und legt primär in ein diversifiziertes Portfolio an, das aus inflationsgekoppelten Anlagen besteht. Der Teilfonds 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 bei solchen Anlagen können durch direkte Anlagen oder die Verwendung von Finanzderivaten erreicht werden, wie im Verkaufsprospekt näher erläutert. Der Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein Engagement bei globalen inflationsgebundenen Anleihen und Rohstoffen belastete die absolute Wertentwicklung, da diese Anlageklassen während des Berichtszeitraums Verluste verbuchten.
- » Eine Untergewichtung der nominalen US-Duration kam der relativen Wertentwicklung zugute, da die nominalen Renditen in den USA anstiegen.
- » Eine Untergewichtung des langen Endes der brasilianischen Realrenditekurve wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da die entsprechenden Realrenditen stiegen.
- » Eine Übergewichtung der US-Realduration belastete die relative Wertentwicklung, da die US-Realrenditen zulegten.
- » Eine Übergewichtung der brasilianischen nominalen Duration belastete die relative Wertentwicklung, da brasilianische Nominalrenditen allgemein zulegten.
- » Ein Engagement bei RMBS belastete die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere negative Renditen verbuchten.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Dez. 2002)	(0,65 %)	2,74 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 5. Dez. 2002)	(0,69 %)	2,73 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Mai 2004)	(0,89 %)	2,48 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Juli 2003)	(0,87 %)	2,30 %
Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Sep. 2004)	(0,91 %)	2,28 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Sept. 2007)	(1,13 %)	1,70 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(1,08 %)	2,03 %
Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 4. Nov. 2009)	(0,77 %)	1,66 %
Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,77 %)	0,60 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index	0,09 %	1,98 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 23. Nov. 2015)	(0,57 %)	1,97 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (AUD Hedged)	(0,08 %)	1,31 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Jan. 2012)	(1,90 %)	0,52 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(1,90 %)	2,33 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Juli 2009)	(2,35 %)	0,59 %
Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(2,00 %)	(0,36 %)
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (EUR Hedged)	(1,18 %)	1,42 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Jan. 2017)	(1,49 %)	(0,69 %)
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 1. März 2010)	(1,45 %)	1,56 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,57 %)	0,33 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (GBP Hedged)	(0,69 %)	0,65 % <sup>2</sup>
<b>Auf ILS lautende Klassen</b>		
Institutional ILS (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Mai 2010)	(1,55 %)	1,68 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (ILS Hedged)	(0,94 %)	0,90 %

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit 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 Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine Untergewichtung US-amerikanischer Zinsen am vorderen Ende der Kurve trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Zinsen anstiegen.
- » Ein Long-Engagement beim argentinischen Peso gegenüber dem US-Dollar belastete die Wertentwicklung, da der argentinische Peso gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurde.
- » Ein Short-Engagement beim japanischen Yen gegenüber dem US-Dollar schmälerte die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.
- » Ein Long-Engagement bei der schwedischen Krone gegenüber dem US-Dollar belastete die Wertentwicklung, da die schwedische Krone gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurde.
- » Positionen bei Agency-MBS schmälerten die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere allgemein negative Gesamttrenditen verbuchten.

## Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(0,18 %)	2,18 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	0,15 %	1,94 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Dez. 2016)	(1,68 %)	(0,45 %)
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (CHF Hedged)	(1,36 %)	(0,74 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(1,51 %)	1,00 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(1,96 %)	0,07 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (EUR Hedged)	(1,14 %)	0,72 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(1,01 %)	1,73 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (GBP Hedged)	(0,64 %)	1,51 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. Juli 2017)	(0,83 %)	(0,32 %)
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Yrs Index (NOK Hedged)	(0,44 %)	0,00 %

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

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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein Übergewichtetes Engagement bei der Duration europäischer Kernländer trug zur Wertentwicklung bei, da deutsche Zinsen während des Berichtszeitraums sanken.
- » Die Wertpapierauswahl im Technologiesektor trug zur Wertentwicklung bei.
- » Eine Übergewichtung des Pipeline-Sektors wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da der Sektor besser abschnitt als der Markt insgesamt.
- » Ein Long-Engagement bei Schwellenmarktwährungen, die sich unterdurchschnittlich entwickelten, belastete die Wertentwicklung.
- » Ein Engagement bei auf Lokalwährungen lautenden Schuldtiteln aus Schwellenländern, die sich unterdurchschnittlich entwickelten, belastete die Wertentwicklung.
- » Eine Untergewichtung von Wertpapieren regierungsnaher Einrichtungen schmälerte die Wertentwicklung, da der Sektor besser abschnitt als der Markt insgesamt.

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	0,10 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	0,11 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	0,10 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index	—	0,01 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	(0,10 %)
Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	(0,09 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	(0,20 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	(0,25 %)
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (CHF Hedged)	—	(0,27 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	(0,10 %)
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	(0,10 %)
Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	(0,12 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	(0,20 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	(0,15 %)
Class G Retail EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	(0,20 %)
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (EUR Hedged)	—	(0,23 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	0,00 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	0,01 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (GBP Hedged)	—	(0,15 %)
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Class E SGD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2018)	—	(0,05 %)
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (SGD Hedged)	—	(0,05 %)

Der Low Duration Income Fund beabsichtigt, attraktive Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu erzielen. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenspapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

Der Fonds hat die Geschäftstätigkeit am 31. Mai 2018 aufgenommen.

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014)	2,88 %	(5,34 %)
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014)	2,77 %	(5,37 %)
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Feb. 2018)	—	3,60 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 26. Apr. 2018)	—	5,01 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014)	2,08 %	(6,51 %)
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014)	2,14 %	(6,48 %)
Class E, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 25. Nov. 2014)	2,14 %	(6,52 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014)	1,17 %	(6,68 %)
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014)	1,22 %	(6,65 %)
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Apr. 2018)	—	4,60 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014)	0,54 %	(7,86 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014)	0,50 %	(7,83 %)
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 20. März 2018)	—	10,90 %
Alerian MLP Index EUR (Hedged)	(1,97 %)	(11,46 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014)	1,68 %	(6,41 %)
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014)	1,68 %	(6,42 %)
Class R GBP (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014)	1,56 %	(6,65 %)
Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014)	1,52 %	(6,64 %)
Alerian MLP Index GBP (Hedged)	(1,60 %)	(11,31 %)

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit 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 Teilfonds angestrebte „Gesamtrendite“ besteht aus Ertrag und Kapitalzuwachs. Der Teilfonds 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 Teilfonds kann in diese Instrumente entweder auf dem Sekundärmarkt oder während einer Neuemission anlegen.

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl im Sektor für Erdgasbeförderung in Pipelines trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Sektor.
- » Die Titelauswahl im Sektor für Rohölbeförderung in Pipelines trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Sektor.
- » Die Titelauswahl bei Kraftstoffhändlern und die Untergewichtung des Sektors trugen zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Sektor, während der Sektor insgesamt schlechter abschnitt als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl bei Großhändlern für Mineralölprodukte und die Untergewichtung des Sektors belasteten die relative Rendite, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Sektor, während der Sektor insgesamt besser abschnitt als der Vergleichsindex.
- » Eine Untergewichtung des Rohölförderungssektors war der relativen Rendite abträglich, da der Sektor besser abschnitt als der Vergleichsindex.
- » Eine Übergewichtung des Erdölraffineriesektors trug zur relativen Rendite bei, da der Sektor besser abschnitt als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Erdölraffineriesektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Sektor.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,29 %	3,27 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,24 %	3,29 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 17. Jan. 2018)	—	0,37 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 12. Mai 2017)	0,10 %	1,76 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,06 %	2,88 %
Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(0,01 %)	2,82 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(0,19 %)	2,37 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(0,21 %)	2,41 %
3 Month USD LIBOR Index	1,00 %	1,49 % <sup>2</sup>
<b>Auf BRL lautende Klassen</b>		
Institutional BRL (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Apr. 2018)	—	(10,80 %)
ICE BofAML 3 Month USD Libor Index Hedged BRL, auf USD lautend	—	(10,56 %)
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(1,27 %)	0,63 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 09. Aug. 2017)	(1,70 %)	(2,83 %)
3 Month USD LIBOR (in CHF besichert)	(0,47 %)	(1,08 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(0,97 %)	1,12 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung 25. Jan. 2017)	(1,00 %)	1,08 %
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 12. Mai 2017)	(1,19 %)	(0,44 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(1,47 %)	0,21 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 07. Juni 2017)	(1,47 %)	(1,33 %)
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 26. Apr. 2017)	(1,01 %)	0,05 %
Class Z EUR (Hedged) thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Mai 2017)	(0,69 %)	0,70 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Aug. 2017)	(1,62 %)	(2,60 %)
3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) Index	(0,26 %)	(0,62 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(0,48 %)	1,95 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(0,48 %)	1,98 %
Class Z GBP (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Okt. 2017)	(0,20 %)	(0,10 %)
3 Month USD LIBOR (GBP Hedged) Index	0,25 %	0,26 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class M Retail HKD (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 8. Sept. 2017)	0,19 %	(0,13 %)
Class E HKD (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Sept. 2017)	0,20 %	(0,10 %)
3 Month HIBOR Index	0,63 %	0,87 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Administrative SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(0,31 %)	2,31 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. Jun. 2017)	(0,50 %)	0,28 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(0,61 %)	1,82 %
3 Month SGD LIBOR Index	0,72 %	1,09 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

## 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein Engagement bei vorrangigen Hypothekendarlehen, insbesondere bei Non-Agency-RMBS, trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ausgewählte Positionen bei strukturierten MBS trugen zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse besser abschnitt als Schatztitel mit gleicher Duration.
- » Engagements bei vorrangigen Collateralized Loan Obligations und forderungsbesicherten Wertpapieren trugen zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse besser abschnitt als Schatztitel mit gleicher Duration.
- » Ein Long-Engagement bei US-Duration belastete die absolute Wertentwicklung, da die Zinsen anstiegen.
- » Auf Agency-MBS ausgerichtete Relative Value-Strategien belasteten die absolute Wertentwicklung, da die Anlageklasse schlechter abschnitt als Schatztitel mit gleicher Duration.

# PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(6,70 %)	6,59 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(7,16 %)	5,67 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(7,31 %)	5,25 %
MSCI Emerging Markets Index (Nettodividenden in USD)	(6,66 %)	5,60 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(4,07 %)	4,92 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(4,41 %)	4,03 %
Class T EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(4,71 %)	3,60 %
Class Z EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Juni 2017)	(3,74 %)	5,46 %
MSCI Emerging Markets Index (EUR Unhedged)	(4,00 %)	3,97 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(4,44 %)	12,95 %
Class R GBP (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(4,52 %)	12,82 %
MSCI Emerging Markets Index (GBP Unhedged)	(4,36 %)	11,94 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI Emerging Markets Index, liegende Gesamtrendite an (wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben ist). Konkret richtet der Fonds unter normalen Umständen ein Engagement bei einem Portfolio von Aktien von Schwellenmarktunternehmen (das „RAE Fundamental Emerging Markets Portfolio“) ein. Die Aktien werden vom Unterberater des Fonds, Research Affiliates, LLC, aus einem breiten Universum von Unternehmen ausgewählt, die bestimmte Liquiditäts- und Kapazitätsanforderungen erfüllen. Fondsstrategien können sich von Zeit zu Zeit ändern. Für nähere Einzelheiten zur Strategie des Fonds wird auf den aktuellen Verkaufsprospekt des Fonds verwiesen.

Kommentare zum Fonds

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

- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Energiesektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor stärker entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Materialsektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor stärker entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Immobiliensektor trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Informationstechnologiesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Finanzsektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement im Gesundheitssektor war der relativen Rendite abträglich, da der Sektor besser abschnitt als der Vergleichsindex.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(3,53 %)	2,12 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(3,98 %)	1,25 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(4,02 %)	0,86 %
MSCI Europe Index	(0,48 %)	2,61 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(3,84 %)	9,94 %
Class R GBP (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(4,00 %)	9,67 %
MSCI Europe Index (GBP Unhedged)	(0,85 %)	10,48 %
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Class T USD (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(6,76 %)	2,44 %
Class E USD (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(6,52 %)	2,88 %
Institutional USD (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(6,14 %)	3,73 %
MSCI Europe Index (USD Unhedged)	(3,23 %)	4,22 %

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE Fundamental Europe Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI Europe Index, liegende Gesamtrendite an (wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben ist). Konkret richtet der Fonds unter normalen Umständen ein Engagement bei einem Portfolio von Aktien europäischer Unternehmen (das „RAE Fundamental Europe Portfolio“) ein. Die Aktien werden vom Unterberater des Fonds, Research Affiliates, LLC, aus einem breiten Universum von Unternehmen ausgewählt, die bestimmte Liquiditäts- und Kapazitätsanforderungen erfüllen. Fondsstrategien können sich von Zeit zu Zeit ändern. Für nähere Einzelheiten zur Strategie des Fonds wird auf den aktuellen Verkaufsprospekt des Fonds verwiesen.

Kommentare zum Fonds

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

- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Versorgungssektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor stärker entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Materialsektor trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Industriesektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Finanzsektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Nicht-Basiskonsumgütersektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement im Informationstechnologiesektor war der relativen Rendite abträglich, da der Sektor besser abschnitt als der Vergleichsindex.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(2,38 %)	7,20 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(2,75 %)	6,32 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(2,94 %)	5,88 %
MSCI World Index	0,43 %	8,48 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	0,34 %	5,55 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(0,09 %)	4,65 %
Class T EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(0,18 %)	4,25 %
MSCI World Index (EUR Unhedged)	3,29 %	6,80 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	0,07 %	13,65 %
Class R GBP (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(0,14 %)	13,37 %
MSCI World Index (GBP Unhedged)	2,90 %	14,99 %

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI World Index, liegende Gesamtrendite an (wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben ist). Konkret richtet der Fonds unter normalen Umständen ein Engagement bei einem Portfolio von Aktien von Unternehmen aus Industrieländern weltweit (das „RAE Fundamental Global Developed Portfolio“) ein. Die Aktien werden vom Unterberater des Fonds, Research Affiliates, LLC, aus einem breiten Universum von Unternehmen ausgewählt, die bestimmte Liquiditäts- und Kapazitätsanforderungen erfüllen. Fondsstrategien können sich von Zeit zu Zeit ändern. Für nähere Einzelheiten zur Strategie des Fonds wird auf den aktuellen Verkaufsprospekt des Fonds verwiesen.

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl im Materialsektor trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Versorgungssektor trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Informationstechnologiesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Finanzsektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Industriesektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Nicht-Basiskonsumgütersektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013)	(7,72 %)	5,44 %
Class Z, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Apr. 2016)	(7,20 %)	18,53 %
MSCI Emerging Markets Index	(6,66 %)	5,24 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 03. Sept. 2013)	(5,09 %)	8,07 %
Class G Institutional EUR (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2015)	(5,04 %)	15,09 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Sept. 2013)	(5,70 %)	5,51 %
MSCI Emerging Markets Index (EUR Unhedged)	(4,00 %)	7,88 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI Emerging Markets Index, liegende Gesamtrendite an. Hierzu befolgt der Teilfonds die unternehmenseigene Portfoliomanagementstrategie der Anlageberatungsgesellschaften, die als „StocksPLUS“ bekannt ist (die ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) bestehendes Portfolio mit Engagements in ein nominelles, aus Aktienwerten bestehendes Portfolio verbindet, wodurch im Laufe der Zeit eine bessere Wertentwicklung als die eines Aktienindex, in diesem Fall des MSCI Emerging Markets Index, erreicht werden soll). Das nominelle, aus Aktienwerten bestehende Portfolio wird aufgrund der RAE Fundamental Emerging Markets Strategy (wie im Verkaufsprospekt näher erklärt) ausgewählt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Das Engagement des Teilfonds bei der RAE Fundamental EM-Strategie wirkte sich neutral auf die Rendite im Vergleich zum MSCI EM Index aus. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Materialsektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor stärker entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Energiesektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor stärker entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Finanzsektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Informationstechnologiesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Die Alpha-Anleihenstrategie des Portfolios war der Rendite zuträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
- » US-Durationsstrategien schmälerten die Wertentwicklung, da die Renditen auf US-Staatsanleihen stiegen.
- » Auf Zinsen der Eurozone ausgerichtete Strategien trugen zur Wertentwicklung bei, da dort die Renditen zurückgingen.
- » Positionen bei Non-Agency-MBS trugen zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen stieg.
- » Auf Schwellenmarktwährungen ausgerichtete Strategien belasteten die Rendite, was vor allem Long-Positionen beim US-Dollar gegenüber dem argentinischen Peso, dem russischen Rubel und der türkischen Lira zuzuschreiben war.

# PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013)	(1,37 %)	9,00 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(2,01 %)	7,72 %
MSCI World Index	0,43 %	9,44 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 03. Sept. 2013)	1,49 %	11,73 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Sept. 2013)	0,84 %	9,76 %
Class G Institutional EUR (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	1,49 %	10,42 %
MSCI World Index (EUR Unhedged)	3,29 %	12,18 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (abgesichert)</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Sept. 2014)	(1,41 %)	6,40 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Sept. 2014)	(2,04 %)	4,91 %
MSCI World Index (EUR Hedged)	0,25 %	7,42 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013)	1,08 %	12,74 %
MSCI World Index (GBP Unhedged)	2,90 %	13,19 %

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI World Index, liegende Gesamtrendite an. Hierzu befolgt der Teilfonds die unternehmenseigene Portfoliomanagerstrategie der Anlageberatungsgesellschaften, die als „StocksPLUS“ bekannt ist (die ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) bestehendes Portfolio mit Engagements in ein nominelles, aus Aktienwerten bestehendes Portfolio verbindet, wodurch im Laufe der Zeit eine bessere Wertentwicklung eines Aktienindex, in diesem Fall des MSCI World Index, erreicht werden soll). Das nominelle, aus Aktienwerten bestehende Portfolio wird aufgrund der RAE Fundamental Global Developed Strategy (wie im Verkaufsprospekt des Teilfonds näher erklärt) ausgewählt.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Das Engagement des Teilfonds bei der RAE Fundamental Global Developed-Strategie war der Rendite im Vergleich zum MSCI World Index abträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Versorgungssektor trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Informationstechnologiesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Finanzsektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Die Alpha-Anleihenstrategie des Portfolios war der Rendite zuträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
- » US-Durationsstrategien schmälerten die Wertentwicklung, da die Renditen auf US-Staatsanleihen stiegen.
- » Ein Engagement bei US TIPS Breakeven-Inflationserwartungen verstärkte die Rendite, da die Inflationserwartungen zunahmen.
- » Positionen bei Non-Agency-MBS trugen zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen stieg.
- » Auf Schwellenmarktwährungen ausgerichtete Strategien belasteten die Rendite, was vor allem einer Long-Position beim US-Dollar gegenüber dem argentinischen Peso, dem russischen Rubel und der türkischen Lira zuzuschreiben war.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013)	0,95 %	11,65 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	0,35 %	9,80 %
Class Z, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Apr. 2016)	1,39 %	15,89 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	2,36 %	12,67 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 03. Sept. 2013)	3,84 %	14,51 %
Class G Institutional EUR (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2015)	3,83 %	12,91 %
S&P 500 (EUR Unhedged) Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	5,27 %	15,50 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem S&P 500 Index, liegende Gesamtrendite an. Der Teilfonds befolgt die gesetzlich geschützte Portfolioverwaltungsstrategie der Anlageberatungsgesellschaften, die als „StocksPLUS“ bekannt ist (die ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) bestehendes Portfolio mit Engagements in ein nominelles, aus Aktienwerten bestehendes Portfolio verbindet, wodurch im Laufe der Zeit eine bessere Wertentwicklung eines Aktienindex, in diesem Fall des S&P 500, erreicht wird). Das nominelle, aus Aktienwerten bestehende Portfolio wird aufgrund der RAE Fundamental US Strategy (wie im Verkaufsprospekt des Teilfonds näher erklärt) ausgewählt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Das Engagement des Teilfonds bei der RAE Fundamental US Large-Strategie war der Rendite im Vergleich zum S&P 500 Index abträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
- » Die Titelauswahl im Gesundheitssektor trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Finanzsektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Informationstechnologiesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Die Alpha-Anleihenstrategie des Portfolios war der Rendite zuträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
- » US-Durationsstrategien schmälerten die Wertentwicklung, da die Renditen auf US-Staatsanleihen stiegen.
- » Auf Zinsen der Eurozone ausgerichtete Strategien trugen zur Wertentwicklung bei, da dort die Renditen zurückgingen.
- » Positionen bei Non-Agency-MBS trugen zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen stieg.
- » Auf Schwellenmarktwährungen ausgerichtete Strategien belasteten die Rendite, was vor allem einer Long-Position beim US-Dollar gegenüber dem argentinischen Peso, dem russischen Rubel und der türkischen Lira zuzuschreiben war.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	0,63 %	8,77 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	0,16 %	7,84 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	0,00 %	7,43 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	2,36 %	11,23 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	3,88 %	7,23 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	2,93 %	6,15 %
Class T EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	2,87 %	5,76 %
S&P 500 (EUR Unhedged) Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	5,27 %	9,51 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	3,09 %	15,30 %
Class R GBP (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	2,98 %	14,98 %
S&P 500 (GBP Unhedged) Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	4,88 %	17,91 %

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE Fundamental US Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem S&P 500 Index, liegende Gesamtrendite an (wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben ist). Konkret richtet der Fonds unter normalen Umständen ein Engagement bei einem Portfolio von Aktien US-amerikanischer Unternehmen (das „RAE Fundamental US Portfolio“) ein. Die Aktien werden vom Unterberater des Fonds, Research Affiliates, LLC, aus einem breiten Universum von Unternehmen ausgewählt, die bestimmte Liquiditäts- und Kapazitätsanforderungen erfüllen. Fondsstrategien können sich von Zeit zu Zeit ändern. Für nähere Einzelheiten zur Strategie des Fonds wird auf den aktuellen Verkaufsprospekt des Fonds verwiesen.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl im Gesundheitssektor trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Energiesektor trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Informationstechnologiesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Finanzsektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Industriesektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Nicht-Basiskonsumgütersektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

# Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. April 2010)	(4,57 %)	4,74 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter	(5,39 %)	5,48 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2013)	(5,99 %)	2,32 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Okt. 2017)	(5,85 %)	(5,42 %)
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter (EUR Hedged)	(6,71 %)	3,30 % <sup>2</sup>
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Investor NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. März 2014)	(5,43 %)	3,59 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter (NOK Hedged)	(6,04 %)	4,59 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Investor SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 6. Feb. 2014)	(6,15 %)	2,12 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter (SEK Hedged)	(6,83 %)	3,45 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den maximal möglichen Gesamtertrag erzielen, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in ein aktiv verwaltetes, diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind. Die Beteiligung an solchen Emittenten lässt sich über die direkte Anlage in Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder über den Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten (wie im Verkaufsprospekt näher definiert) erreichen. Alle Wertpapiere werden von den Anlageberatungsgesellschaften gemäß einem ethischen Auswahlverfahren ausgewählt, das die sozial verantwortliche Anlageberatungsgesellschaft (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Zeit zu Zeit vorgibt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung der US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen auf US-Schatzpapiere stiegen.
- » Eine Untergewichtung libanesischer Staatsanleihen, die im ersten Halbjahr 2018 eine negative Gesamtrendite verbuchten, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.
- » Eine Untergewichtung philippinischer Staatsanleihen, die im ersten Halbjahr 2018 eine negative Gesamtrendite verbuchten, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.
- » Eine Übergewichtung argentinischer Staatsanleihen, die im ersten Halbjahr 2018 eine negative Gesamtrendite verbuchten, schmälerte die relative Wertentwicklung.
- » Engagements beim russischen Rubel und der türkischen Lira, die im ersten Halbjahr 2018 jeweils eine negative Gesamtrendite verbuchten, belasteten die relative Wertentwicklung.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Dez. 1998)	2,08 %	6,20 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Nov. 2001)	2,08 %	7,61 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 07. Jan. 1999)	1,92 %	5,68 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2006)	1,61 %	7,95 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Jan. 2017)	1,42 %	13,86 %
Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2008)	2,39 %	16,92 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	2,36 %	5,54 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Sept. 2012)	0,69 %	13,28 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005)	0,67 %	7,67 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 02. Aug. 2017)	0,28 %	7,90 %
S&P 500 (EUR Hedged) Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	0,86 %	6,59 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Das Engagement des Teilfonds bei mit dem S&P 500 verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 Index eine Rendite von 2,65 % verbuchte.
- » Die Alpha-Anleihenstrategie des Portfolios war der Rendite abträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
  - » US-Durationsstrategien schmälerten die Wertentwicklung, da die Renditen auf US-Staatsanleihen stiegen.
  - » Das Engagement in Deutschland trug zur Wertentwicklung bei, da dort die Renditen zurückgingen.
  - » Positionen bei Agency-MBS schmälerten die Rendite, da der Wert dieser Anleihen sank.
  - » Ein Engagement bei der türkischen Lira schmälerte die Rendite, da sich die Währung abschwächte.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. März 2018)	—	(0,90 %)
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2013)	(1,53 %)	4,50 %
Class E, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	(1,42 %)	4,50 %
75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index <sup>3</sup>	0,22 %	4,55 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2013)	(2,07 %)	4,71 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2013)	(2,48 %)	3,73 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	(2,48 %)	3,74 %
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2015)	(2,06 %)	4,42 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(2,72 %)	1,90 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(2,76 %)	1,92 %
75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate EUR Hedged/25 % MSCI World Index EUR Hedged <sup>4</sup>	(0,81 %)	3,82 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Strategic Income Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 26. Juli 2016: 75 % Barclays Global Aggregate Index Hedged USD / 25 % MSCI All Country World Index. Seit dem 27. Juli 2016: 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index.

<sup>4</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Strategic Income Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 26. Juli 2016: 75 % Barclays Global Aggregate Index Hedged EUR / 25 % MSCI All Country World Index Net EUR. Seit dem 27. Juli 2016: 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate EUR Hedged/25 % MSCI World Index EUR Hedged

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 Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Positionen bei Non-Agency-MBS trugen zur Wertentwicklung bei, da die Gesamtrenditen dieser Wertpapiere positiv ausfielen.
- » Tendenzielle Long-Positionen beim US-Dollar gegenüber dem japanischen Yen trugen zur Wertentwicklung bei, da der US-Dollar aufgewertet wurde.
- » Ein Engagement bei US-Zinsen war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze anstiegen.
- » Ein Long-Engagement im argentinischen Peso schmälerte die Wertentwicklung, da der argentinische Peso an Wert verlor.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Versorgungssektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor stärker entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Informationstechnologiesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Nicht-Basiskonsumgütersektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.

# Total Return Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Jan. 1998)	(1,94 %)	5,31 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. April 2000)	(1,96 %)	5,39 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Jan. 1999)	(2,12 %)	4,75 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Okt. 2000)	(2,09 %)	4,78 %
Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Mai 2003)	(2,20 %)	3,84 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(2,39 %)	3,85 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 10. Okt. 2005)	(2,38 %)	3,68 %
Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Okt. 2002)	(2,02 %)	4,54 %
Class H Institutional, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Mai 2018)	—	0,10 %
Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(2,00 %)	1,32 %
Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(2,14 %)	1,31 %
Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(2,56 %)	0,75 %
Bloomberg Barclays US Aggregate Index	(1,62 %)	4,73 % <sup>2</sup>
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 2. Mai 2013)	(2,29 %)	1,56 %
Bloomberg Barclays US Aggregate Index (CAD Hedged)	(1,98 %)	1,68 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Juni 2011)	(3,38 %)	1,20 %
Investor CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Juni 2011)	(3,55 %)	0,85 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Sept. 2012)	(3,79 %)	(0,63 %)
Bloomberg Barclays US Aggregate (CHF Hedged) Index	(3,10 %)	1,09 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2003)	(3,25 %)	3,91 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(3,23 %)	4,01 %
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2004)	(3,41 %)	3,47 %
Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Okt. 2009)	(3,43 %)	2,21 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(3,67 %)	3,25 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. März 2012)	(3,67 %)	0,48 %
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(3,30 %)	0,84 %
Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(3,32 %)	0,32 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014)	(3,82 %)	(0,46 %)
Bloomberg Barclays US Aggregate (EUR Hedged) Index	(2,88 %)	3,26 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Juni 2002)	0,82 %	3,32 %
Bloomberg Barclays US Aggregate Index (EUR Unhedged) Index	1,18 %	2,81 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 26. März 2010)	(2,74 %)	2,99 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(2,82 %)	4,74 %
Investor GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Juni 2011)	(2,87 %)	2,01 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(2,87 %)	1,01 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (GBP Hedged) Index	(2,39 %)	4,08 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class E HKD (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Feb. 2013)	(2,04 %)	1,04 %
Class M Retail HKD (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 20. Feb. 2013)	(1,99 %)	0,98 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (HKD Unhedged) Index	(1,26 %)	2,00 %

Der Total Return Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine Untergewichtung von Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Kreditspreads erweiterten.
- » Eine Untergewichtung von langfristigen US-Zinsen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die langfristigen Zinsen anstiegen.
- » Ein Short-Engagement bei britischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die britischen Zinsen stiegen.
- » Ein Long-Engagement beim argentinischen Peso gegenüber dem US-Dollar belastete die Wertentwicklung, da der argentinische Peso gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurde.
- » Ein Short-Engagement beim japanischen Yen gegenüber dem US-Dollar schmälerte die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.
- » Ein Long-Engagement bei der schwedischen Krone gegenüber dem US-Dollar belastete die Wertentwicklung, da die schwedische Krone gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurde.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>  
(Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf ILS lautende Klassen</b>		
Institutional ILS (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Mai 2010)	(2,81 %)	3,06 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (ILS Hedged) Index	(2,63 %)	3,18 %
<b>Auf JPY lautende Klassen</b>		
Institutional JPY (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Juli 2014)	(3,03 %)	0,63 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (JPY Hedged) Index	(2,71 %)	0,46 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Jan. 2011)	(2,30 %)	2,81 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2007)	(2,78 %)	3,38 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 1. Aug. 2012)	(2,78 %)	0,99 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (SGD Hedged) Index	(1,95 %)	3,62 % <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 Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

# PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(2,10 %)	0,86 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (am 30. Juni 2015 aufgelegt)	(2,07 %)	0,88 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(2,34 %)	0,52 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(2,21 %)	0,53 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(2,65 %)	(0,23 %)
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(2,65 %)	(0,24 %)
Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(2,10 %)	0,83 %
Class Z, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Apr. 2016)	(1,51 %)	1,88 %
3 Month USD LIBOR Index	1,00 %	1,01 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(3,61 %)	(1,32 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(4,12 %)	(2,39 %)
3 Month USD LIBOR (in CHF besichert)	(0,47 %)	(1,17 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(3,46 %)	(0,77 %)
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(3,38 %)	(0,76 %)
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(3,59 %)	(1,11 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(3,96 %)	(1,87 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(3,97 %)	(1,88 %)
Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(3,47 %)	(0,84 %)
3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) Index	(0,26 %)	(0,21 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(2,97 %)	0,34 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(3,55 %)	(0,75 %)
Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015)	(3,10 %)	0,27 %
3 Month USD LIBOR (GBP Hedged) Index	0,25 %	0,30 %

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

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

## 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 Teilfonds dargestellt), Schuldtitel, Aktienindizes, volatilitätsbezogene Instrumente (einschließlich u.a. Futures auf volatilitätsbezogene Indizes) und rohstoffbezogene Instrumente (wie im Verkaufsprospekt des Teilfonds dargestellt) investiert.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Long-Positionen bei europäischen und britischen Aktienindizes belasteten die Wertentwicklung aufgrund scharfer Kurskorrekturen.
- » Short-Positionen bei der impliziten Volatilität US-amerikanischer und europäischer Aktien belasteten die Wertentwicklung, da sich die implizite Volatilität im Februar umkehrte und deutlich anstieg.
- » Der Fonds hielt während eines Großteils des Berichtszeitraums Long-Positionen in australischer, brasilianischer, britischer und ungarischer Duration, was die Wertentwicklung aufgrund von Trendwenden in diesen Regionen im ersten Halbjahr 2018 belastete.
- » Short-Positionen im Euro, im ungarischen Forint und in der schwedischen Krone trugen zur Wertentwicklung bei.
- » Short-Positionen bei polnischen und türkischen Aktienindizes trugen zur Wertentwicklung bei.
- » Das Sicherheitenportfolio trug zur Rendite bei, was vor allem Zugewinnen bei kurzfristigen Unternehmensanleihen zu verdanken war.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Auf GBP lautende Klassen	6 Monate	Auflegung von Klassen
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Sept. 2007)	(1,69 %)	6,56 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 8. Jul. 2016)	(1,63 %)	2,84 %
Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Juni 2016)	(1,90 %)	4,04 %
Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 08. Juni 2016)	(1,90 %)	4,04 %
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	(1,26 %)	6,03 % <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 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 Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine Untergewichtung des längerfristigen Abschnitts der GBP-Kurve trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen während des Berichtszeitraums stiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Immobiliensektor, der besser abschnitt als der Markt insgesamt, war der Wertentwicklung zuträglich.
- » Ein Engagement bei einem ausgewählten Lebensmitteleinzelhändler trug dank des realisierten Carrys zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Ein Long-Engagement bei zusätzlichen Tier-1-Anleihen, die schlechter abschnitten als der Gesamtmarkt, schmälerte die Wertentwicklung.
- » Eine Untergewichtung des Sektors für Wertpapiere regierungsnaher Einrichtungen, der besser abschnitt als der Markt insgesamt, war der relativen Wertentwicklung abträglich.
- » Ein Short-Engagement beim USD gegenüber einem Long-Engagement beim GBP belastete die Wertentwicklung, da der USD aufgewertet wurde.

# UK Long Term Corporate Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Auf GBP lautende Klassen	6 Monate	Auflegung von Klassen
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2005)	(2,13 %)	6,61 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Aug. 2008)	(2,10 %)	8,95 %
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index <sup>2</sup>	(2,02 %)	5,97 % <sup>3</sup>

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

<sup>2</sup> Die Benchmark-Performance für den UK Long Term Corporate Bond Fund repräsentiert Folgendes: 31. Dezember 2005 bis 31. März 2013 — (Markt iBoxx Sterling Non-Gilts 10+ Index); ab 31. März 2013 — (BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index).

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

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 Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein untergewichtetes Engagement beim längerfristigen Abschnitt der GBP-Kurve trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen während des Berichtszeitraums stiegen.
- » Ein Übergewichtetes Engagement im Immobiliensektor, der besser abschnitt als der Markt insgesamt, war der Wertentwicklung zuträglich.
- » Ein Engagement bei einem ausgewählten Lebensmitteleinzelhändler trug dank des realisierten Carrys zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Ein untergewichtetes Engagement beim Sektor für Wertpapiere regierungsnaher Einrichtungen, der besser abschnitt als der Markt insgesamt, war der relativen Wertentwicklung abträglich.
- » Ein Long-Engagement bei zusätzlichen Tier-1-Anleihen, die schlechter abschnitten als der Gesamtmarkt, schmälerte die Wertentwicklung.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Dez. 2008)	0,69 %	2,94 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Feb. 2010)	0,68 %	2,47 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Sept. 2010)	0,53 %	1,62 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 24. Sept. 2010)	0,48 %	1,60 %
Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Jan. 2010)	0,40 %	1,93 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Mai 2010)	0,27 %	1,35 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Mai 2010)	0,23 %	1,35 %
Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,56 %	1,39 %
Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,68 %	1,39 %
1 Month USD LIBOR Index	0,88 %	0,43 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. März 2014)	0,99 %	4,51 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	0,92 %	2,15 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Sept. 2010)	(0,83 %)	0,87 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. April 2011)	(1,29 %)	(0,07 %)
1 Month CHF LIBOR Index	(0,40 %)	(0,33 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Mai 2009)	(0,63 %)	2,55 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Dez. 2009)	(0,66 %)	1,99 %
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Jan. 2011)	(0,82 %)	1,12 %
Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Jan. 2010)	(0,90 %)	1,37 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Nov. 2009)	(1,10 %)	1,06 %
Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(0,63 %)	1,01 %
Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Dez. 2010)	(1,04 %)	0,65 %
1 Month Euribor Index	(0,19 %)	0,20 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Dez. 2009)	(0,16 %)	2,40 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 27. Feb. 2012)	(0,13 %)	2,02 %
Class E GBP (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. März 2010)	(0,62 %)	1,32 %
1 Month GBP-LIBOR-Index	0,25 %	0,50 % <sup>2</sup>
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. April 2011)	0,00 %	2,75 %
1 Month NIBOR Rate Index	0,44 %	1,48 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. März 2018)	—	(0,25 %)
Administrative SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2011)	(0,92 %)	1,44 %
1 Month SEK LIBOR Index	(0,27 %)	0,35 % <sup>2</sup>

Der Unconstrained 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. Zu diesen Anlagen gehören vor allem von Unternehmen emittierte Anleihen, Anleihen von internationalen oder übernationalen Behörden und Regierungen, ihrer Organe, Behörden oder Institutionen. Der Teilfonds kann in andere Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) wie forderungsbesicherte Wertpapiere und ereignisabhängige Anleihen anlegen, die von Regierungen und Gesellschaften emittiert werden, sofern dies nach Meinung der Anlageberatungsgesellschaften mit den Zielsetzungen des Teilfonds übereinstimmt (und gemäß den Anforderungen der irischen Zentralbank). Engagements in derartigen Instrumenten können über Direktanlagen in die vorstehend aufgeführten Wertpapierarten oder über den Einsatz von Finanzderivaten erfolgen.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Ein während eines Großteils des Berichtszeitraums gehaltenes Short-Engagement bei italienischen Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen während des Berichtszeitraums stiegen.
- » Ein Engagement bei US-Breakeven-Inflation trug zur Wertentwicklung bei, da die US-Breakeven-Inflationsraten stiegen.
- » Short-Engagements bei britischen Zinsen trugen zur Wertentwicklung bei, da die Renditen während des Berichtszeitraums sanken.
- » Long-Positionen bei US-Nominalzinsen, vor allem am 3- bis 7-jährigen Abschnitt der Kurve, belasteten die Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.
- » Eine Long-Positionierung im argentinischen Peso beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem Euro an Wert verlor.
- » Positionen bei ausländischen Staatsschulden von Schwellenländern belasteten die Wertentwicklung. Der JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI), der die Gesamttrendite von Auslandsschulden von Schwellenländern allgemein abbildet, gab nach.

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

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

# US High Yield Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Mai 1998)	(0,15 %)	6,14 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Jan. 2001)	(0,13 %)	6,65 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. März 1999)	(0,30 %)	5,81 %
Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Jan. 1999)	(0,28 %)	5,78 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(0,57 %)	5,17 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2006)	(0,59 %)	5,30 %
Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Okt. 2002)	(0,25 %)	7,74 %
Class M Retail, ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Jan. 2012)	(0,68 %)	5,49 %
Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,23 %)	5,16 %
Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,33 %)	5,16 %
Class Z, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Juni 2016)	0,17 %	7,88 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index <sup>2</sup>	0,08 %	6,27 % <sup>3</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. April 2003)	(1,39 %)	6,23 %
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(1,36 %)	5,46 %
Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 12. Feb. 2003)	(1,59 %)	6,24 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006)	(1,86 %)	4,47 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (EUR Hedged) <sup>2</sup>	(1,24 %)	6,95 % <sup>3</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2003)	(0,91 %)	6,79 %
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Juni 2016)	(0,91 %)	5,83 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,08 %)	4,76 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (GBP Hedged) <sup>2</sup>	(0,75 %)	7,26 % <sup>3</sup>

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den US High Yield Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 31. März 2015 — (BofA Merrill Lynch US High Yield, BB-B Rated, Constrained Index); seit dem 1. April 2015 — (BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index).

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilklasse berechnet.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US High Yield Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl im Gesundheitssektor trug zur Wertentwicklung bei, da die Beteiligungen des Fonds im Gesundheitssektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Gesundheitssektor verstärkte die Wertentwicklung, da der Sektor den Gesamtmarkt übertraf.
- » Die Titelauswahl im Einzelhandelssektor kam der Wertentwicklung zugute, da die Beteiligungen des Fonds im Einzelhandelssektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl bei nicht zyklischen Konsumgütern belastete die Wertentwicklung, da die Beteiligungen des Fonds im Sektor für nicht zyklische Konsumgüter schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Telekommunikationssektor war der Wertentwicklung abträglich, da die Beteiligungen des Fonds im Telekommunikationssektor schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Telekommunikationssektor wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung aus, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Sept. 2016)	(3,29 %)	1,61 %
Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Sept. 2016)	(3,27 %)	1,63 %
Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Sept. 2016)	(3,70 %)	0,72 %
Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Aug. 2017)	(3,35 %)	(1,90 %)
Class H Institutional, ausschüttende Anteile (Auflegung: 9. Aug. 2017)	(3,36 %)	(1,91 %)
Bloomberg Barclays US Credit Index	(2,99 %)	0,51 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Okt. 2016)	(4,77 %)	(1,23 %)
Bloomberg Barclays US Credit Index (CHF Hedged)	(4,48 %)	(2,34 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Sept. 2016)	(4,53 %)	(0,56 %)
Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Sept. 2016)	(4,50 %)	(0,50 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Sept. 2016)	(5,03 %)	(2,19 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Sept. 2016)	(5,03 %)	(1,39 %)
Bloomberg Barclays US Credit Index (EUR Hedged)	(4,26 %)	(1,69 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 15. Sept. 2016)	(4,05 %)	0,39 %
Bloomberg Barclays US Credit Index (GBP Hedged)	(3,78 %)	(0,72 %)

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine auf eine Abflachung der Zinsstrukturkurve ausgerichtete Position wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich die Kurve abflachte.
- » Eine Übergewichtung des argentinischen Pesos war für die Wertentwicklung ungünstig, da der USD gegenüber dem Peso aufgewertet wurde.
- » Eine taktische Allokation auf externe Schwellenmärkte wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung aus, da der Sektor negative Renditen verbuchte.
- » Eine Untergewichtung des Pharmasektors wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da der Sektor schwächer abschnitt als der Bloomberg Barclays US Credit Index.
- » Eine Untergewichtung des Lebensmittel- und Getränkesektors wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da der Sektor schwächer abschnitt als der Bloomberg Barclays US Credit Index.
- » Eine Übergewichtung des Maklersektors wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da der Sektor besser abschnitt als der Bloomberg Barclays US Credit Index.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	6 Monate	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2014)	1,13 %	1,85 %
Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2014)	0,95 %	1,49 %
Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2014)	0,95 %	1,47 %
Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 07. Aug. 2014)	1,34 %	2,32 %
FTSE 3-Month Treasury Bill Index	0,79 %	0,48 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(0,20 %)	0,82 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Juni 2016)	(0,30 %)	0,10 %
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged)	(0,49 %)	(1,04 %) <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 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 Teilfonds 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 Teilfonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaften. Es wird nicht davon ausgegangen, dass sie länger als ein Jahr ist. Der Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Beteiligungen an Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Titelauswahl positiv auf die Wertentwicklung auswirkte.
- » Ein Long-Engagement bei kanadischer Duration trug aufgrund des positiven Carrys zur Wertentwicklung bei.
- » Tendenzielle Long-Positionen beim US-Dollar gegenüber dem Euro trugen zur Wertentwicklung bei, da der Euro gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurde.
- » Ein Short-Engagement beim kanadischen Dollar in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums trug zur Wertentwicklung bei, da der kanadische Dollar gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurde.
- » Ein Long-Engagement beim britischen Pfund belastete die Wertentwicklung, da das britische Pfund gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

## Beschreibungen der Vergleichsindizes

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
<b>1 Month CHF LIBOR Index</b>	Der 1 Month CHF LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen.
<b>1 Month Euribor Rate Index</b>	Der Euribor (Euro Interbank Offered Rate) ist der Vergleichszinssatz des ausgedehnten Euro-Geldmarkts. Dieser Index wird von der European Banking Federation, die 2.800 Banken in den fünfzehn Mitgliedsstaaten der Europäischen Union repräsentiert, und von der EWU-Abteilung der ACI, einer global agierenden Finanzmarktvereinigung, betrieben. Eine repräsentative Auswahl der wichtigsten Banken liefert tägliche Kurse für dreizehn Fälligkeiten von einer Woche bis zu einem Jahr, zu denen auf Euro lautende Interbank-Festgelder in der Eurozone zwischen den wichtigsten Banken gehandelt werden. Der durchschnittliche Zinssatz errechnet sich nach Löschen der höchsten/niedrigsten Kurse (15 % auf beiden Seiten). Der Euribor wird zu Kassavalutierung (T+2) und zu tatsächlichen/360-Tagessatzbedingungen angeboten und seit dem 4. Januar 1999 auf drei Kommastellen genau angegeben. Er wird 11:00 Uhr vormittags Brüsseler Zeit verbreitet.
<b>1 Month GBP-LIBOR-Index</b>	Der 1 Month GBP LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen.
<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 der norwegischen Krone und dem US-Dollar am Devisenterminmarkt ab.
<b>1 Month SEK LIBOR Index</b>	Der 1 Month SEK LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen.
<b>1 Month USD LIBOR Index</b>	Der 1 Month USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen.
<b>jeweils 1/3 Bloomberg Barclays 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 Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged) bietet ein weites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Rentenmärkte von Industrieländern. Der ICE BofAML 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 Verbindlichkeiten 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 BofAML-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 anlegen.
<b>3 Month Euribor</b>	Der 3-Monats-Euribor (Euro Interbank Offered Rate) ist ein täglicher Referenzzinssatz auf der Basis der Zinssätze, zu denen sich Banken untereinander im Großhandel (auf dem sog. „Interbankenmarkt“) unbesicherte Darlehen anbieten.
<b>3 Month GBP-LIBOR-Index</b>	3 Month GBP LIBOR Index. Der LIBOR (London Interbank Offered Rate) ist ein durchschnittlicher Zinssatz, den die ICE Benchmark Administration bestimmt und den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen.
<b>3 Month HIBOR Index</b>	HIBOR (Hong Kong Interbank Offered Rate) 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 für einen festgelegten Zeitraum auf Hongkong-Dollar lautende Instrumente zu leihen.
<b>3 Month SGD LIBOR Index</b>	3 Month SGD LIBOR Index. Der LIBOR (London Interbank Offered Rate) ist ein durchschnittlicher Zinssatz, den die ICE Benchmark Administration bestimmt und den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen.
<b>3 Month STIBOR Index</b>	STIBOR (Stockholm Interbank Offered Rate) ist ein Referenzzinssatz, der den durchschnittlichen Zinssatz abbildet, zu dem eine Reihe von Banken, die am schwedischen Geldmarkt aktiv sind, bereit sind, sich untereinander unbesichert zu verschiedenen Laufzeiten Geld zu leihen.
<b>3 Month USD LIBOR (in CHF besichert)</b>	Der 3 Month USD LIBOR (Hedged to CHF) LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen.
<b>3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) Index</b>	Der 3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen.

## Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
<b>3 Month USD LIBOR (GBP Hedged) Index</b>	Der 3 Month USD LIBOR (GBP Hedged) (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen.
<b>3 Month USD LIBOR Index</b>	Der 3 Month USD-LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht anlegen.
<b>45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1-30 Year Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government ILB 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 und 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index</b>	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1-30 Year Index (USD hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government ILB 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 und 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index. Der Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1-30 Year Index misst die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen aus Industrieländern. Er ist nach Marktkapitalisierung gewichtet und umfasst Laufzeiten bis zu 30 Jahren. Der Bloomberg Barclays Emerging Market Government ILB Index misst die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen aus Schwellenländern und ist nach Marktkapitalisierung gewichtet. Der Bloomberg Commodity Total Return Index ist ein nicht verwalteter Index aus Terminkontrakten auf eine Reihe von physischen Rohstoffen. 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 Alerian MLP Total Return Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index und der führende Maßstab für Master Limited Partnership (MLPs) aus dem Energiesektor mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung. Der Bloomberg Gold Subindex Total Return Index spiegelt die Rendite vollständig besicherter Positionen in den zugrundeliegenden Rohstoffterminkontrakten wider.
<b>60 % MSCI All Country World Index / 40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged</b>	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged. Der MSCI All Country World Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrie- und Schwellenländern zu messen. Der Index besteht aus 46 Länderindizes, von denen 23 Indizes von Industrieländern und 23 Indizes von Schwellenländern sind. Der Bloomberg 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.
<b>75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index</b>	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index. Der Bloomberg 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 die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrieländern. Der MSCI World Index besteht aus 23 Industrieländerindizes.
<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 anlegen.
<b>Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index</b>	Der Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index repräsentiert die Euro Aggregate 1-10-Jahreskomponente des Bloomberg Barclays Pan-European Aggregate Index. Der Bloomberg Barclays 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.
<b>Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index</b>	Der Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index ist die Anleihekomponekte des Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Index. Der Bloomberg Barclays 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.

<b>Offizieller Name des Vergleichsindex</b>	<b>Beschreibung des Index</b>
<b>Bloomberg Barclays Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index</b>	Bloomberg Barclays Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index ist die 1 - 3-jährige Komponente des Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Index ex Treasuries. Der Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 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.
<b>Bloomberg Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index</b>	Der Bloomberg Barclays 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 Barclays 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 Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index</b>	Der Bloomberg 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.
<b>Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index</b>	Der Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) 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.
<b>Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)</b>	Bei dem Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index 1-5 Years Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten 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 Staatstitel und verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade.
<b>Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)</b>	Bei dem Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit-Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten 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 verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade.
<b>Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Unhedged)</b>	Bei dem Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit-Index (USD Unhedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten 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 verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade.
<b>Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index</b>	Der Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die beiden Hauptkomponenten dieses Index sind der Pan-European Aggregate und der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen sowie kanadische Staats-, Agency- und Unternehmenspapiere.
<b>Bloomberg Barclays US Aggregate Index</b>	Der Bloomberg Barclays US 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.
<b>Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index</b>	Der Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind, auf Dollar lauten und eine Laufzeit zwischen ein und drei Jahren aufweisen. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere.
<b>Bloomberg Barclays US Credit Index</b>	Bei dem Bloomberg Barclays US 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 Barclays Credit Investment Grade Index bezeichnet.

## Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
<b>Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index</b>	Bei dem Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged-Index handelt es sich um einen Index, der die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen misst. Der Index umfasst von den folgenden Ländern emittierte, inflationsgekoppelte Schuldtitel: Australien, Kanada, Frankreich, Schweden, Großbritannien und die USA.
<b>Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)</b>	Bei dem Bloomberg Barclays 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.
<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.
<b>FTSE 3-Month Treasury Bill Index</b>	Bei dem FTSE 3-Month 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.
<b>FTSE Euro Broad Investment-Grade Index</b>	Bei dem FTSE Euro Broad Investment Grade Index handelt es sich um einen Index von auf Euro basierenden Rentenmärkten der Kategorie Investment Grade, die institutionellen Anlegern (in Euro) zugänglich sind.
<b>Gleichgewichtete Mischung von drei Indizes mit einer konstanten Duration von 0,25 Jahren, wie von PIMCO berechnet: Bloomberg Barclays 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 Index stellt eine gleichgewichtete Mischung aus den folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 0,25 Jahren dar: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, JPMorgan EMBI Global; All USD Hedged. Der Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index bietet ein breites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Festzinsmärkte unter Ausschluss der Schwellenmärkte. Der ICE BofAML 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, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Verbindlichkeiten 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 BofAML-Indizes als Merrill-Lynch-Indizes bekannt. Der JPMorgan EMBI Global bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. Dieser Index bildet lediglich eine bestimmte Region oder ein bestimmtes Land ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>ICE BofAML 3 Month USD Libor Index Hedged BRL Denominated in USD</b>	Der ICE BofAML 3 Month USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index Hedged BRL Denominated in USD ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den Banken einander für kurzfristige Gelder (3 Monate) auf dem englischen Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index</b>	Bei dem ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index handelt es sich um einen nicht gemanagten 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.
<b>ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged)</b>	Der ICE BofA Merrill Lynch US 3-Month 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.
<b>ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD</b>	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, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Verbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index enthält auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautende 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.
<b>ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index</b>	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.
<b>ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index</b>	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 von Großbritannien ab.

<b>Offizieller Name des Vergleichsindex</b>	<b>Beschreibung des Index</b>
<b>ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index</b>	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.
<b>JPMorgan EMBI Global (EUR Unhedged)</b>	Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Unhedged) bildet die Gesamterträge von auf US-Dollar lautenden Schuldsinstrumenten von staatlichen und staatsnahen Emittenten aus Schwellenländern ab: Brady Bonds, Darlehen, Eurobonds und Lokalmarktinstrumente. Vor dem 1. Dezember 2009 wurden die Indexrenditen von PIMCO abgesichert.
<b>JPMorgan Asia Credit Index</b>	Der JPMorgan Asia Credit Index (JACI) misst die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan. Der Index bietet einen Vergleichsindex für Anlagemöglichkeiten in fest und variabel verzinsten auf US-Dollar lautenden Anleihen von asiatischen Staaten, quasi-staatlichen Stellen, Banken und Unternehmen zuzüglich 10 % 1 Month USD-LIBOR.
<b>JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)</b>	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.
<b>JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)</b>	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.
<b>JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global</b>	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: darunter verbrieftete Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen.
<b>JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter</b>	Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter, bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldsinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden: darunter verbrieftete Forderungen, Darlehen, Euroanleihen und lokale Marktinstrumente; ausgeschlossen sind Emittenten, die der SRI-Berater nicht zulässt.
<b>JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)</b>	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.
<b>MSCI Emerging Markets Index</b>	Der MSCI Emerging Markets Index ist ein um Streubesitz bereinigter Marktkapitalisierungsindex, der dazu gedacht ist, die Aktienmarktwertentwicklung von Schwellenmärkten zu messen. In einen Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>MSCI Europe Index</b>	Der MSCI Europe Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte der europäischen Industrieländer zu messen. Seit Juni 2007 besteht der MSCI Europe Index aus 16 Industrieländerindizes. Der Index bildet die nicht abgesicherte Wertentwicklung der in ihm enthaltenen Aktien in Euro ab.
<b>MSCI World Index</b>	Der MSCI World Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrieländern zu messen. Der MSCI World Index besteht aus 23 Industrieländerindizes.
<b>OECD CPI + 3 % (3 Month Lag)</b>	Die OECD CPI +3 % (3 Month Lag) Benchmark entsteht, indem der jährlichen prozentualen Änderung des Consumer Price Index („CPI“) für 34 OECD-Mitgliedsländer 3 % hinzugerechnet werden. Der OECD Consumer Price Index ist ein unverwalteter Index, der eine Gesamtinflationsrate von Verbraucherpreisen von 34 Ländern verkörpert, wie von der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung festgelegt. Es ist keine Garantie dafür vorhanden, dass der OECD CPI oder andere Indizes die genaue Inflationsrate wiedergeben.
<b>PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)</b>	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. PIMCOs GLADI-Methode 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.
<b>PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged)</b>	PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged). Der PIMCO GLADI ILB repräsentiert den internationalen Rentenmarkt für inflationsgekoppelte Staatsanleihen, sowohl für Industrie- als auch Schwellenländer. Der Index berücksichtigt die Prinzipien der PIMCO Global Advantage Indizes, sofern diese auf den internationalen Markt für inflationsgekoppelte Anleihen anwendbar sind.
<b>S&amp;P 500 Index</b>	Der S&P 500 Index 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.

## Finanzstatus

(Angaben in Tausend)	PIMCO Capital Securities Fund		Commodity Real Return Fund	
	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 8.529.735	\$ 9.045.200	\$ 799.419	\$ 602.855
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	105.747	61.334	5.324	26.050
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	11.785	0	0	563
Einlagen bei Kontrahenten	84.397	62.242	11.283	4.283
Forderungen aus Einkünften	74.430	82.942	2.381	1.692
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	13.531	62	55
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	107.488	126.845
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	6.154	16.227	2.241	1.575
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	7.441	7.775	2.613	1.187
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>8.819.689</b>	<b>9.289.251</b>	<b>930.811</b>	<b>765.105</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(111.948)	(65.712)	(8.940)	(3.931)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	(6.388)	(12.086)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(4.571)	(625)	0	(3.245)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	(185.648)	(157.512)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(6.696)	(17.609)	(459)	(444)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(6.392)	(7.076)	(468)	(402)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(909.869)	(433.284)	(78.816)	(48.183)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(333)	(482)	(5)	(5)
Überziehungskredit	0	(15.550)	(10.787)	0
Verbindlichkeiten aus Dividenden	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(36.929)	(17.660)	(777)	(20.764)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(1.076.738)</b>	<b>(557.998)</b>	<b>(292.288)</b>	<b>(246.572)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 7.742.951</b>	<b>\$ 8.731.253</b>	<b>\$ 638.523</b>	<b>\$ 518.533</b>

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

PIMCO Credit Absolute Return Fund		Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund		Dynamic Multi-Asset Fund	
Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
\$ 207.188	\$ 308.008	\$ 7.196.081	\$ 7.770.355	\$ 1.334.841	\$ 1.225.288	€ 1.152.594	€ 987.628
0	0	23.024	0	4.104	0	0	0
3.562	6.415	75.273	74.768	15.882	13.550	9.376	6.478
223	778	11.594	7.243	1.046	4.138	4.440	6.076
3.653	5.729	249.760	128.319	56.175	29.859	48.537	33.988
2.416	3.176	78.764	87.680	14.210	14.336	4.251	5.422
5.417	67	11.904	15.678	1.968	1.625	347	1.673
0	0	284.349	0	51.235	0	0	0
24	89	4.616	19.881	667	3.849	480	5.442
0	1.608	17.666	13.707	2.570	0	3.959	0
0	0	0	0	0	0	0	0
222.483	325.870	7.953.031	8.117.631	1.482.698	1.292.645	1.223.984	1.046.707
(3.501)	(3.662)	(108.546)	(50.470)	(23.399)	(6.453)	(11.719)	(7.224)
0	0	0	0	0	0	0	0
(2.184)	(256)	(71.043)	(79.097)	(11.724)	(20.805)	(32.851)	(2.129)
0	0	(662.169)	0	(119.150)	0	0	0
(55)	(340)	(75.875)	(29.376)	(624)	(70)	(298)	(101)
(178)	(284)	(6.139)	(7.038)	(1.040)	(910)	(1.209)	(1.038)
(32.840)	(30.109)	(15.241)	(8.655)	(2.056)	(1.082)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	0	(377)	(467)	(236)	(238)	(5)	(2)
0	0	0	0	0	0	0	0
(445)	0	0	0	0	(1.513)	0	(841)
(297)	(2.552)	(14.633)	(23.626)	(1.231)	(2.602)	(12.736)	(1.591)
0	0	0	0	0	0	0	0
(39.501)	(37.203)	(954.023)	(198.729)	(159.460)	(33.673)	(58.818)	(12.926)
\$ 182.982	\$ 288.667	\$ 6.999.008	\$ 7.918.902	\$ 1.323.238	\$ 1.258.972	€ 1.165.166	€ 1.033.781

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Emerging Asia Bond Fund		Emerging Local Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 35.429	\$ 40.029	\$ 2.474.989	\$ 2.914.174
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	29	34	65.316	57.882
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	32	16	12.878	32.209
Einlagen bei Kontrahenten	46	46	56.800	39.081
Forderungen aus Einkünften	407	434	41.960	49.596
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	0	96.176	81
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	141.826	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	0	24	1.370	1.607
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	37	34	2.429	0
Sonstige Aktiva	0	0	181	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>35.980</b>	<b>40.617</b>	<b>2.893.925</b>	<b>3.094.630</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(50)	(22)	(76.638)	(47.770)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	(3)	(93.446)	(17.106)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	(349.560)	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(29)	(151)	(843)	(448)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(44)	(51)	(1.960)	(2.372)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	(424)	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	(74)	(2.198)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Dividenden	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	0	(6.897)
Einlagen von Kontrahenten	0	0	(15.214)	(9.073)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(123)</b>	<b>(651)</b>	<b>(537.735)</b>	<b>(85.864)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 35.857</b>	<b>\$ 39.966</b>	<b>\$ 2.356.190</b>	<b>\$ 3.008.766</b>

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

Emerging Markets 2018 Fund		Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	
Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
\$ 62.540	\$ 72.078	\$ 2.590.517	\$ 3.267.464	\$ 203.072	\$ 243.763	\$ 56.563	\$ 43.642
0	0	0	0	0	0	0	300
607	371	27.358	35.652	1.878	1.689	739	1.587
0	15	0	5.292	1.660	1.478	240	97
270	0	27.463	24.680	1.699	401	1.214	279
933	880	38.394	50.988	2.812	2.851	278	210
2.557	1	11.530	13.457	995	0	106	12
0	0	1.054	1.077	0	0	0	0
0	0	2.102	3.764	25	1.193	0	18
0	0	6.427	5.071	444	310	0	107
0	0	0	0	0	0	1	0
66.907	73.345	2.704.845	3.407.445	212.585	251.685	59.141	46.252
(561)	(28)	(30.667)	(11.864)	(2.153)	(574)	(2.159)	(715)
0	0	(1.056)	(1.074)	0	0	0	0
0	(9)	0	(51)	(2.220)	(752)	0	(209)
0	0	0	0	0	0	0	0
(23)	(6)	(5.182)	(1.893)	(827)	(41)	(6)	(44)
(34)	(40)	(2.000)	(2.433)	(219)	(260)	(60)	(52)
0	0	(8.514)	(41.372)	(7.816)	(15.668)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(7.942)	(7.942)	0	0	0	0
0	0	(17)	(16)	0	0	0	0
(3)	0	(1.625)	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	(13)	0
(10)	(20)	(3.688)	(15.835)	0	(392)	(30)	(350)
0	(4)	0	0	0	0	0	0
(631)	(107)	(60.691)	(82.480)	(13.235)	(17.687)	(2.268)	(1.370)
\$ 66.276	\$ 73.238	\$ 2.644.154	\$ 3.324.965	\$ 199.350	\$ 233.998	\$ 56.873	\$ 44.882

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	€ 1.520.112	€ 1.291.405	€ 718.330	€ 749.417
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	19.141	7.568	6.580	3.377
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	3.281	16.780	3.263	5.072
Einlagen bei Kontrahenten	30.995	26.127	14.942	14.856
Forderungen aus Einkünften	6.422	6.194	4.839	6.255
Forderungen aus verkauften Anlagen	137	289	28	92
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	209.465	104.786	36.970	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	187	718	240	728
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	4.554	0	252
Sonstige Aktiva	0	10	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>1.789.740</b>	<b>1.458.431</b>	<b>785.192</b>	<b>780.049</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(11.675)	(14.157)	(2.224)	(3.009)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	(4.410)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(5.201)	(2.160)	(10.127)	(1.801)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(286.416)	(169.246)	(74.231)	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(202)	(1.151)	(185)	(221)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(596)	(538)	(288)	(304)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(8)	(11)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Dividenden	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(3.114)	0	(528)	0
Einlagen von Kontrahenten	(1.958)	(1.874)	(1.472)	(149)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(309.170)</b>	<b>(193.547)</b>	<b>(89.055)</b>	<b>(5.484)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>€ 1.480.570</b>	<b>€ 1.264.884</b>	<b>€ 696.137</b>	<b>€ 774.565</b>

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

Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Low Duration Fund		Euro Short-Term Fund	
Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
€ 1.458.748	€ 1.020.250	€ 251.737	€ 245.286	€ 666.678	€ 428.425	€ 1.049.778	€ 1.485.515
0	0	0	0	0	0	0	0
6.841	4.085	4.456	2.864	2.250	590	4.785	1.896
25.135	7.743	548	4.878	310	5.824	0	2.115
40.021	25.837	5.878	7.716	4.816	901	5.265	4.737
10.627	10.288	867	2.180	4.815	4.213	5.718	12.630
1.884	2.393	7	3.378	190	803	4.073	0
72.363	0	4.847	12.282	0	0	0	0
5.608	7.502	0	0	6	283	483	9.032
3.748	1.834	0	0	682	213	724	876
0	0	0	0	0	0	0	0
1.624.975	1.079.932	268.340	278.584	679.747	441.252	1.070.826	1.516.801
(7.172)	(3.887)	(1.428)	(2.496)	(2.676)	(508)	(4.777)	(2.730)
0	0	0	0	0	0	0	0
(58.476)	(27.209)	(2.099)	(30)	0	(6.303)	0	(851)
(147.255)	0	(24.128)	(19.589)	0	0	0	0
(1.079)	(1.093)	(1)	(279)	(82)	0	(1.069)	(2.160)
(1.373)	(1.072)	(82)	(100)	(286)	(92)	(574)	(719)
0	0	(3.444)	0	0	0	0	(51.727)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(9)	(11)	0	(2)	0	0	(1)	0
0	0	0	0	0	0	(1.951)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(2.559)	(635)	0	0	0	0
(1.508)	(459)	0	(1.071)	(724)	(70)	(3.705)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(216.872)	(33.731)	(33.741)	(24.202)	(3.768)	(6.973)	(12.077)	(58.187)
€ 1.408.103	€ 1.046.201	€ 234.599	€ 254.382	€ 675.979	€ 434.279	€ 1.058.749	€ 1.458.614

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global Advantage Fund		Global Advantage Real Return Fund	
	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 987.533	\$ 975.217	\$ 145.937	\$ 178.350
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	25.097	27.097	2.539	1.866
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4.038	2.717	477	1.171
Einlagen bei Kontrahenten	19.488	15.017	3.139	3.607
Forderungen aus Einkünften	4.933	4.928	532	756
Forderungen aus verkauften Anlagen	58.447	94.199	114	115
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	115.691	262.850	19.147	44.994
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	0	67	0	4
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	0	1.379	438
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>1.215.227</b>	<b>1.382.092</b>	<b>173.264</b>	<b>231.301</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(21.620)	(14.053)	(3.920)	(2.916)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	(1.065)	(2.397)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(63.017)	(100.653)	0	(1)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(281.454)	(396.321)	(36.221)	(51.662)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(99)	(150)	(127)	(163)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(444)	(472)	(79)	(100)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(67.961)	(69.517)	(29.268)	(45.228)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(24.558)	(6.731)	(622)	(2.364)
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(8)	(29)	(13)	(16)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Dividenden	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(6.349)	(1.132)	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(3.191)	(3.953)	(510)	(10)
Sonstige Verbindlichkeiten	(1)	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(468.702)</b>	<b>(593.011)</b>	<b>(71.825)</b>	<b>(104.857)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 746.525</b>	<b>\$ 789.081</b>	<b>\$ 101.439</b>	<b>\$ 126.444</b>

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

Global Bond ESG Fund		Global Bond Fund		Global Bond Ex-US Fund		Global High Yield Bond Fund	
Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
\$ 539.455	\$ 328.836	\$ 13.259.228	\$ 12.547.725	\$ 1.169.239	\$ 1.087.299	\$ 4.006.473	\$ 5.281.617
0	601	0	0	0	0	0	0
11.805	5.535	285.278	207.836	28.825	21.448	20.109	38.348
1.268	690	19.661	18.896	3.438	3.752	0	16.733
4.814	2.581	150.333	151.207	20.683	25.941	29.624	13.032
2.047	1.472	55.252	55.112	5.785	5.703	58.406	71.953
17.094	13.864	773.715	1.167.151	65.700	101.865	0	0
170.243	75.772	2.051.210	2.218.392	84.719	215.217	0	0
132	12	7.774	11.999	1.299	147	2.483	13.782
0	705	0	34.737	0	0	3.520	263
0	0	0	4	0	0	0	509
746.858	430.068	16.602.451	16.413.059	1.379.688	1.461.372	4.120.615	5.436.237
(7.832)	(4.001)	(199.974)	(177.534)	(15.694)	(21.228)	(28.050)	(12.120)
(4.588)	0	(2.753)	(1.276)	0	0	0	0
(50.742)	(14.359)	(810.035)	(1.260.137)	(68.522)	(110.182)	(15.809)	(5.591)
(238.369)	(124.895)	(4.498.057)	(4.169.454)	(197.369)	(289.009)	0	0
(49)	(15)	(3.604)	(55.240)	(1.308)	(14.522)	(4.091)	(14.707)
(192)	(134)	(5.346)	(5.502)	(567)	(558)	(2.518)	(3.370)
0	0	(387.920)	(309.114)	(80.957)	(87.977)	(37.599)	(40.409)
0	0	0	0	0	(2.331)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(232)	(275)	(7)	(9)	(39)	(95)
0	0	0	0	0	0	(2.936)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.172)	0	(27.702)	0	(9.036)	(518)	0	0
(2.943)	(560)	(78.182)	(15.519)	(8.693)	(3.798)	(951)	(9.987)
(9)	(8)	0	0	0	0	0	0
(305.896)	(143.972)	(6.013.805)	(5.994.051)	(382.153)	(530.132)	(91.993)	(86.279)
\$ 440.962	\$ 286.096	\$ 10.588.646	\$ 10.419.008	\$ 997.535	\$ 931.240	\$ 4.028.622	\$ 5.349.958

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global Investment Grade Credit Fund		Global Libor Plus Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 20.656.580	\$ 22.725.879	\$ 735.701	\$ 534.802
Einlagen bei Kreditinstituten	47.874	48.306	2.352	350
Finanzderivate	296.340	263.162	6.613	5.682
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	37.002	61.730	2.020	296
Einlagen bei Kontrahenten	418.973	281.654	17.461	3.314
Forderungen aus Einkünften	182.658	194.291	3.419	2.356
Forderungen aus verkauften Anlagen	13.909	52.585	162	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	967.784	324.542	58.512	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	36.901	39.380	2.644	6
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	4.813	394	599
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>22.658.021</b>	<b>23.996.342</b>	<b>829.278</b>	<b>547.405</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(292.099)	(160.352)	(11.445)	(2.856)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(27.999)	(28.721)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(229.326)	(73.732)	(3.750)	(2.108)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(2.015.671)	(511.714)	(144.880)	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(21.823)	(87.633)	0	(155)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(9.434)	(10.751)	(252)	(183)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(974.383)	(2.116.106)	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(44.180)	(197.309)	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(466)	(432)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Dividenden	(322)	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(22.826)	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(29.782)	(67.786)	(1.079)	(1.221)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	(12)	(6)
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(3.668.311)</b>	<b>(3.254.536)</b>	<b>(161.418)</b>	<b>(6.529)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 18.989.710</b>	<b>\$ 20.741.806</b>	<b>\$ 667.860</b>	<b>\$ 540.876</b>

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

Global Low Duration Real Return Fund		Global Multi-Asset Fund		Global Real Return Fund		Income Fund	
Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
\$ 2.188.080	\$ 2.574.138	\$ 1.454.901	\$ 1.437.286	\$ 3.171.999	\$ 3.121.719	\$ 75.827.313	\$ 73.531.495
200	390	0	0	0	0	0	250.483
28.479	22.340	22.270	23.302	47.064	22.844	833.746	685.812
4.390	3.902	6.502	9.345	9.254	6.657	111.875	170.053
18.606	16.880	55.810	43.676	32.539	26.334	1.520.726	1.200.991
7.270	7.314	3.848	3.460	9.179	10.012	449.204	432.214
61.521	72	405	10.621	454	5.902	14.832	61.721
262.852	260.400	535.947	626.625	438.123	472.525	5.653.207	2.573.425
1.713	2.337	424	6.300	15.238	19.081	180.980	437.689
2.627	4.187	12.570	0	1.274	3.827	518.998	68.424
44	0	0	0	0	11	0	0
2.575.782	2.891.960	2.092.677	2.160.615	3.725.124	3.688.912	85.110.881	79.412.307
(27.732)	(20.751)	(38.008)	(20.607)	(41.377)	(29.064)	(1.432.689)	(637.172)
(35.264)	(55.204)	(66.592)	(90.688)	(40.069)	(63.921)	(21.886)	(4.400)
(10.702)	(20)	0	(7.803)	(15.203)	(5.812)	(669.178)	(763.011)
(543.491)	(359.634)	(879.168)	(839.956)	(770.201)	(606.509)	(11.773.444)	(4.885.873)
(745)	(60.386)	(9.022)	(258)	(9.830)	(6.146)	(184.007)	(345.162)
(773)	(1.104)	(961)	(992)	(1.202)	(1.267)	(51.517)	(56.028)
0	(74.785)	(66.066)	(124.070)	(595.734)	(751.824)	(4.945.915)	(239.546)
(390.534)	(119.150)	0	(2.074)	0	(21.377)	(197.208)	(7.529)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	0	(43)	(15)	(57)	(74)	(4.452)	(3.964)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	(825)	0	0	0	0
(9.356)	(3.459)	(5.897)	(6.588)	(23.052)	(5.251)	(229.983)	(194.831)
0	0	0	0	0	0	(41)	(41)
(1.018.598)	(694.493)	(1.065.757)	(1.093.876)	(1.496.725)	(1.491.245)	(19.510.320)	(7.137.557)
\$ 1.557.184	\$ 2.197.467	\$ 1.026.920	\$ 1.066.739	\$ 2.228.399	\$ 2.197.667	\$ 65.600.561	\$ 72.274.750

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Inflation Strategy Fund		Low Average Duration Fund	
	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 119.951	\$ 115.060	\$ 1.968.464	\$ 1.941.530
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	7.704	21.020
Finanzderivate	1.625	1.700	17.996	9.452
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	406	110	1.941	2.601
Einlagen bei Kontrahenten	2.275	1.421	15.157	33.059
Forderungen aus Einkünften	362	324	6.124	7.845
Forderungen aus verkauften Anlagen	16	44	61	12
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	23.543	52.452	580.758	506.132
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	11	217	220	2.756
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	1.256	268	4.681	2.185
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>149.445</b>	<b>171.596</b>	<b>2.603.106</b>	<b>2.526.592</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(3.216)	(1.517)	(13.754)	(35.457)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(4.650)	(6.601)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(905)	(75)	(9.566)	(5.306)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(44.964)	(67.846)	(1.020.588)	(748.886)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(285)	(31)	(2.421)	(1.411)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(94)	(92)	(635)	(766)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(4.571)	(5.925)	(114.052)	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(5)	(6)	(269)	(752)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Dividenden	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(521)	0	(13.538)	(986)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	(1)	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(59.211)</b>	<b>(82.094)</b>	<b>(1.174.823)</b>	<b>(793.564)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 90.234</b>	<b>\$ 89.502</b>	<b>\$ 1.428.283</b>	<b>\$ 1.733.028</b>

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

<sup>(1)</sup> Der Low Duration Income Fund wurde am 31. Mai 2018 aufgelegt.

Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund <sup>(1)</sup>		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		Mortgage Opportunities Fund	
Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	
\$ 656.085	\$ 666.564	\$ 428.615	\$ 258.252	\$ 380.000	\$ 3.413.014	\$ 2.250.282	
0	0	0	0	0	0	0	
6.053	6.988	1.780	2.863	6.790	15.729	7.202	
508	166	20.542	96	0	0	3.290	
9.084	4.903	2.641	2.620	0	23.547	3.567	
5.267	5.053	489	41	171	10.016	6.624	
3.733	663	18	0	254	322.576	25	
0	7.978	26.065	0	0	2.108.156	2.557.500	
216	289	0	129	236	35.869	815	
1.141	980	33	0	0	0	0	
0	0	0	0	0	0	0	
682.087	693.584	480.183	264.001	387.451	5.928.907	4.829.305	
(6.475)	(2.829)	(2.854)	(3.432)	(2.356)	(13.101)	(2.315)	
0	0	0	0	0	(624.925)	(653.276)	
(2)	(1.064)	(49.708)	0	(84)	(225.511)	(4.293)	
(2.943)	(11.025)	(71.354)	0	0	(2.050.357)	(2.379.040)	
(268)	(171)	0	(144)	(220)	(328)	(284)	
(250)	(293)	(29)	(197)	(268)	(1.435)	(1.045)	
(73.218)	(47.018)	0	0	0	(589.149)	(281.505)	
(40.052)	0	0	0	0	(25.040)	(19.308)	
0	0	0	0	0	0	0	
0	0	0	(2)	0	(9)	(14)	
0	0	0	0	(1.380)	(20.603)	0	
0	0	0	0	0	0	0	
0	0	0	0	0	(4.748)	(311)	
(732)	(2.211)	(120)	(200)	(3.794)	(6.159)	(3.322)	
0	0	0	0	(14)	(19)	0	
(123.940)	(64.611)	(124.065)	(3.975)	(8.116)	(3.561.384)	(3.344.713)	
\$ 558.147	\$ 628.973	\$ 356.118	\$ 260.026	\$ 379.335	\$ 2.367.523	\$ 1.484.592	

## Finanzstatus (Forts.)

	PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund		PIMCO RAE Fundamental Europe Fund	
	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
(Angaben in Tausend)				
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 65.114	\$ 84.240	€ 17.217	€ 13.734
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	0	0	0	0
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	439	62	173	54
Einlagen bei Kontrahenten	0	0	0	0
Forderungen aus Einkünften	301	290	41	17
Forderungen aus verkauften Anlagen	128	200	1	1
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	3	24	9	156
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	0	0	0
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>65.985</b>	<b>84.816</b>	<b>17.441</b>	<b>13.962</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	0	0	0	0
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	(13)	(62)	(141)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(484)	(1.948)	(6)	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(20)	(24)	(9)	(7)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(23)	(106)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Dividenden	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	0	0	0	0
Sonstige Verbindlichkeiten	(1)	(4)	0	(1)
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(528)</b>	<b>(2.095)</b>	<b>(77)</b>	<b>(149)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 65.457</b>	<b>\$ 82.721</b>	<b>€ 17.364</b>	<b>€ 13.813</b>

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

PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund		PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund		PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund		PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund	
Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
\$ 71.132	\$ 102.292	\$ 58.427	\$ 81.848	\$ 320.510	\$ 551.712	\$ 147.567	\$ 138.456
0	0	200	300	2.699	3.501	0	1.001
0	0	1.639	5.281	9.945	15.388	3.799	2.969
402	625	215	199	867	0	453	559
0	0	4.394	753	14.868	8.556	3.190	3.615
129	100	241	264	1.585	2.546	467	517
1	1	36	1	751	3.138	92	1.288
0	0	18.989	0	73.198	0	27.563	0
17	141	0	215	223	66	0	15.954
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
71.681	103.159	84.141	88.861	424.646	584.907	183.131	164.359
0	0	(3.152)	(783)	(14.767)	(7.297)	(3.753)	(2.284)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(384)	0	(686)	0	0	(2.889)
0	0	(27.179)	0	(109.831)	0	(46.110)	0
(10)	0	(1)	(6)	(25)	0	(120)	(161)
(41)	(57)	(83)	(109)	(418)	(552)	(88)	(92)
0	0	0	0	(4.839)	(117.453)	(2.857)	0
0	0	(2.252)	0	(35.943)	(22.091)	0	(3.857)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	(3)	0	(2)
0	0	0	0	0	(4.807)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(571)	(859)	(12)	(1.084)	(1.528)	(951)
0	0	(120)	(3.423)	(7.223)	(9.652)	(1.552)	(5.085)
(4)	(2)	(2)	(2)	0	0	0	0
(55)	(59)	(33.744)	(5.182)	(173.744)	(162.939)	(56.008)	(15.321)
\$ 71.626	\$ 103.100	\$ 50.397	\$ 83.679	\$ 250.902	\$ 421.968	\$ 127.123	\$ 149.038

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO RAE Fundamental US Fund		Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 13.720	\$ 13.992	\$ 530.463	\$ 497.508
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	0	0	4.330	4.659
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	73	89	0	99
Einlagen bei Kontrahenten	0	0	8.781	5.216
Forderungen aus Einkünften	13	11	7.959	6.900
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	0	0	2.038
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	5	0	73	108
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	0	386	0
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>13.811</b>	<b>14.092</b>	<b>551.992</b>	<b>516.528</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	0	0	(4.717)	(985)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	0	0	(25)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	0	(2)	(13)	(38)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(5)	(6)	(399)	(369)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	(1.714)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	(179)	(179)
Überziehungskredit	0	0	(38)	0
Verbindlichkeiten aus Dividenden	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	0	(435)
Einlagen von Kontrahenten	0	0	(365)	(895)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	(1)	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(5)</b>	<b>(9)</b>	<b>(5.711)</b>	<b>(4.640)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 13.806</b>	<b>\$ 14.083</b>	<b>\$ 546.281</b>	<b>\$ 511.888</b>

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

StocksPLUS™ Fund		Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
\$ 2.150.416	\$ 1.899.169	\$ 986.352	\$ 809.445	\$ 9.446.323	\$ 9.185.048	\$ 114.217	\$ 125.535
10.404	18.817	0	4.505	84.253	84.310	2.002	0
26.038	31.095	12.477	8.993	97.905	60.413	12.602	4.752
1.545	1.806	6.307	5.285	11.288	13.970	798	1.987
44.203	18.951	15.444	7.465	90.790	95.550	8.099	7.135
7.985	6.535	4.894	3.374	39.557	40.927	393	519
127	196	96	5.015	1.704	12	0	5
480.536	412.905	142.305	114.828	2.224.355	2.221.252	0	0
14.356	517	1.938	8.141	13.131	11.901	0	13
8.178	0	1.208	1.480	21.776	6.556	135	0
0	0	0	0	0	0	0	0
2.743.788	2.389.991	1.171.021	968.531	12.031.082	11.719.939	138.246	139.946
(27.205)	(16.954)	(11.730)	(5.571)	(92.946)	(77.548)	(12.058)	(3.562)
0	(71.805)	0	(4.900)	0	0	0	0
(3.723)	(5.882)	(4.318)	(8.944)	(27.505)	(7.217)	0	(999)
(699.588)	(566.689)	(230.285)	(159.639)	(4.897.148)	(4.150.808)	0	0
(410)	(140)	(728)	(159)	(13.925)	(10.020)	0	(10)
(1.023)	(876)	(897)	(732)	(3.847)	(4.514)	(144)	(164)
0	0	(2.183)	0	(1.182.073)	(1.035.669)	0	0
0	0	0	0	(17.683)	(30.250)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(4)	(6)	(14)	(7)	(255)	(342)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	(393)	0	0	0	0	0	(686)
(21.693)	(31.768)	(941)	(3.041)	(61.396)	(9.052)	(3.244)	(490)
0	0	(4)	(4)	0	0	(4)	(6)
(753.646)	(694.513)	(251.100)	(182.997)	(6.296.778)	(5.325.420)	(15.450)	(5.917)
\$ 1.990.142	\$ 1.695.478	\$ 919.921	\$ 785.534	\$ 5.734.304	\$ 6.394.519	\$ 122.796	\$ 134.029

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	£ 460.993	£ 503.253	£ 521.801	£ 503.714
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	2.066	1.592	2.955	2.992
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	0	4.611	1.047	1.702
Einlagen bei Kontrahenten	4.550	4.833	5.123	4.188
Forderungen aus Einkünften	4.809	5.317	6.857	6.276
Forderungen aus verkauften Anlagen	2.049	0	2	3
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	6.670	10.518	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	67	85	31	3.907
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	552	0	0
Sonstige Aktiva	0	0	0	4
<b>Summe Aktiva</b>	<b>481.204</b>	<b>530.761</b>	<b>537.816</b>	<b>522.786</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(2.107)	(750)	(2.457)	(774)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(1.299)	(2.612)	(131)	(171)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(13.322)	(17.239)	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(143)	(282)	(11)	(3)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(128)	(137)	(151)	(164)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(27.607)	(27.374)	(105.243)	(82.871)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	(3)	(2)
Überziehungskredit	(520)	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Dividenden	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(894)	0	(1.677)	(612)
Einlagen von Kontrahenten	(884)	(1.692)	(2.067)	(3.548)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(46.904)</b>	<b>(50.086)</b>	<b>(111.740)</b>	<b>(88.145)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>£ 434.300</b>	<b>£ 480.675</b>	<b>£ 426.076</b>	<b>£ 434.641</b>

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

Unconstrained Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund	
Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017
\$ 2.692.302	\$ 2.847.563	\$ 2.794.662	\$ 3.148.334	\$ 214.928	\$ 171.855	\$ 1.835.899	\$ 1.350.647
14.004	6.601	0	0	0	0	25.220	9.908
52.885	69.264	6.520	12.263	1.213	1.246	6.381	4.856
4.116	553	0	143	402	223	3.179	1.012
74.381	48.584	11.316	6.226	4.562	3.875	11.346	7.587
12.671	13.822	44.710	44.482	1.880	1.431	11.198	7.195
3.162	52	8	3.042	630	1.500	992	161
290.787	59.206	0	0	4.247	2.033	0	0
1.004	2.523	2.442	4.967	364	146	5.766	1.060
0	0	2.145	0	522	79	4.950	2.684
0	0	0	256	0	1	0	0
3.145.312	3.048.168	2.861.803	3.219.713	228.748	182.389	1.904.931	1.385.110
(38.141)	(15.042)	(6.787)	(1.445)	(2.579)	(630)	(8.033)	(7.409)
0	0	0	0	0	0	0	0
(4.008)	(384)	(15.379)	(152.803)	(2.101)	(1.076)	(9.300)	(3.352)
(654.390)	(105.067)	0	0	(12.148)	(3.045)	0	0
(1.060)	(4.280)	(6.548)	(10.996)	(669)	(502)	(1.475)	(1.413)
(1.949)	(2.225)	(1.478)	(1.693)	(73)	(62)	(471)	(325)
(73.974)	(346.878)	(43.381)	(34.023)	(26.011)	(10.515)	(44.862)	(196)
0	0	0	0	(7.435)	(6.523)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(32)	(61)	(46)	(68)	0	0	(7)	(6)
0	0	(5.311)	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(22.001)	(43.219)	0	(213)	0	0	0	0
(4.864)	(5.111)	0	(4.152)	(10)	(240)	(1.632)	(370)
0	0	0	0	(4)	(6)	0	0
(800.419)	(522.267)	(78.930)	(205.393)	(51.030)	(22.599)	(65.780)	(13.071)
\$ 2.344.893	\$ 2.525.901	\$ 2.782.873	\$ 3.014.320	\$ 177.718	\$ 159.790	\$ 1.839.151	\$ 1.372.039

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Summe der Gesellschaft*	
	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017**
<b>Aktiva:</b>		
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:		
Übertragbare Wertpapiere	\$ 184.285.121	\$ 184.243.915
Einlagen bei Kreditinstituten	224.040	450.393
Finanzderivate	2.260.670	1.896.367
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	365.945	448.145
Einlagen bei Kontrahenten	3.320.087	2.484.905
Forderungen aus Einkünften	1.253.612	1.304.900
Forderungen aus verkauften Anlagen	1.451.131	1.579.801
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	17.330.567	13.294.013
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	349.689	663.173
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	637.440	172.052
Sonstige Aktiva	226	798
<b>Summe Aktiva</b>	<b>211.478.528</b>	<b>206.538.462</b>
<b>Passiva:</b>		
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:		
Finanzderivate	(2.812.381)	(1.520.741)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(837.235)	(1.001.645)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(2.572.944)	(2.711.705)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(33.200.497)	(20.836.917)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(376.816)	(673.161)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(110.920)	(120.699)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(10.581.541)	(6.529.502)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(785.507)	(440.894)
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuer	(7.942)	(7.942)
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(5.982)	(9.901)
Überziehungskredit	(44.267)	(21.737)
Verbindlichkeiten aus Dividenden	(8.194)	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(107.037)	(61.640)
Einlagen von Kontrahenten	(620.440)	(502.779)
Sonstige Verbindlichkeiten	(101)	(100)
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(52.071.804)</b>	<b>(34.439.363)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 159.406.724</b>	<b>\$ 172.099.099</b>

\* Die Summe der Gesellschaft wurde bereinigt, um den Überkreuzinvestitionen des Global Multi-Asset Fund in den Global Advantage Real Return Fund und den Income Fund Rechnung zu tragen. Der Betrag wurde ferner bereinigt, um Überkreuzinvestitionen des Diversified Income Fund, des Diversified Income Duration Hedged Fund, des Global Bond Fund, des Low Average Duration Fund, des Total Return Bond Fund, des Unconstrained Bond Fund und des US High Yield Bond Fund in den US Short-Term Fund zu berücksichtigen. Darüber hinaus wurde der Betrag bereinigt, um Überkreuzinvestitionen des Dynamic Multi-Asset Fund in den Income Fund und den Mortgage Opportunities Fund sowie Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen.

\*\* Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2017 wurde nicht angepasst, um die Schließung des Euro Real Return Fund, des Euro Ultra-Long Duration Fund und des UK Low Duration Fund zu berücksichtigen.

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

# Betriebsergebnisrechnung

(Angaben in Tausend)

	PIMCO Capital Securities Fund		Commodity Real Return Fund	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 194.321	\$ 148.605	\$ 8.764	\$ 5.573
Sonstige Erträge	3	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	143.066	75.539	(1.266)	(4.066)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	2.033	67.480	27.740	(30.986)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(27.440)	(78.818)	50	88
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(699.077)	438.175	(13.812)	12.497
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(4.050)	(17.037)	(24.479)	121
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(1.904)	220	102	61
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(393.048)	634.164	(2.901)	(16.712)
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(41.575)	(30.296)	(2.714)	(2.172)
Servicegebühr	(879)	(342)	(38)	(15)
Bestandspflegegebühr	(1.085)	(959)	0	0
Zinsaufwendungen	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(169)	(62)	0	0
Gesamtaufwendungen	(43.708)	(31.659)	(2.752)	(2.187)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	42	42
Betriebskosten, netto	(43.708)	(31.659)	(2.710)	(2.145)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>(436.756)</b>	<b>602.505</b>	<b>(5.611)</b>	<b>(18.857)</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(7.594)	(117)	(567)	(487)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(49.395)	(42.509)	0	(5)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	58	3.829	0	(1)
Summe Finanzierungskosten	(56.931)	(38.797)	(567)	(493)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>(493.687)</b>	<b>563.708</b>	<b>(6.178)</b>	<b>(19.350)</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(1.372)	(1.011)	0	0
Kapitalertragsteuer	0	0	(4)	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>(495.059)</b>	<b>562.697</b>	<b>(6.182)</b>	<b>(19.350)</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ (495.059)</b>	<b>\$ 562.697</b>	<b>\$ (6.182)</b>	<b>\$ (19.350)</b>

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

PIMCO Credit Absolute Return Fund		Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund		Dynamic Multi-Asset Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 6.343	\$ 5.833	\$ 156.135	\$ 133.291	\$ 26.804	\$ 26.043	€ 1.879	€ 662
0	0	4	0	0	17	3	0
(3.587)	2.934	26.243	(28.701)	5.548	(2.647)	1.279	2.063
(2.486)	12.519	(167.118)	173.041	(5.268)	49.135	(17.595)	26.285
(185)	(70)	(16.745)	(19.518)	(2.027)	(4.584)	64	(148)
(3.984)	6.099	(287.146)	312.678	(53.893)	63.253	4.466	(6.037)
(1.378)	425	(61.304)	87.503	(15.997)	(10.673)	(474)	(5.049)
211	22	2.412	384	598	153	(34)	(204)
(5.066)	27.762	(347.519)	658.678	(44.235)	120.697	(10.412)	17.572
(1.444)	(1.490)	(40.357)	(33.348)	(6.090)	(5.072)	(7.197)	(3.035)
0	0	(106)	(68)	(29)	(14)	0	0
0	0	(59)	(40)	0	0	0	0
(3)	(7)	(164)	(95)	(6)	(13)	(46)	(1)
(1.447)	(1.497)	(40.686)	(33.551)	(6.125)	(5.099)	(7.243)	(3.036)
1	1	514	256	92	44	47	4
(1.446)	(1.496)	(40.172)	(33.295)	(6.033)	(5.055)	(7.196)	(3.032)
(6.512)	26.266	(387.691)	625.383	(50.268)	115.642	(17.608)	14.540
(338)	(449)	(268)	(200)	(307)	(8)	(348)	(14)
0	0	0	0	0	0	0	0
(578)	(1.636)	(53.475)	(47.567)	(9.418)	(6.961)	(18)	(43)
(185)	(317)	(301)	2.377	297	(161)	(14)	0
(1.101)	(2.402)	(54.044)	(45.390)	(9.428)	(7.130)	(380)	(57)
(7.613)	23.864	(441.735)	579.993	(59.696)	108.512	(17.988)	14.483
(14)	(4)	(1)	0	0	(14)	(199)	0
0	0	(14)	(4)	(2)	70	0	0
(7.627)	23.860	(441.750)	579.989	(59.698)	108.568	(18.187)	14.483
\$ (7.627)	\$ 23.860	\$ (441.750)	\$ 579.989	\$ (59.698)	\$ 108.568	€ (18.187)	€ 14.483

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Emerging Asia Bond Fund		Emerging Local Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 795	\$ 967	\$ 101.548	\$ 59.995
Sonstige Erträge	0	2	0	41
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(131)	71	(118.128)	(44.198)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(59)	114	(34.068)	57.695
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(21)	0	20.979	(7.622)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(1.486)	964	(123.057)	177.782
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(11)	(82)	(20.751)	9.879
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	28	1	(5.322)	1.317
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(885)	2.037	(178.799)	254.889
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(278)	(328)	(14.204)	(11.958)
Servicegebühr	0	0	(41)	(40)
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	(3)	(1)
Gesamtaufwendungen	(278)	(328)	(14.248)	(11.999)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(278)	(328)	(14.248)	(11.999)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>(1.163)</b>	<b>1.709</b>	<b>(193.047)</b>	<b>242.890</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(1)	0	(431)	(177)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(649)	(1.144)	(41.098)	(25.021)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(3)	(4)	(3.784)	(334)
Summe Finanzierungskosten	(653)	(1.148)	(45.313)	(25.532)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>(1.816)</b>	<b>561</b>	<b>(238.360)</b>	<b>217.358</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(1)	0	(617)	(4.255)
Kapitalertragsteuer	0	0	339	(1.734)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>(1.817)</b>	<b>561</b>	<b>(238.638)</b>	<b>211.369</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ (1.817)</b>	<b>\$ 561</b>	<b>\$ (238.638)</b>	<b>\$ 211.369</b>

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

Emerging Markets 2018 Fund		Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 1.314	\$ 1.438	\$ 69.029	\$ 76.610	\$ 6.444	\$ 7.428	\$ 1.266	\$ 460
0	0	1	70	0	7	0	1
124	95	(3.401)	9.968	(1.479)	1.827	(147)	351
(980)	1.508	(41.821)	(50.169)	(5.006)	7.276	75	(162)
7	3	739	137.451	3	73	(19)	(100)
(661)	45	(193.342)	100.148	(9.708)	4.429	(1.168)	734
(303)	701	(37.313)	36.202	(1.391)	3.322	(2.396)	1.861
22	(1)	(1.514)	439	(74)	168	(10)	11
(477)	3.789	(207.622)	310.719	(11.211)	24.530	(2.399)	3.156
(220)	(213)	(13.917)	(13.226)	(1.458)	(1.594)	(379)	(288)
0	(1)	(25)	(17)	0	0	0	0
0	0	(72)	(60)	(1)	(6)	0	0
0	0	(4)	(2)	0	0	0	0
(220)	(214)	(14.018)	(13.305)	(1.459)	(1.600)	(379)	(288)
0	0	117	0	0	0	5	3
(220)	(214)	(13.901)	(13.305)	(1.459)	(1.600)	(374)	(285)
(697)	3.575	(221.523)	297.414	(12.670)	22.930	(2.773)	2.871
0	0	(114)	(3)	(124)	(128)	(9)	(7)
0	0	0	0	0	0	0	0
(345)	(766)	(29.322)	(43.441)	(280)	(209)	(34)	(7)
(222)	0	(396)	3.184	44	(34)	(1)	1
(567)	(766)	(29.832)	(40.260)	(360)	(371)	(44)	(13)
(1.264)	2.809	(251.355)	257.154	(13.030)	22.559	(2.817)	2.858
(2)	0	(10)	(471)	(6)	0	(6)	(13)
0	0	0	241	0	0	(1)	0
(1.266)	2.809	(251.365)	256.924	(13.036)	22.559	(2.824)	2.845
\$ (1.266)	\$ 2.809	\$ (251.365)	\$ 256.924	\$ (13.036)	\$ 22.559	\$ (2.824)	\$ 2.845

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	€ 7.859	€ 11.317	€ 5.727	€ 4.214
Sonstige Erträge	17	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(3.233)	5.860	214	7.685
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(8.344)	42.579	(2.157)	9.313
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(2.435)	1.828	(985)	140
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	7.703	(43.622)	(3.780)	(17.902)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	14.767	(8.945)	3.641	1.758
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(4.199)	(5.002)	(703)	(382)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	12.135	4.015	1.957	4.826
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(3.731)	(3.286)	(1.769)	(1.388)
Servicegebühr	(27)	(32)	0	0
Bestandspflegegebühr	(9)	(10)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(7)	(2)	0	0
Gesamtaufwendungen	(3.774)	(3.330)	(1.769)	(1.388)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	246	9	73	42
Betriebskosten, netto	(3.528)	(3.321)	(1.696)	(1.346)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>8.607</b>	<b>694</b>	<b>261</b>	<b>3.480</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(154)	(288)	(44)	(7)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(224)	(272)	(1.154)	(1.121)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	2	(15)	(136)	349
Summe Finanzierungskosten	(376)	(575)	(1.334)	(779)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>8.231</b>	<b>119</b>	<b>(1.073)</b>	<b>2.701</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(14)	0	(1)	0
Kapitalertragsteuer	0	0	(10)	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>8.217</b>	<b>119</b>	<b>(1.084)</b>	<b>2.701</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit</b>	<b>€ 8.217</b>	<b>€ 119</b>	<b>€ (1.084)</b>	<b>€ 2.701</b>

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

Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Low Duration Fund		Euro Short-Term Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
€ 15.434	€ 13.405	€ 1.640	€ 3.091	€ 1.133	€ 325	€ 2.001	€ 3.468
0	0	0	0	5	0	0	0
3.283	15.985	(812)	594	(3.004)	(42)	(15.242)	136
(3.684)	15.798	2.044	(261)	859	(525)	4.652	11.462
(3.160)	1.032	(206)	515	(240)	162	(2.354)	(1.647)
(15.159)	(24.391)	3.907	(7.098)	(730)	(874)	1.598	(16.412)
(874)	4.292	2.847	639	(433)	1.351	842	3.652
92	(468)	(733)	(127)	1	(19)	0	367
(4.068)	25.653	8.687	(2.647)	(2.409)	378	(8.503)	1.026
(7.721)	(4.680)	(535)	(753)	(1.504)	(177)	(4.064)	(4.539)
(11)	(39)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(50)	(26)	(1)	0	(4)	0	(2)	(1)
(7.782)	(4.745)	(536)	(753)	(1.508)	(177)	(4.066)	(4.540)
187	112	31	3	2	2	17	64
(7.595)	(4.633)	(505)	(750)	(1.506)	(175)	(4.049)	(4.476)
(11.663)	21.020	8.182	(3.397)	(3.915)	203	(12.552)	(3.450)
(146)	0	(29)	(9)	(35)	(20)	(44)	(8)
0	0	0	0	0	0	0	0
(10.481)	(11.380)	0	0	0	0	(89)	(275)
18	(6)	0	0	0	0	(4)	(3)
(10.609)	(11.386)	(29)	(9)	(35)	(20)	(137)	(286)
(22.272)	9.634	8.153	(3.406)	(3.950)	183	(12.689)	(3.736)
0	0	0	0	(1)	0	0	0
0	0	0	0	(1)	0	(1)	0
(22.272)	9.634	8.153	(3.406)	(3.952)	183	(12.690)	(3.736)
€ (22.272)	€ 9.634	€ 8.153	€ (3.406)	€ (3.952)	€ 183	€ (12.690)	€ (3.736)

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Global Advantage Fund		Global Advantage Real Return Fund	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 11.463	\$ 9.777	\$ 2.946	\$ 4.700
Sonstige Erträge	0	7	0	2
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	41	2.353	(406)	(8.625)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	1.619	14.262	(2.060)	4.372
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(10.720)	(2.303)	(192)	2.486
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(23.551)	28.513	(5.903)	15.789
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(10.330)	20.671	(191)	877
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	7.828	(9.331)	847	33
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(23.650)	63.949	(4.959)	19.634
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(2.832)	(2.731)	(549)	(933)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)	0	0
Gesamtaufwendungen	(2.833)	(2.732)	(549)	(933)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	34	0	0	0
Betriebskosten, netto	(2.799)	(2.732)	(549)	(933)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>(26.449)</b>	<b>61.217</b>	<b>(5.508)</b>	<b>18.701</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(556)	(383)	(280)	(266)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(1.125)	(1.012)	(667)	(1.604)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(36)	0	(14)	(173)
Summe Finanzierungskosten	(1.717)	(1.395)	(961)	(2.043)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>(28.166)</b>	<b>59.822</b>	<b>(6.469)</b>	<b>16.658</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(75)	(166)	(8)	(45)
Kapitalertragsteuer	13	0	2	(5)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>(28.228)</b>	<b>59.656</b>	<b>(6.475)</b>	<b>16.608</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ (28.228)</b>	<b>\$ 59.656</b>	<b>\$ (6.475)</b>	<b>\$ 16.608</b>

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

Global Bond ESG Fund		Global Bond Fund		Global Bond Ex-US Fund		Global High Yield Bond Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Berichtszeitraum vom 12. Jan. 2017 bis 30. Jun. 2017	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 4.283	\$ 559	\$ 118.560	\$ 97.915	\$ 11.628	\$ 9.118	\$ 133.094	\$ 145.979
0	0	125	5	2	0	0	0
2.014	766	62.623	(17.538)	4.319	(12.535)	32.511	(13.822)
(7.940)	695	(51.090)	297.944	16.773	19.205	(20.964)	111.544
(2.228)	(119)	(144.634)	(24.977)	(12.487)	(981)	3.062	(981)
(10.432)	2.141	(311.232)	398.252	(26.912)	45.341	(219.496)	192.154
2.520	1.248	48.655	(149.831)	12.242	(32.552)	(33.552)	54.002
834	(541)	108.185	(95.537)	10.692	(10.766)	75	585
(10.949)	4.749	(168.808)	506.233	16.257	16.830	(105.270)	489.461
(1.101)	(196)	(33.753)	(28.854)	(3.345)	(2.517)	(17.899)	(19.897)
0	0	(1.340)	(1.289)	(15)	(13)	(41)	(36)
0	0	(46)	(65)	(23)	(22)	(245)	(303)
(10)	0	(55)	(46)	(1)	0	(34)	(106)
(1.111)	(196)	(35.194)	(30.254)	(3.384)	(2.552)	(18.219)	(20.342)
0	0	892	156	12	0	263	0
(1.111)	(196)	(34.302)	(30.098)	(3.372)	(2.552)	(17.956)	(20.342)
(12.060)	4.553	(203.110)	476.135	12.885	14.278	(123.226)	469.119
(381)	(3)	(1.593)	(2.318)	(446)	(587)	(301)	(67)
0	0	0	0	0	0	(860)	(314)
(688)	(63)	(14.118)	(18.793)	(1.353)	(610)	(45.865)	(54.526)
133	20	(679)	2.175	14	37	(3.189)	6.839
(936)	(46)	(16.390)	(18.936)	(1.785)	(1.160)	(50.215)	(48.068)
(12.996)	4.507	(219.500)	457.199	11.100	13.118	(173.441)	421.051
0	0	7	(2)	(20)	(48)	(209)	0
0	0	(9)	0	(1)	0	0	0
(12.996)	4.507	(219.502)	457.197	11.079	13.070	(173.650)	421.051
\$ (12.996)	\$ 4.507	\$ (219.502)	\$ 457.197	\$ 11.079	\$ 13.070	\$ (173.650)	\$ 421.051

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Global Investment Grade Credit Fund		Global Libor Plus Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 380.397	\$ 302.604	\$ 8.682	\$ 278
Sonstige Erträge	1	138	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(66.381)	18.706	1.458	86
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(197.963)	441.449	(16.621)	223
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(10.519)	(347)	(607)	(8)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(722.092)	474.626	(10.611)	208
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(104.956)	63.960	(7.488)	233
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	5.587	(386)	(17)	4
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(715.926)	1.300.750	(25.204)	1.024
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(60.764)	(51.629)	(1.542)	(58)
Servicegebühr	(1.829)	(1.342)	(2)	0
Bestandspflegegebühr	(924)	(813)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(73)	(18)	(15)	0
Gesamtaufwendungen	(63.590)	(53.802)	(1.559)	(58)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	456	461	98	0
Betriebskosten, netto	(63.134)	(53.341)	(1.461)	(58)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	(779.060)	1.247.409	(26.665)	966
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(13.159)	(7.973)	(84)	0
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(115.558)	(105.679)	(159)	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(1.520)	13.426	57	0
Summe Finanzierungskosten	(130.237)	(100.226)	(186)	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	(909.297)	1.147.183	(26.851)	966
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(694)	(67)	(2)	0
Kapitalertragsteuer	(3)	0	0	(2)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	(909.994)	1.147.116	(26.853)	964
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit</b>	\$ (909.994)	\$ 1.147.116	\$ (26.853)	\$ 964

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

Global Low Duration Real Return Fund		Global Multi-Asset Fund		Global Real Return Fund		Income Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 30.017	\$ 18.723	\$ 12.802	\$ 9.898	\$ 37.496	\$ 30.793	\$ 1.181.169	\$ 488.244
2	0	0	0	0	0	87	219
2.405	(2.558)	(10.877)	(407)	4.889	5.201	376.266	32.510
(15.529)	37.664	4.727	67.756	4.716	15.315	(1.132.593)	938.658
125	1.248	(257)	(1.660)	(2.464)	(5.316)	(100.197)	(51.486)
(51.892)	29.865	(11.604)	20.793	(100.202)	58.883	(1.806.350)	1.053.922
(467)	9.850	(14.349)	3.604	14.024	7.383	(592.262)	57.933
(205)	272	27	2.572	3.625	1.449	9.180	(2.036)
(35.544)	95.064	(19.531)	102.556	(37.916)	113.708	(2.064.700)	2.517.964
(5.262)	(4.864)	(6.359)	(5.652)	(7.504)	(7.996)	(332.469)	(150.717)
(10)	(1)	(23)	(13)	(188)	(227)	(4.792)	(1.487)
0	0	0	0	(224)	(256)	(15.797)	(7.255)
(1)	0	(2)	(2)	(3)	(1)	(2.138)	(721)
(5.273)	(4.865)	(6.384)	(5.667)	(7.919)	(8.480)	(355.196)	(160.180)
0	0	330	292	0	0	511	518
(5.273)	(4.865)	(6.054)	(5.375)	(7.919)	(8.480)	(354.685)	(159.662)
(40.817)	90.199	(25.585)	97.181	(45.835)	105.228	(2.419.385)	2.358.302
(3.784)	(728)	(1.094)	(457)	(6.088)	(2.727)	(45.315)	(8.446)
0	0	0	0	0	0	0	0
(2.816)	(1.323)	(756)	(835)	(3.654)	(2.384)	(628.611)	(291.671)
154	330	(422)	69	17	(24)	2.054	27.851
(6.446)	(1.721)	(2.272)	(1.223)	(9.725)	(5.135)	(671.872)	(272.266)
(47.263)	88.478	(27.857)	95.958	(55.560)	100.093	(3.091.257)	2.086.036
0	0	(234)	(29)	0	0	(1.505)	27
0	0	(33)	0	(17)	0	(948)	33
(47.263)	88.478	(28.124)	95.929	(55.577)	100.093	(3.093.710)	2.086.096
\$ (47.263)	\$ 88.478	\$ (28.124)	\$ 95.929	\$ (55.577)	\$ 100.093	\$ (3.093.710)	\$ 2.086.096

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Inflation Strategy Fund		Low Average Duration Fund	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 1.362	\$ 943	\$ 16.449	\$ 14.942
Sonstige Erträge	0	0	1	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(247)	(572)	37.466	2.540
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(296)	(916)	(55.973)	14.679
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	85	80	(2.483)	(147)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(2.236)	2.652	(47.622)	27.837
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(1.632)	482	30.812	(16.650)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(15)	25	(288)	(108)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(2.979)	2.694	(21.638)	43.093
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(591)	(445)	(4.359)	(4.332)
Servicegebühr	0	0	(157)	(119)
Bestandspflegegebühr	0	0	(57)	(49)
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)	(1)	(1)
Gesamtaufwendungen	(592)	(446)	(4.574)	(4.501)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	129	101
Betriebskosten, netto	(592)	(446)	(4.445)	(4.400)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>(3.571)</b>	<b>2.248</b>	<b>(26.083)</b>	<b>38.693</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(65)	(20)	(327)	(42)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(33)	(37)	(2.079)	(2.785)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(2)	3	(232)	77
Summe Finanzierungskosten	(100)	(54)	(2.638)	(2.750)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>(3.671)</b>	<b>2.194</b>	<b>(28.721)</b>	<b>35.943</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(35)	(10)	(6)	0
Kapitalertragsteuer	0	(2)	(265)	(601)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>(3.706)</b>	<b>2.182</b>	<b>(28.992)</b>	<b>35.342</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ (3.706)</b>	<b>\$ 2.182</b>	<b>\$ (28.992)</b>	<b>\$ 35.342</b>

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

<sup>(1)</sup> Der Low Duration Income Fund wurde am 31. Mai 2018 aufgelegt.

Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund <sup>(1)</sup>		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		Mortgage Opportunities Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Berichtszeitraum vom 31. Mai 2018 bis 30. Jun. 2018		Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Berichtszeitraum vom 25. Jan. 2017 bis 30. Jun. 2017
\$ 9.321	\$ 4.523	\$ 71		\$ 3.342	\$ 1.074	\$ 41.210	\$ 2.134
(1.221)	0	0		0	0	1	0
(12.309)	1.399	28		1.806	503	(14.294)	859
(378)	12.977	(629)		(699)	(12.589)	(33.318)	2.735
(10.006)	90	52		2.068	(503)	387	131
(4.387)	3.469	805		2.788	(492)	(21.440)	123
44	9.058	(796)		(5.004)	7.528	(2.502)	3.565
(18.933)	(1.219)	(14)		4	(10)	370	(56)
(1.601)	30.297	(483)		4.305	(4.489)	(29.586)	9.491
0	(905)	(29)		(1.428)	(1.071)	(7.986)	(507)
0	0	0		(3)	0	(66)	(7)
0	0	0		0	0	(3)	0
(1.601)	0	0		0	0	(20)	0
0	(905)	(29)		(1.431)	(1.071)	(8.075)	(514)
(1.601)	0	0		0	0	0	0
(20.534)	(905)	(29)		(1.431)	(1.071)	(8.075)	(514)
(605)	29.392	(512)		2.874	(5.560)	(37.661)	8.977
	(258)	0		(33)	(7)	(4.202)	(21)
0	0	0		0	0	0	0
0	0	0		(3.586)	(4.483)	(8.809)	(421)
0	0	0		(741)	1.184	(216)	129
(605)	(258)	0		(4.360)	(3.306)	(13.227)	(313)
(21.139)	29.134	(512)		(1.486)	(8.866)	(50.888)	8.664
(18)	0	0		(647)	(164)	126	0
(2)	0	0		0	0	0	0
(21.159)	29.134	(512)		(2.133)	(9.030)	(50.762)	8.664
\$ (21.159)	\$ 29.134	\$ (512)		\$ (2.133)	\$ (9.030)	\$ (50.762)	\$ 8.664

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund		PIMCO RAE Fundamental Europe Fund	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 1.009	\$ 1.000	€ 511	€ 428
Sonstige Erträge	0	1	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	3.675	1.618	25	326
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	0	3	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	30	(251)	(4)	(2)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(9.172)	(685)	(1.103)	115
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	0	0	0	(2)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(3)	(24)	0	(1)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(4.361)	1.662	(571)	864
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(141)	(222)	(50)	(37)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(4)	(1)	(1)	0
Gesamtaufwendungen	(145)	(223)	(51)	(37)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(145)	(223)	(51)	(37)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	(4.506)	1.439	(622)	827
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	0	(9)	0	0
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	0	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	0	0	0
Summe Finanzierungskosten	0	(9)	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	(4.506)	1.430	(622)	827
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(115)	(115)	(42)	(43)
Kapitalertragsteuer	(34)	45	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	(4.655)	1.360	(664)	784
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit</b>	\$ (4.655)	\$ 1.360	€ (664)	€ 784

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

PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund		PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund		PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund		PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 1.380	\$ 925	\$ 967	\$ 758	\$ 5.605	\$ 7.323	\$ 1.690	\$ 1.453
0	0	0	0	0	0	0	0
4.529	393	860	(426)	398	(5.831)	1.069	(51)
0	(1)	1.294	7.724	2.982	61.745	950	8.318
(53)	50	(283)	4	(459)	(8)	143	(41)
(5.965)	2.268	(1.226)	1.715	(5.112)	20.485	(1.625)	4.703
0	0	(5.518)	(442)	(9.253)	(9.573)	(284)	(4.513)
(8)	4	0	8	(19)	50	(15)	(7)
(117)	3.639	(3.906)	9.341	(5.858)	74.191	1.928	9.862
(269)	(184)	(651)	(738)	(3.051)	(4.658)	(598)	(595)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(3)	0	0	0	0	0	0	0
(272)	(184)	(651)	(738)	(3.051)	(4.658)	(598)	(595)
0	0	12	1	62	28	18	19
(272)	(184)	(639)	(737)	(2.989)	(4.630)	(580)	(576)
(389)	3.455	(4.545)	8.604	(8.847)	69.561	1.348	9.286
0	(1)	(22)	(7)	(899)	(530)	(65)	(77)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	(80)	(595)	0	(1)
0	0	0	0	0	(32)	0	0
0	(1)	(22)	(7)	(979)	(1.157)	(65)	(78)
(389)	3.454	(4.567)	8.597	(9.826)	68.404	1.283	9.208
(215)	(148)	0	0	(519)	(128)	(523)	(87)
0	0	0	0	0	0	0	(4)
(604)	3.306	(4.567)	8.597	(10.345)	68.276	760	9.117
\$ (604)	\$ 3.306	\$ (4.567)	\$ 8.597	\$ (10.345)	\$ 68.276	\$ 760	\$ 9.117

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	PIMCO RAE Fundamental US Fund		Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 174	\$ 233	\$ 12.738	\$ 9.994
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	622	744	1.848	808
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	0	0	(12.332)	9.270
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(4)	(4)	44	(300)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(619)	(79)	(37.287)	14.429
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	0	0	(4.787)	3.578
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	0	(6)	(129)	14
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	173	888	(39.905)	37.793
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(33)	(41)	(2.398)	(1.775)
Servicegebühr	0	0	(4)	(3)
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	0	0	0
Gesamtaufwendungen	(34)	(41)	(2.402)	(1.778)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	22	3
Betriebskosten, netto	(34)	(41)	(2.380)	(1.775)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	139	847	(42.285)	36.018
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	0	0	(9)	(3)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	(1.828)	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	0	370	0
Summe Finanzierungskosten	0	0	(1.467)	(3)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	139	847	(43.752)	36.015
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(49)	(67)	0	(23)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	(11)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	90	780	(43.752)	35.981
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit</b>	\$ 90	\$ 780	\$ (43.752)	\$ 35.981

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

StocksPLUS™ Fund		Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 19.084	\$ 10.005	\$ 15.605	\$ 8.360	\$ 93.719	\$ 88.422	\$ 1.477	\$ 1.243
0	11	0	0	0	0	0	0
28.154	(5.916)	9.624	2.200	(1.373)	71.122	756	(186)
11.663	121.335	(30.034)	24.456	(119.827)	38.616	(7.598)	8.737
(954)	2.582	(867)	(184)	(5.776)	(1.275)	(226)	(200)
(22.779)	17.575	(32.194)	15.987	(187.102)	136.866	(358)	1.880
(14.953)	(21.413)	(2.796)	5.937	22.252	44.062	(651)	(2.380)
(71)	(129)	(72)	(61)	(874)	933	(56)	117
20.144	124.050	(40.734)	56.695	(198.981)	378.746	(6.656)	9.211
(5.665)	(4.071)	(5.205)	(2.570)	(25.423)	(26.309)	(973)	(957)
(30)	(22)	0	0	(1.216)	(1.181)	(1)	(1)
0	0	0	0	(709)	(894)	0	0
(2)	(1)	(72)	(10)	(19)	(10)	(3)	0
(5.697)	(4.094)	(5.277)	(2.580)	(27.367)	(28.394)	(977)	(958)
0	0	0	0	574	581	20	15
(5.697)	(4.094)	(5.277)	(2.580)	(26.793)	(27.813)	(957)	(943)
14.447	119.956	(46.011)	54.115	(225.774)	350.933	(7.613)	8.268
(357)	(55)	(129)	(62)	(9.460)	(5.430)	(45)	(69)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	(160)	(2.375)	(1.056)	(9.822)	(8.808)	(30)	(43)
(107)	(1)	77	88	38	(149)	(10)	(2)
(464)	(216)	(2.427)	(1.030)	(19.244)	(14.387)	(85)	(114)
13.983	119.740	(48.438)	53.085	(245.018)	336.546	(7.698)	8.154
(38)	101	(735)	(414)	(54)	0	(1)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
13.945	119.841	(49.173)	52.671	(245.072)	336.546	(7.699)	8.154
\$ 13.945	\$ 119.841	\$ (49.173)	\$ 52.671	\$ (245.072)	\$ 336.546	\$ (7.699)	\$ 8.154

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	£ 6.098	£ 5.355	£ 8.061	£ 9.072
Sonstige Erträge	0	1	0	1
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	977	5.968	3.011	12.212
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	44	2.899	1.858	5.024
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	116	197	(165)	29
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(13.727)	(2.569)	(19.630)	(6.381)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(688)	(2.093)	(1.458)	(2.830)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(351)	171	18	(30)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(7.531)	9.929	(8.305)	17.097
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(874)	(791)	(966)	(1.052)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	0	0
Gesamtaufwendungen	(874)	(791)	(966)	(1.052)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	77	15	28	22
Betriebskosten, netto	(797)	(776)	(938)	(1.030)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	(8.328)	9.153	(9.243)	16.067
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(97)	(107)	(290)	(272)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(1.889)	(691)	(1.458)	(1.816)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(3)	253	298	(242)
Summe Finanzierungskosten	(1.989)	(545)	(1.450)	(2.330)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	(10.317)	8.608	(10.693)	13.737
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(1)	0	(1)	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinn/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	(10.318)	8.608	(10.694)	13.737
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit</b>	£ (10.318)	£ 8.608	£ (10.694)	£ 13.737

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

Unconstrained Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 46.181	\$ 44.488	\$ 87.220	\$ 76.729	\$ 3.370	\$ 2.260	\$ 22.043	\$ 9.035
0	0	0	0	0	4	0	0
(12.743)	8.296	8.152	6.769	(1.825)	(529)	769	(59)
11.254	111.777	(20.260)	47.001	(709)	4.053	(11.949)	4.051
(1.510)	(866)	(198)	(719)	(37)	(65)	(241)	(319)
(36.519)	34.092	(90.887)	50.468	(6.244)	4.341	(6.962)	6.380
(39.412)	(10.979)	(10.657)	20.387	(1.950)	1.715	1.033	(2.493)
1.674	312	(42)	37	16	28	(35)	114
(31.075)	187.120	(26.672)	200.672	(7.379)	11.807	4.658	16.709
(12.609)	(14.689)	(9.225)	(8.637)	(423)	(322)	(2.525)	(1.010)
(91)	(116)	(382)	(325)	0	0	(52)	(38)
(201)	(200)	0	0	0	0	0	0
(2)	0	(2)	(53)	(4)	0	(1)	(1)
(12.903)	(15.005)	(9.609)	(9.015)	(427)	(322)	(2.578)	(1.049)
234	237	0	0	0	0	68	0
(12.669)	(14.768)	(9.609)	(9.015)	(427)	(322)	(2.510)	(1.049)
(43.744)	172.352	(36.281)	191.657	(7.806)	11.485	2.148	15.660
(3.756)	(1.155)	(158)	(27)	(183)	(69)	(473)	(274)
0	0	(416)	(174)	0	0	0	0
(2.285)	(3.240)	(19.204)	(17.125)	(2.114)	(2.154)	(8.518)	(4.315)
46	66	150	2.604	42	(55)	141	(2)
(5.995)	(4.329)	(19.628)	(14.722)	(2.255)	(2.278)	(8.850)	(4.591)
(49.739)	168.023	(55.909)	176.935	(10.061)	9.207	(6.702)	11.069
(72)	(6)	(148)	0	(3)	0	1	(61)
(1)	0	0	0	0	0	(2)	0
(49.812)	168.017	(56.057)	176.935	(10.064)	9.207	(6.703)	11.008
\$ (49.812)	\$ 168.017	\$ (56.057)	\$ 176.935	\$ (10.064)	\$ 9.207	\$ (6.703)	\$ 11.008

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Summe der Gesellschaft*	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum**
<b>Erträge</b>		
Zins- und Dividenderträge	\$ 2.944.753	\$ 1.926.334
Sonstige Erträge	260	527
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	507.378	155.167
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(1.948.354)	2.818.473
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(327.776)	(56.625)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(5.259.614)	3.636.698
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(884.394)	170.507
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	134.472	(115.865)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(4.833.275)	8.535.216
<b>Betriebskosten</b>		
Verwaltungsgebühr	(715.865)	(472.139)
Servicegebühr	(11.406)	(6.794)
Bestandspflegegebühr	(19.457)	(10.933)
Sonstige Aufwendungen	(2.951)	(1.186)
Gesamtaufwendungen	(749.679)	(491.052)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	5.380	3.077
Betriebskosten, netto	(744.299)	(487.975)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>(5.577.574)</b>	<b>8.047.241</b>
<b>Finanzierungskosten</b>		
Zinsaufwendungen	(105.122)	(34.541)
Aufwand für Kreditfazilitäten	(1.276)	(488)
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(1.071.897)	(706.731)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(8.124)	63.366
Summe Finanzierungskosten	(1.186.419)	(678.394)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>	<b>(6.763.993)</b>	<b>7.368.847</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(8.134)	(7.266)
Kapitalertragsteuer	(997)	(1.974)
<b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>	<b>(6.773.124)</b>	<b>7.359.607</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ (6.773.124)</b>	<b>\$ 7.359.607</b>

\* Die Summe der Gesellschaft für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2018 wurde bereinigt, um den Überkreuzinvestitionen des Global Multi-Asset Fund in den Global Advantage Real Return Fund und den Income Fund Rechnung zu tragen. Der Betrag wurde ferner bereinigt, um Überkreuzinvestitionen des Diversified Income Fund, des Diversified Income Duration Hedged Fund, des Global Bond Fund, des Low Average Duration Fund, des Total Return Bond Fund, des Unconstrained Bond Fund und des US High Yield Bond Fund in den US Short-Term Fund zu berücksichtigen. Darüber hinaus wurde der Betrag bereinigt, um Überkreuzinvestitionen des Dynamic Multi-Asset Fund in den Income Fund und den Mortgage Opportunities Fund sowie Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen.

\*\* Die Summe der Gesellschaft für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2017 wurde nicht angepasst, um die Schließung des Euro Real Return Fund, des Euro Ultra-Long Duration Fund und des UK Low Duration Fund zu berücksichtigen.

---

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

## Ausweis der Nettovermögensänderungen

(Angaben in Tausend)	PIMCO Capital Securities Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Absolute Return Fund	
	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017
	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum				
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 8.731.253	\$ 5.410.259	\$ 518.533	\$ 433.637	\$ 288.667	\$ 290.967
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	1.938.219	3.163.791	199.710	177.385	23.199	54.256
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4.073	6.785	0	0	84	175
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(2.435.535)	(1.330.484)	(73.538)	(134.399)	(121.341)	(120.795)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit	(495.059)	562.697	(6.182)	(19.350)	(7.627)	23.860
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 7.742.951	\$ 7.813.048	\$ 638.523	\$ 457.273	\$ 182.982	\$ 248.463
	Emerging Local Bond Fund		Emerging Markets 2018 Fund		Emerging Markets Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017
	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum				
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 3.008.766	\$ 2.225.792	\$ 73.238	\$ 66.804	\$ 3.324.965	\$ 2.599.611
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	762.334	554.015	40.257	8.056	737.887	875.045
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.992	1.715	0	0	1.256	2.027
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(1.178.264)	(171.076)	(45.953)	(2.323)	(1.168.589)	(584.301)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit	(238.638)	211.369	(1.266)	2.809	(251.365)	256.924
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.356.190	\$ 2.821.815	\$ 66.276	\$ 75.346	\$ 2.644.154	\$ 3.149.306
	Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Low Duration Fund	
	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017
	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum				
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	€ 1.046.201	€ 736.637	€ 254.382	€ 338.449	€ 434.279	€ 76.326
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	582.228	210.331	28.666	38.939	404.067	6.210
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	30	78	0	0	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(198.084)	(166.808)	(56.602)	(49.706)	(158.415)	(27.547)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit	(22.272)	9.634	8.153	(3.406)	(3.952)	183
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	€ 1.408.103	€ 789.872	€ 234.599	€ 324.276	€ 675.979	€ 55.172

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

Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund		Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Asia Bond Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 7.918.902	\$ 5.875.038	\$ 1.258.972	\$ 1.298.408	€ 1.033.781	€ 436.861	\$ 39.966	\$ 51.319
673.157	1.432.717	330.183	300.042	355.933	155.347	3.753	3.049
4.513	6.474	374	121	15	43	9	12
(1.155.814)	(805.298)	(206.593)	(505.974)	(206.376)	(52.844)	(6.054)	(12.466)
0	0	0	0	0	0	0	0
(441.750)	579.989	(59.698)	108.568	(18.187)	14.483	(1.817)	561
\$ 6.999.008	\$ 7.088.920	\$ 1.323.238	\$ 1.201.165	€ 1.165.166	€ 553.890	\$ 35.857	\$ 42.475
Emerging Markets Corporate Bond Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 233.998	\$ 236.470	\$ 44.882	\$ 38.275	€ 1.264.884	€ 1.223.748	€ 774.565	€ 437.297
21.033	64.059	21.691	10.602	358.153	275.632	160.142	322.707
95	99	7	1	1	2	76	281
(42.740)	(105.882)	(6.883)	(8.499)	(150.685)	(367.860)	(237.562)	(108.421)
0	0	0	0	0	0	0	0
(13.036)	22.559	(2.824)	2.845	8.217	119	(1.084)	2.701
\$ 199.350	\$ 217.305	\$ 56.873	\$ 43.224	€ 1.480.570	€ 1.131.641	€ 696.137	€ 654.565
Euro Short-Term Fund		Global Advantage Fund		Global Advantage Real Return Fund		Global Bond ESG Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Berichtszeitraum vom 12. Jan. 2017 bis 30. Jun. 2017
€ 1.458.614	€ 1.518.400	\$ 789.081	\$ 724.172	\$ 126.444	\$ 196.580	\$ 286.096	\$ 0
173.710	584.754	26.470	32.498	2.184	22.157	173.137	135.299
88	275	1.124	988	298	608	254	63
(560.973)	(542.735)	(41.922)	(32.488)	(21.012)	(68.160)	(5.529)	(1.680)
0	0	0	0	0	0	0	0
(12.690)	(3.736)	(28.228)	59.656	(6.475)	16.608	(12.996)	4.507
€ 1.058.749	€ 1.556.958	\$ 746.525	\$ 784.826	\$ 101.439	\$ 167.793	\$ 440.962	\$ 138.189

## Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global Bond Fund		Global Bond Ex-US Fund		Global High Yield Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 10.419.008	\$ 8.532.444	\$ 931.240	\$ 800.872	\$ 5.349.958	\$ 4.893.852
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	2.172.038	1.785.457	198.089	247.016	1.108.877	2.225.765
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.610	3.888	385	339	3.297	3.671
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(1.785.508)	(1.323.717)	(143.258)	(140.716)	(2.259.860)	(1.717.324)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit	(219.502)	457.197	11.079	13.070	(173.650)	421.051
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 10.588.646	\$ 9.455.269	\$ 997.535	\$ 920.581	\$ 4.028.622	\$ 5.827.015

  

	Global Real Return Fund		Income Fund		Inflation Strategy Fund	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.197.667	\$ 2.424.998	\$ 72.274.750	\$ 21.220.021	\$ 89.502	\$ 62.437
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	736.894	751.921	21.266.193	24.797.840	22.047	34.148
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	772	572	28.967	16.238	0	1
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(651.357)	(1.035.850)	(24.875.639)	(4.191.494)	(17.609)	(17.766)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit	(55.577)	100.093	(3.093.710)	2.086.096	(3.706)	2.182
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.228.399	\$ 2.241.734	\$ 65.600.561	\$ 43.928.701	\$ 90.234	\$ 81.002

  

	Mortgage Opportunities Fund		PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund		PIMCO RAE Fundamental Europe Fund	
	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Berichtszeitraum vom 25. Jan. 2017 bis 30. Jun. 2017	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 1.484.592	\$ 0	\$ 82.721	\$ 13.554	€ 13.813	€ 12.572
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	1.427.945	460.840	16.583	71.741	7.098	9.763
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.518	265	0	0	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(495.770)	(14.317)	(29.192)	(19.323)	(2.883)	(5.154)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit	(50.762)	8.664	(4.655)	1.360	(664)	784
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 2.367.523	\$ 455.452	\$ 65.457	\$ 67.332	€ 17.364	€ 17.965

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

Global Investment Grade Credit Fund		Global Libor Plus Bond Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Multi-Asset Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 20.741.806	\$ 15.577.640	\$ 540.876	\$ 12.914	\$ 2.197.467	\$ 1.116.635	\$ 1.066.739	\$ 1.106.633
4.459.202	4.815.072	331.209	38.751	553.293	1.486.891	124.541	31.800
9.647	9.461	120	0	99	159	13	13
(5.310.951)	(2.912.793)	(177.492)	(11.503)	(1.146.412)	(576.644)	(136.249)	(249.705)
0	0	0	0	0	0	0	0
(909.994)	1.147.116	(26.853)	964	(47.263)	88.478	(28.124)	95.929
\$ 18.989.710	\$ 18.636.496	\$ 667.860	\$ 41.126	\$ 1.557.184	\$ 2.115.519	\$ 1.026.920	\$ 984.670
Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund <sup>(1)</sup>		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Berichtszeitraum vom 31. Mai 2018 bis 30. Jun. 2018		Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 1.733.028	\$ 1.528.812	\$ 628.973	\$ 237.565			\$ 0	\$ 379.335
429.941	545.693	81.480	419.492			356.630	266.450
1.503	1.303	0	0			0	249
(707.197)	(508.394)	(131.147)	(41.705)			0	(383.875)
0	0	0	0			0	0
(28.992)	35.342	(21.159)	29.134			(512)	(2.133)
\$ 1.428.283	\$ 1.602.756	\$ 558.147	\$ 644.486			\$ 356.118	\$ 260.026
\$ 332.404							
PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund		PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund		PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund		PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 103.100	\$ 29.614	\$ 83.679	\$ 60.943	\$ 421.968	\$ 547.973	\$ 149.038	\$ 185.731
12.695	33.791	27.355	35.473	28.554	176.585	14.624	23.451
0	0	0	0	80	591	0	0
(43.565)	(3.076)	(56.070)	(25.868)	(189.395)	(251.330)	(37.299)	(90.691)
0	0	0	0	0	0	0	0
(604)	3.306	(4.567)	8.597	(10.345)	68.276	760	9.117
\$ 71.626	\$ 63.635	\$ 50.397	\$ 79.145	\$ 250.902	\$ 542.095	\$ 127.123	\$ 127.608

<sup>(1)</sup> Der Low Duration Income Fund wurde am 31. Mai 2018 aufgelegt.

## Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO RAE Fundamental US Fund		Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund		StocksPLUS™ Fund	
	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017
	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	\$ 14.083	\$ 20.352	\$ 511.888	\$ 355.768	\$ 1.695.478	\$ 1.070.441
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	1.099	1.309	128.600	74.426	982.101	664.669
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	1.828	0	0	120
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(1.466)	(5.125)	(52.283)	(36.551)	(701.382)	(336.278)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit	90	780	(43.752)	35.981	13.945	119.841
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	\$ 13.806	\$ 17.316	\$ 546.281	\$ 429.624	\$ 1.990.142	\$ 1.518.793
	UK Long Term Corporate Bond Fund		Unconstrained Bond Fund		US High Yield Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017	Am 30. Jun. 2018	Am 30. Jun. 2017
	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum	abgeschlossener Berichtszeitraum
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	£ 434.641	£ 462.914	\$ 2.525.901	\$ 2.272.628	\$ 3.014.320	\$ 2.655.336
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	86.855	40.866	562.066	1.331.147	586.018	731.987
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	989	661	5.324	6.241
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(84.726)	(93.918)	(694.251)	(550.584)	(766.732)	(863.529)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der laufenden Geschäftstätigkeit	(10.694)	13.737	(49.812)	168.017	(56.057)	176.935
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	£ 426.076	£ 423.599	\$ 2.344.893	\$ 3.221.869	\$ 2.782.873	\$ 2.706.970

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

\* Die Summe der Gesellschaft für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2018 wurde bereinigt, um den Überkreuzinvestitionen des Global Multi-Asset Fund in den Global Advantage Real Return Fund und den Income Fund Rechnung zu tragen. Der Betrag wurde ferner bereinigt, um Überkreuzinvestitionen des Diversified Income Fund, des Diversified Income Duration Hedged Fund, des Global Bond Fund, des Low Average Duration Fund, des Total Return Bond Fund, des Unconstrained Bond Fund und des US High Yield Bond Fund in den US Short-Term Fund zu berücksichtigen. Darüber hinaus wurde der Betrag bereinigt, um Überkreuzinvestitionen des Dynamic Multi-Asset Fund in den Income Fund und den Mortgage Opportunities Fund sowie Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen.

\*\* Die Summe der Gesellschaft zum 30. Juni 2017 wurde nicht angepasst, um die Schließung des Euro Real Return Fund, des Euro Ultra-Long Duration Fund und des UK Low Duration Fund zu berücksichtigen.

Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund	
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 785.534	\$ 389.129	\$ 6.394.519	\$ 6.148.083	\$ 134.029	\$ 136.049	£ 480.675	£ 298.523
248.227	171.404	690.345	763.823	31.195	15.258	44.575	141.753
11	4	3.612	4.085	25	41	0	0
(64.678)	(50.591)	(1.109.100)	(1.155.993)	(34.754)	(33.173)	(80.632)	(13.488)
0	0	0	0	0	0	0	0
(49.173)	52.671	(245.072)	336.546	(7.699)	8.154	(10.318)	8.608
\$ 919.921	\$ 562.617	\$ 5.734.304	\$ 6.096.544	\$ 122.796	\$ 126.329	£ 434.300	£ 435.396
US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*			
Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum**		
\$ 159.790	\$ 136.046	\$ 1.372.039	\$ 652.542	\$ 172.099.099	\$ 97.391.528		
52.336	19.963	856.767	331.915	45.267.652	51.098.617		
35	1	8.518	4.315	83.935	67.584		
(24.379)	(41.680)	(391.470)	(106.818)	(51.020.192)	(21.880.713)		
0	0	0	0	(250.646)	483.032		
(10.064)	9.207	(6.703)	11.008	(6.773.124)	7.359.607		
\$ 177.718	\$ 123.537	\$ 1.839.151	\$ 892.962	\$ 159.406.724	\$ 134.519.655		



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
3,650 % fällig am 16.03.2025	\$ 10.000	\$ 9.387	0,12	8,000 % fällig am 10.08.2025 (c)(d)	1.100	1.158	0,01	Freedom Mortgage Corp.			
4,337 % fällig am 10.01.2028	6.700	6.376	0,08	8,625 % fällig am 15.08.2021 (c)(d)	35.278	37.580	0,49	8,250 % fällig am 15.04.2025	\$ 1.350	\$ 1.326	0,02
4,375 % fällig am 12.01.2026 (e)	15.000	14.606	0,19	Santander UK Group Holdings PLC				Goldman Sachs Group, Inc.			
4,972 % fällig am 16.05.2029	3.200	3.176	0,04	3,823 % fällig am 03.11.2028	6.200	5.703	0,07	2,908 % fällig am 05.06.2023 (e)	28.000	27.047	0,35
5,875 % fällig am 15.09.2024 (c)(d)	€ 45.700	57.506	0,74					3,000 % fällig am 26.04.2022 (e)	25.000	24.436	0,32
6,500 % fällig am 15.09.2019 (c)(d)	€ 13.958	16.812	0,22	6,750 % fällig am 24.06.2024 (c)(d)	€ 44.000	60.156	0,78	3,691 % fällig am 05.06.2028 (e)	21.000	19.930	0,26
7,000 % fällig am 15.09.2019 (c)(d)	€ 15.400	20.815	0,27	7,375 % fällig am 24.06.2022 (c)(d)	101.550	139.870	1,81	3,750 % fällig am 22.05.2025	10.000	9.758	0,13
7,250 % fällig am 15.03.2023 (c)(d)	23.711	32.210	0,42	Santander UK PLC				3,850 % fällig am 26.01.2027 (e)	20.000	19.227	0,25
7,875 % fällig am 15.09.2022 (c)(d)	15.200	21.336	0,28	2,125 % fällig am 03.11.2020 (e)	\$ 24.200	23.501	0,30	JPMorgan Chase & Co.			
8,000 % fällig am 15.12.2020 (c)(d)	€ 32.755	42.450	0,55	Standard Chartered PLC				2,350 % fällig am 28.01.2019	6.600	6.590	0,09
HSBC Bank PLC				7,750 % fällig am 02.04.2023 (c)(d)	32.500	33.394	0,43	2,776 % fällig am 25.04.2023 (e)	36.900	35.791	0,46
2,750 % fällig am 28.09.2018 (c)	\$ 3.500	2.701	0,03	TP ICAP PLC				3,220 % fällig am 01.03.2025 (e)	66.000	63.721	0,82
2,813 % fällig am 31.12.2018 (c)	28.930	22.343	0,29	5,250 % fällig am 26.01.2024	€ 2.400	3.266	0,04	6,100 % fällig am 01.10.2024 (c)	14.800	15.301	0,20
HSBC Holdings PLC				Virgin Money Holdings UK PLC				MetLife, Inc.			
3,326 % fällig am 18.05.2024	2.300	2.295	0,03	8,750 % fällig am 10.11.2021 (c)(d)	20.185	27.815	0,36	9,250 % fällig am 08.04.2038	11.500	15.640	0,20
4,583 % fällig am 19.06.2029	8.300	8.393	0,11					Morgan Stanley			
4,750 % fällig am 04.07.2029 (c)(d)	€ 82.100	94.756	1,22					2,750 % fällig am 19.05.2022 (e)	40.000	38.771	0,50
6,000 % fällig am 29.09.2023 (c)(d)	157.305	206.042	2,66					Quicken Loans, Inc.			
6,000 % fällig am 22.05.2027 (c)(d)	\$ 4.400	4.092	0,05					5,250 % fällig am 15.01.2028	14.000	12.965	0,17
6,250 % fällig am 23.03.2023 (c)(d)	35.400	34.781	0,45	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				RBS Capital Trust			
6,500 % fällig am 23.03.2028 (c)(d)	36.200	34.797	0,45	National Westminster Bank PLC				6,425 % fällig am 03.01.2034 (c)	39.146	46.682	0,60
Lloyds Bank PLC				9,000 % (c)	500.000	1.031	0,01	Springleaf Finance Corp.			
2,301 % fällig am 29.08.2018 (c)	4.900	4.023	0,05	Summe Großbritannien		2.167.724	28,00	5,625 % fällig am 15.03.2023	16.900	16.853	0,22
2,853 % fällig am 07.05.2021	1.500	1.503	0,02					6,875 % fällig am 15.03.2025	1.100	1.095	0,01
3,300 % fällig am 07.05.2021	9.900	9.886	0,13	<b>USA</b>				7,125 % fällig am 15.03.2026	26.000	25.935	0,33
Lloyds Banking Group PLC				<b>STAMMAKTIE</b>				Wand Merger Corp.			
3,130 % fällig am 21.06.2021	1.500	1.500	0,02	<b>FINANZWERTE</b>				8,125 % fällig am 15.07.2023 (a)	4.000	4.070	0,05
3,574 % fällig am 07.11.2028 (e)	17.000	15.715	0,20	Bank of America Corp.	1.396.400	39.364	0,51	Wells Fargo & Co.			
6,375 % fällig am 27.06.2020 (c)(d)	€ 1.800	2.241	0,03	Morgan Stanley	808.770	38.336	0,50	1,500 % fällig am 24.05.2027	€ 2.600	3.021	0,04
6,413 % fällig am 01.10.2035 (c)	\$ 10.500	11.104	0,14	Wells Fargo & Co.	688.312	38.160	0,49	3,000 % fällig am 22.04.2026 (e)	\$ 60.000	55.680	0,72
6,657 % fällig am 21.05.2037 (c)	7.987	8.548	0,11					3,000 % fällig am 23.10.2026	12.300	11.369	0,15
7,000 % fällig am 27.06.2019 (c)(d)	€ 78.673	106.055	1,37			115.860	1,50	3,069 % fällig am 24.01.2023 (e)	84.400	82.125	1,06
7,625 % fällig am 27.06.2023 (c)(d)	200.018	289.375	3,74					5,900 % fällig am 15.06.2024 (c)	29.303	29.450	0,38
7,875 % fällig am 27.06.2029 (c)(d)	65.813	101.118	1,31								
National Westminster Bank PLC				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
1,822 % fällig am 05.10.2018 (c)	€ 10.357	12.039	0,16	Abbey National Capital Trust				<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>			
2,250 % fällig am 11.01.2019 (c)	\$ 22.180	18.132	0,23	8,963 % fällig am 30.06.2030 (c)	\$ 541	735	0,01	State Street Corp.			
2,500 % fällig am 14.08.2018 (c)	9.440	7.717	0,10	Ally Financial, Inc.	100	120	0,00	5,350 % fällig am 15.03.2026 (c)	114.434	2.989	0,04
2,563 % fällig am 28.08.2018 (c)	14.000	11.533	0,15	American International Group, Inc.				Summe USA		1.028.994	13,29
Nationwide Building Society				5,750 % fällig am 01.04.2048	25.800	25.477	0,33				
4,302 % fällig am 08.03.2029	€ 17.200	16.593	0,21	Bank of America Corp.				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
10,250 % (c)	€ 867	174.303	2,25	2,881 % fällig am 24.04.2023 (e)	21.600	20.993	0,27	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (f)</b>			
Prudential PLC				3,124 % fällig am 20.01.2023 (e)	95.600	94.068	1,21				
5,000 % fällig am 20.07.2055	6.400	8.552	0,11	5,875 % fällig am 15.03.2028 (c)	73.822	72.253	0,93			1.437.200	18,56
Royal Bank of Scotland Group PLC				CIT Group, Inc.	2.200	2.209	0,03	Summe kurzfristige Instrumente		1.437.200	18,56
1,750 % fällig am 02.03.2026	€ 11.200	12.896	0,17	3,875 % fällig am 19.02.2019	100	100	0,00	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt		\$ 8.529.735	110,16
4,519 % fällig am 25.06.2024	\$ 1.200	1.202	0,02	4,125 % fällig am 09.03.2021							
4,654 % fällig am 30.09.2027 (c)	27.200	26.146	0,34	Citigroup, Inc.							
4,800 % fällig am 05.04.2026 (e)	56.500	56.909	0,73	3,887 % fällig am 10.01.2028 (e)	26.732	25.919	0,33				
4,892 % fällig am 18.05.2029	14.000	13.965	0,18	DAE Funding LLC							
6,000 % fällig am 19.12.2023	27.300	28.681	0,37	4,500 % fällig am 01.08.2022	100	97	0,00				
7,500 % fällig am 10.08.2020 (c)(d)	34.950	35.719	0,46	5,000 % fällig am 01.08.2024	300	289	0,00				
7,648 % fällig am 30.09.2031 (c)	28.819	36.240	0,47	Dresdner Funding Trust							
				8,151 % fällig am 30.06.2031	74.895	93.616	1,21				
				Exeter Finance Corp.							
				9,750 % fällig am 20.05.2019	7.500	7.486	0,10				

## 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-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	249	\$ (846)	(0,01)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	2.765	(10.428)	(0,14)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	718	426	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09/2018	555	1.457	0,02
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	301	(572)	(0,01)
				\$ (9.963)	(0,13)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (9.963)	(0,13)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Capital Securities 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 – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	(1,000) %	20.06.2023	€ 150.000	\$ 791	0,01
Credit Agricole S.A.	(1,000)	20.06.2023	130.000	364	0,00
Societe Generale S.A.	(1,000)	20.06.2023	150.000	(330)	0,00
				\$ 825	0,01

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Crossover 29 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2023	€ 300.000	\$ 2.898	0,04

### 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.HY-30 5-Year Index	5,000 %	20.06.2023	\$ 100.000	\$ 502	0,01

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500 %	19.12.2023	€ 178.600	\$ (1.787)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	219.600	3.527	0,04
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.09.2048	54.900	(502)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	£ 127.400	(599)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	47.000	661	0,01
					\$ 1.300	0,01
					\$ 5.525	0,07

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (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>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Banco BPM SpA	5,000 %	20.12.2022	€ 5.000	\$ 301	\$ (494)	\$ (193)	0,00
BPS	Banco BPM SpA	5,000	20.12.2022	15.000	880	(1.461)	(581)	(0,01)
	Banco BPM SpA	5,000	20.06.2023	18.900	(1.230)	274	(956)	(0,01)
	Intesa Sanpaolo	1,000	20.06.2023	31.700	(3.942)	(198)	(4.140)	(0,05)
GST	UniCredit SpA	1,000	20.06.2023	7.000	(1.083)	218	(865)	(0,01)
JPM	Banco BPM SpA	5,000	20.12.2022	10.000	585	(972)	(387)	(0,01)
	Banco BPM SpA	5,000	20.06.2023	5.000	(354)	101	(253)	0,00
	Intesa Sanpaolo	1,000	20.06.2023	9.500	(1.163)	(77)	(1.240)	(0,02)
					\$ (6.006)	\$ (2.609)	\$ (8.615)	(0,11)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	BNP FP Dividend SWAP	1	3,14%	€ 405	17.12.2021	\$ 0	\$ (12)	\$ (12)	0,00
	Erhalt	BNP FP Dividend Swap	1	3,13%	3.083	17.12.2021	0	(79)	(79)	0,00
	Erhalt	BNP FP Dividend Swap	k. A.	13,06%	1.530	17.12.2021	0	1	1	0,00
DUB	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month EUR-LIBOR	10.000	20.12.2018	8	(389)	(381)	(0,01)
GST	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month EUR-LIBOR	20.000	20.12.2018	18	(836)	(818)	(0,01)
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month EUR-LIBOR	100.000	20.12.2018	29	(5.792)	(5.763)	(0,07)
JPM	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month EUR-LIBOR	20.000	20.12.2018	9	(1.452)	(1.443)	(0,02)
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month EUR-LIBOR	20.000	20.03.2019	17	(1.106)	(1.089)	(0,01)
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month EUR-LIBOR	25.000	20.03.2019	21	(1.372)	(1.351)	(0,02)
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month EUR-LIBOR	30.000	20.03.2019	8	(1.745)	(1.737)	(0,02)
							\$ 110	\$ (12.782)	\$ (12.672)	(0,16)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07/2018	€	2.323.391	\$ 2.720.536	\$ 7.859	\$ 7.859	0,10
	07/2018	\$	269.594	€ 233.208	2.731	(43)	2.688
	08/2018	€	217.602	\$ 251.884	0	(2.729)	(0,03)
BPS	09/2018	SGD	1.540	€ 1.160	28	0	28
	07/2018	€	122	€ 143	1	0	1
BRC	07/2018	£	1.072	€ 1.403	0	(12)	(12)
	07/2018	\$	1.353.652	£ 1.034.882	12.866	(214)	12.652
CBK	08/2018	£	1.021.699	\$ 1.337.894	0	(12.833)	(12.833)
	07/2018	€	3.318	€ 3.835	0	(39)	(39)
	07/2018	£	24.894	€ 33.010	143	0	143
GLM	07/2018	\$	28.616	€ 24.171	0	(396)	(396)
	07/2018	€	216.580	\$ 253.172	506	(202)	304
	07/2018	\$	146.546	€ 125.247	9	(323)	(314)
HUS	07/2018	£	29.793	€ 22.313	0	(335)	(335)
	07/2018	£	4.010	\$ 5.303	12	(2)	10
	07/2018	\$	2.583.500	€ 2.236.794	28.069	0	28.069
JPM	07/2018	€	61	€ 46	0	0	0
	08/2018	€	2.235.945	\$ 2.588.218	0	(28.027)	(28.027)
	07/2018	CAD	1.634	€ 1.261	19	0	19
MSB	07/2018	€	55.877	€ 65.642	403	0	403
	07/2018	\$	8.479	€ 7.217	0	(53)	(53)
	07/2018	£	4.706	€ 3.536	0	(38)	(38)
SCX	07/2018	€	26.504	\$ 31.111	167	0	167
	07/2018	£	1.136.005	€ 1.510.190	10.378	0	10.378
SOG	07/2018	\$	12.123	€ 9.145	4	(53)	(49)
	07/2018	€	693	SEK 6.170	0	(3)	(3)
	08/2018	SEK	6.170	\$ 694	3	0	3
	07/2018	\$	6.170	€ 693	3	0	3
	09/2018	\$	575	HKD 4.504	0	0	0
				\$ 63.201	\$ (45.302)	\$ 17.899	0,23

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen für die Investor AUD (Hedged) Class und die Class Z AUD (Hedged) 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	07/2018	\$	12.914	AUD 17.158	\$ 0	\$ (236)	0,00
BOA	07/2018	AUD	18.011	\$ 13.296	0	(12)	0,00
	08/2018	\$	13.297	AUD 18.011	12	0	12
BRC	07/2018		330	AUD 435	0	(9)	0,00
GLM	07/2018	AUD	18.034	\$ 13.246	0	(78)	(78)
	07/2018	\$	12.836	AUD 17.076	0	(220)	(220)
	08/2018		13.248	AUD 18.034	78	0	78
HUS	07/2018	AUD	451	\$ 337	4	0	4
	07/2018	\$	440	AUD 579	1	(13)	(12)
JPM	07/2018		13.309	17.552	0	(341)	(341)
MSB	07/2018		982	1.295	0	(25)	(25)
RBC	07/2018		88	120	0	0	0
RYL	07/2018		1.135	1.492	0	(32)	(32)
SCX	07/2018		70	95	0	0	0
SSB	07/2018		116	155	0	(1)	(1)
TOR	07/2018	AUD	1.207	\$ 909	17	0	17
	07/2018	\$	84	AUD 114	0	0	0
				\$ 112	\$ (967)	\$ (855)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2018 standen für die thesaurierenden Anteile der Institutional BRL (Hedged) Class 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	07/2018	BRL 921	\$ 242	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07/2018	\$ 1.031	BRL 3.780	0	(48)	(48)	0,00
	08/2018	241	921	0	(2)	(2)	0,00
BPS	07/2018	BRL 2.690	\$ 723	24	0	24	0,00
	08/2018	\$ 721	BRL 2.690	0	(24)	(24)	0,00
BSH	07/2018	BRL 2.517	\$ 676	21	0	21	0,00
	07/2018	\$ 1.069	BRL 4.011	0	(26)	(26)	0,00
	08/2018	673	2.517	0	(22)	(22)	0,00
CBK	07/2018	BRL 7.574	\$ 1.997	28	0	28	0,00
	07/2018	\$ 53	BRL 201	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	1.825	6.950	0	(25)	(25)	0,00
FBF	07/2018	BRL 9.053	\$ 2.395	42	0	42	0,00
	08/2018	\$ 2.388	BRL 9.053	0	(44)	(44)	0,00
GLM	07/2018	659	2.475	0	(16)	(16)	0,00
HUS	07/2018	BRL 2.415	\$ 646	19	0	19	0,00
	07/2018	\$ 581	BRL 2.165	0	(19)	(19)	0,00
	08/2018	644	2.415	0	(19)	(19)	0,00
JPM	07/2018	1.966	7.353	0	(55)	(55)	0,00
MSB	07/2018	BRL 5.735	\$ 1.522	31	0	31	0,00
	07/2018	\$ 1.106	BRL 4.055	0	(52)	(52)	0,00
	08/2018	1.518	5.735	0	(33)	(33)	0,00
SCX	07/2018	1.826	6.681	0	(89)	(89)	0,00
TOR	07/2018	47	184	1	0	1	0,00
				\$ 168	\$ (475)	\$ (307)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die ausschüttende Investor CAD (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 83	CAD 110	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BOA	07/2018	CAD 110	\$ 83	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	\$ 83	CAD 110	1	0	1	0,00
BPS	07/2018	83	110	1	0	1	0,00
HUS	07/2018	CAD 110	\$ 83	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	\$ 83	CAD 110	1	0	1	0,00
SSB	07/2018	83	110	1	0	1	0,00
				\$ 5	\$ (2)	\$ 3	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class und Class E CHF (Hedged) 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	07/2018	CHF 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2018	\$ 19.804	CHF 19.503	0	(162)	(162)	(0,01)
BPS	07/2018	CHF 50	\$ 51	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 36	CHF 36	0	0	0	0,00
BRC	07/2018	CHF 25	\$ 25	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	\$ 19.304	CHF 19.067	0	(102)	(102)	0,00
GLM	07/2018	CHF 19.347	\$ 19.386	1	(99)	(98)	0,00
	07/2018	\$ 19.538	CHF 19.335	0	(66)	(66)	0,00
	08/2018	19.118	19.033	99	0	99	0,00
JPM	07/2018	CHF 19.041	\$ 19.217	41	0	41	0,00
	07/2018	\$ 79	CHF 78	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	19.266	19.041	0	(42)	(42)	0,00
RBC	07/2018	CHF 20	\$ 20	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	89	90	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 48	CHF 48	0	0	0	0,00
				\$ 143	\$ (472)	\$ (329)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen für die ausschüttende Investor CHN (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07/2018	\$ 244	CNH 1.600	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
HUS	09/2018	240	1.600	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 1.293.647	€ 1.104.803	\$ 0	\$ (3.734)	\$ (3.734)	(0,05)
BRC	07/2018	€ 14.799	\$ 17.120	0	(159)	(159)	0,00
	07/2018	\$ 24.808	€ 21.025	0	(260)	(260)	(0,01)
CBK	07/2018	€ 1.526	\$ 1.802	21	0	21	0,00
	07/2018	\$ 46.764	€ 40.464	480	0	480	0,01
GLM	07/2018	€ 18.595	\$ 21.617	1	(95)	(94)	0,00
	07/2018	\$ 15.030	€ 12.815	0	(68)	(68)	0,00
MSB	07/2018	1.378.678	1.181.675	987	0	987	0,01
RBC	07/2018	€ 29.498	\$ 34.186	0	(255)	(255)	0,00
RYL	07/2018	100.890	117.918	128	(4)	124	0,00
	07/2018	\$ 14.155	€ 12.034	0	(104)	(104)	0,00
SCX	07/2018	€ 18.547	\$ 21.681	69	(42)	27	0,00
	07/2018	\$ 3.781	€ 3.238	2	(3)	(1)	0,00
SSB	07/2018	€ 1.094.696	\$ 1.267.986	0	(10.126)	(10.126)	(0,13)
	07/2018	\$ 1.293.226	€ 1.116.915	10.829	0	10.829	0,14
	08/2018	1.270.791	1.094.696	10.096	0	10.096	0,13
UAG	07/2018	€ 1.104.939	\$ 1.283.000	0	(7.072)	(7.072)	(0,09)
	08/2018	\$ 1.285.868	€ 1.104.939	7.005	0	7.005	0,09
				\$ 29.618	\$ (21.922)	\$ 7.696	0,10

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) 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	07/2018	£ 21	\$ 27	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2018	\$ 342	£ 255	0	(6)	(6)	0,00
BOA	07/2018	166.505	124.702	0	(1.867)	(1.867)	(0,02)
BRC	07/2018	£ 125.953	\$ 164.708	1	(1.582)	(1.581)	(0,02)
	07/2018	\$ 420	£ 315	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	164.499	125.622	1.578	0	1.578	0,02
CBK	07/2018	167.956	126.764	0	(595)	(595)	(0,01)
GLM	07/2018	£ 1.324	\$ 1.765	18	0	18	0,00
RYL	07/2018	\$ 990	£ 749	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2018	166.085	124.931	0	(1.145)	(1.145)	(0,02)
SSB	07/2018	5.547	4.145	0	(74)	(74)	0,00
UAG	07/2018	£ 125.806	\$ 166.347	252	0	252	0,00
	08/2018	\$ 166.582	£ 125.806	0	(262)	(262)	0,00
				\$ 1.849	\$ (5.536)	\$ (3.687)	(0,05)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Administrative SEK (Hedged) Class 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	07/2018	SEK 19	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2018	\$ 152	SEK 1.332	0	(3)	(3)	0,00
IND	07/2018	SEK 1.298	\$ 144	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	\$ 144	SEK 1.298	1	0	1	0,00
JPM	07/2018	147	1.299	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2018	SEK 1.299	\$ 146	1	0	1	0,00
	08/2018	\$ 146	SEK 1.299	0	(1)	(1)	0,00
SOG	07/2018	148	1.315	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 2	\$ (7)	\$ (5)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional SGD (Hedged) Class, Investor SGD (Hedged) Class und Class M Retail SGD (Hedged) 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	09/2018	SGD 208	\$ 155	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BOA	09/2018	\$ 17.947	SGD 23.832	0	(440)	(440)	(0,01)
CBK	09/2018	SGD 1.383	\$ 1.035	19	0	19	0,01
MSB	09/2018	\$ 20.650	SGD 27.538	0	(419)	(419)	(0,01)
RYL	09/2018	SGD 102	\$ 76	1	0	1	0,00
SCX	09/2018	\$ 2.999	SGD 4.021	0	(45)	(45)	0,00
SSB	09/2018	278	370	0	(6)	(6)	0,00
				\$ 22	\$ (910)	\$ (888)	(0,01)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ (1.763)</b>	<b>(0,02)</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>\$ 8.523.534</b>	<b>110,08</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>\$ (780.583)</b>	<b>(10,08)</b>
<b>Nettovermögen</b>						<b>\$ 7.742.951</b>	<b>100,00</b>

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

## 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) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

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

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(e) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 953.273 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 48.575 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 35.822 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(f) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	2,220 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 29.400	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2021	\$ (30.010)	\$ 29.400	\$ 29.404	0,38
IND	2,300	29.06.2018	02.07.2018	140.000	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.01.2020	(142.799)	140.000	140.018	1,81
JPS	2,210	29.06.2018	02.07.2018	116.100	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.06.2021	(118.486)	116.100	116.114	1,50
NOM	2,220	29.06.2018	02.07.2018	86.500	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044	(88.085)	86.500	86.511	1,12
RDR	2,220	29.06.2018	02.07.2018	66.900	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.07.2020 - 15.08.2026	(68.350)	66.900	66.908	0,86
SCX	2,220	29.06.2018	02.07.2018	900.000	U.S. Treasury Bonds 3,000 % - 3,125 % fällig am 15.08.2044 - 15.11.2045	(479.966)	900.000	900.111	11,62
					U.S. Treasury Notes 1,625 % - 2,250 % fällig am 15.08.2021 - 15.05.2026	(436.793)			
TDM	2,220	29.06.2018	02.07.2018	98.300	U.S. Treasury Bonds 3,750 % fällig am 15.11.2043	(100.362)	98.300	98.312	1,27
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (1.464.851)</b>	<b>\$ 1.437.200</b>	<b>\$ 1.437.378</b>	<b>18,56</b>

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	Wesentliche sonstige			Marktwert
	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	
Übertragbare Wertpapiere	\$ 119.881	\$ 8.402.368	\$ 7.486	\$ 8.529.735
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(9.963)	3.762	0	(6.201)
<b>Summen</b>	<b>\$ 109.918</b>	<b>\$ 8.406.130</b>	<b>\$ 7.486</b>	<b>\$ 8.523.534</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	Wesentliche sonstige			Marktwert
	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	
Übertragbare Wertpapiere	\$ 186.677	\$ 8.851.145	\$ 7.378	\$ 9.045.200
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.407	(5.785)	0	(4.378)
<b>Summen</b>	<b>\$ 188.084</b>	<b>\$ 8.845.360</b>	<b>\$ 7.378</b>	<b>\$ 9.040.822</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 der Wertpapieranlagen.

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	2,280 %	07.06.2018	09.07.2018	\$ (217.527)	\$ (217.858)	(2,81)
FOB	2,350	15.06.2018	06.07.2018	(102.236)	(102.343)	(1,32)
	2,400	15.06.2018	06.07.2018	(90.382)	(90.478)	(1,17)
GRE	2,400	04.06.2018	04.09.2018	(190.261)	(190.603)	(2,46)
	2,400	07.06.2018	04.09.2018	(27.744)	(27.788)	(0,36)
RDR	2,210	31.05.2018	06.07.2018	(280.265)	(280.799)	(3,63)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (909.869)</b>	<b>(11,75)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (239)	\$ 270	\$ 31
BOA	1.402	(13.870)	(12.468)
BPS	(5.764)	5.910	146
BRC	(628)	382	(246)
BSH	(27)	0	(27)
CBK	(470)	2.250	1.780
DUB	(381)	10	(371)
FBF	(2)	0	(2)
GLM	(793)	20	(773)
GST	(7.446)	6.640	(806)
HUS	25	0	25
JPM	(7.568)	7.610	42
MSB	656	10.380	11.036
RBC	(255)	0	(255)
RYL	(12)	(1.970)	(1.982)
SCX	9.076	(20.140)	(11.064)
SOG	2	0	2
SSB	10.720	2.070	12.790
TOR	18	0	18
UAG	(77)	0	(77)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	86,96	86,26
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	4,60	7,31
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	18,60	10,03
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,13)	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,07	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,02)	(0,07)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(11,75)	(4,96)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Capital Securities Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		
	65.958.155	\$ 660.349		65.958.155	\$ 660.349
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
KBC Group NV 4,250 % fällig am 24.10.2025	€ 111.400	131.923	UBS Group Funding Switzerland AG 5,750 % fällig am 19.02.2022	€ 90.000	124.037
	<b>AKTIEN</b>	105.034	Bank of America Corp.	<b>AKTIEN</b>	3.401.540
BNP Paribas S.A.	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Bank of America Corp. 5,875 % fällig am 15.03.2028 QNB Finance Ltd. 3,705 % fällig am 12.02.2020	\$ 103.822	104.178	Danske Bank A/S 5,875 % fällig am 06.04.2022 Credit Suisse Group AG 7,500 % fällig am 11.12.2023	€ 71.000	98.115
	<b>AKTIEN</b>	89.900		\$ 78.975	83.952
Bank of America Corp.	2.858.000	87.166	Credit Suisse Group AG	<b>AKTIEN</b>	4.019.400
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
CaixaBank S.A. 5,250 % fällig am 23.03.2026 Bankia S.A. 6,000 % fällig am 18.07.2022	€ 63.200	77.891	Bank of Ireland 7,375 % fällig am 18.06.2020	€ 49.640	68.931
	<b>AKTIEN</b>	69.225	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 8,875 % fällig am 14.04.2021 HSBC Holdings PLC 5,250 % fällig am 16.09.2022	<b>AKTIEN</b>	42.800
UBS Group AG JPMorgan Chase & Co.	3.403.270	58.557		46.513	62.735
	<b>PARI (000S)</b>		UBS Group AG JPMorgan Chase & Co.	<b>AKTIEN</b>	3.403.270
Credit Suisse Group AG 3,869 % fällig am 12.01.2029 General Electric Co. 5,000 % fällig am 21.01.2021	\$ 53.700	53.642		504.410	55.045
	<b>AKTIEN</b>	46.661	Cooperatieve Rabobank UA 6,625 % fällig am 29.06.2021	€ 38.200	53.850
Goldman Sachs Group, Inc. Wells Fargo & Co.	176.270	45.653		<b>AKTIEN</b>	938.737
	<b>PARI (000S)</b>	44.986	Morgan Stanley Wells Fargo & Co. Barclays PLC	867.288	51.019
				17.254.710	50.526
				<b>PARI (000S)</b>	
ING Groep NV 4,700 % fällig am 22.03.2028 UniCredit SpA 6,625 % fällig am 03.06.2023 Banco Santander S.A. 4,750 % fällig am 19.03.2025 HSBC Holdings PLC 6,250 % fällig am 23.03.2023	\$ 44.600	44.600	Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023	\$ 45.000	50.464
	€ 33.345	44.433		<b>AKTIEN</b>	2.770.153
	35.800	44.100	UniCredit SpA	<b>PARI (000S)</b>	
	\$ 43.800	43.800	Bank of America Corp. 3,824 % fällig am 20.01.2028	\$ 50.000	49.293
	<b>AKTIEN</b>	42.859		<b>AKTIEN</b>	638.910
ING Groep NV - Dutch Certificate	2.452.900	42.859	Citigroup, Inc.	<b>PARI (000S)</b>	48.878
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
HSBC Holdings PLC 4,750 % fällig am 04.07.2029 Dresdner Funding Trust 8,151 % fällig am 30.06.2031 Societe Generale S.A. 6,750 % fällig am 06.04.2028 Danske Bank A/S 7,000 % fällig am 26.06.2025 Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027 HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig am 05.11.2031 HSBC Holdings PLC 6,500 % fällig am 23.03.2028 CaixaBank S.A. 6,750 % fällig am 13.06.2024 ABN AMRO Bank NV 4,750 % fällig am 22.09.2027 VIVAT NV 7,000 % fällig am 19.06.2025 UBS Group Funding Switzerland AG 5,000 % fällig am 31.01.2023 Cooperatieve Rabobank UA 6,910 % fällig am 10.06.2038	€ 31.800	42.432	ING Groep NV 6,500 % fällig am 16.04.2025	\$ 45.000	46.321
	\$ 30.944	41.130	Standard Chartered PLC	<b>AKTIEN</b>	4.450.642
	40.000	40.142		<b>PARI (000S)</b>	
	38.200	38.200	JPMorgan Chase & Co. 3,782 % fällig am 01.02.2028 ING Groep NV 4,700 % fällig am 22.03.2028	\$ 45.000	44.439
	€ 25.450	37.075		43.400	43.504
	£ 20.155	36.619	Goldman Sachs Group, Inc. BNP Paribas S.A.	<b>AKTIEN</b>	176.270
	\$ 36.200	36.200		563.650	41.264
	€ 24.000	34.932		<b>PARI (000S)</b>	
	26.700	34.577	BNP Paribas S.A. 7,375 % fällig am 19.08.2025 UBS AG 7,625 % fällig am 17.08.2022	\$ 36.000	39.887
	28.600	33.671		35.000	39.818
	\$ 33.400	33.400	ING Groep NV	<b>AKTIEN</b>	2.452.900
	£ 15.679	31.415		<b>PARI (000S)</b>	38.307
				<b>PARI (000S)</b>	
			Intesa Sanpaolo SpA 6,250 % fällig am 16.05.2024 ABN AMRO Bank NV 4,750 % fällig am 22.09.2027	€ 29.000	35.296
				26.700	32.578

(a) Der PIMCO Capital Securities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

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 UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>								<b>DEUTSCHLAND</b>			
<b>ARGENTINIEN</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								Deutsche Bank AG			
Argentina Government International Bond				3,195 % fällig am 18.04.2027	\$ 950	\$ 949	0,15	4,250 % fällig am 14.10.2021	\$ 1.700	\$ 1.677	0,26
0,010 % fällig am 15.08.2018	ARS 17.880	\$ 589	0,09	3,148 % fällig am 15.07.2027	500	500	0,08				
5,875 % fällig am 11.01.2028	\$ 600	489	0,08	3,182 % fällig am 26.10.2027	1.640	1.639	0,26				
6,875 % fällig am 26.01.2027	1.200	1.060	0,17	3,203 % fällig am 17.04.2027	300	300	0,05				
34,188 % fällig am 03.04.2022	ARS 3.057	97	0,01	Palmer Square Loan Funding Ltd.	2.820	2.809	0,44				
40,000 % fällig am 21.06.2020	22.713	821	0,13	Sound Point CLO Ltd.	1.300	1.300	0,20				
Summe Argentinien		3.056	0,48	TICP CLO Ltd.	1.570	1.558	0,24				
<b>AUSTRALIEN</b>								<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Driver Australia Four Trust				3,743 % fällig am 20.04.2028	600	601	0,09	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.			
2,940 % fällig am 21.08.2025	AUD 641	474	0,07	Tralee CLO Ltd.	600	601	0,09	3,800 % fällig am 15.09.2022			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust			
Macquarie Bank Ltd.				Venture CLO Ltd.	1.440	1.433	0,22	5,125 % fällig am 30.11.2024			
2,662 % fällig am 04.04.2019	\$ 900	901	0,14	3,168 % fällig am 15.04.2027	1.440	1.433	0,22	116			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								Summe Guernsey, Kanalinseln			
Australia Government International Bond				3,228 % fällig am 15.07.2027	500	499	0,08	518			
0,750 % fällig am 21.11.2027 (c)	AUD 3.567	2.651	0,42	Vibrant CLO Ltd.	824	824	0,13	0,08			
1,250 % fällig am 21.02.2022 (c)	5.644	4.298	0,67	3,259 % fällig am 24.07.2024	824	824	0,13				
3,000 % fällig am 20.09.2025 (c)	1.471	1.268	0,20	Voya CLO Ltd.	900	897	0,14				
Summe Australien		9.592	1,50	3,080 % fällig am 25.07.2026	900	897	0,14				
<b>BRASILIEN</b>								<b>IRLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Petrobras Global Finance BV				Z Capital Credit Partners CLO Ltd.	850	851	0,13	Aurium CLO DAC			
5,999 % fällig am 27.01.2028	\$ 1.777	1.612	0,25	3,298 % fällig am 16.07.2027	850	851	0,13	0,800 % fällig am 26.04.2029			
6,125 % fällig am 17.01.2022	272	277	0,05					€ 400			
Summe Brasilien		1.889	0,30					Black Diamond CLO Designated Activity Co.			
<b>KANADA</b>								<b>AKTIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								BÖRSENGEHADELTE FONDS			
Enbridge, Inc.								PIMCO Fixed Income Source			
2,737 % fällig am 10.01.2020	1.000	1.000	0,16					ETFs plc - PIMCO US Dollar			
3,041 % fällig am 15.06.2020	1.100	1.104	0,17					Short Maturity Source			
Toronto-Dominion Bank								UCITS ETF (e)			
2,250 % fällig am 15.03.2021	800	783	0,12					237.000			
Summe Kanada		5.488	0,86					24.046			
<b>CAYMAN INSELN</b>								<b>ITALIEN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Apidos CLO								Wind Tre SpA			
3,335 % fällig am 19.01.2025	\$ 1.415	1.415	0,22					2,625 % fällig am 20.01.2023			
Atrium CDO Corp.								€ 600			
3,192 % fällig am 22.04.2027	500	499	0,08					591			
Benefit Street Partners CLO Ltd.								Summe Italien			
3,135 % fällig am 18.07.2027	300	299	0,05					58.863			
Catamaran CLO Ltd.								9,22			
3,216 % fällig am 27.01.2028	1.140	1.136	0,18								
CIFC Funding Ltd.											
3,128 % fällig am 15.04.2027	890	888	0,14								
Dryden Senior Loan Fund											
3,248 % fällig am 15.10.2027	900	901	0,14								
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.											
3,279 % fällig am 20.04.2027	400	400	0,06								
Jamestown CLO Ltd.											
3,038 % fällig am 15.07.2026	761	758	0,12								
Marathon CLO Ltd.											
3,201 % fällig am 21.11.2027	2.430	2.425	0,38								

# Aufstellung der Wertpapiervoranlagen des Commodity Real Return 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>NIEDERLANDE</b>				<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				<b>VOLT LLC</b>				
<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>								
Caim CLO BV				Emirate of Abu Dhabi Government International Bond				3,125 % fällig am 25.09.2047	\$ 635	\$ 631	0,10	
0,650 % fällig am 20.10.2028	€	200	0,234	6,750 % fällig am 08.04.2019	\$	200	0,206	3,250 % fällig am 25.06.2047	111	110	0,02	
Jubilee CLO BV								3,375 % fällig am 25.04.2047	119	119	0,02	
0,479 % fällig am 15.12.2029		2.650	3,096	<b>GROSSBRITANNIEN</b>				3,500 % fällig am 25.03.2047	67	66	0,01	
			3.330	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								
				<b>Imperial Brands Finance PLC</b>								
				2,950 % fällig am 21.07.2020		700	693	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
				Lloyds Banking Group PLC				<b>Ally Financial, Inc.</b>				
				3,130 % fällig am 21.06.2021		800	800	4,125 % fällig am 30.03.2020	200	201	0,03	
				Nationwide Building Society				<b>American Honda Finance Corp.</b>				
				10,250 % (d)	£	7	1.411	2,713 % fällig am 05.11.2021	20	20	0,00	
				Royal Bank of Scotland Group PLC				<b>AT&amp;T, Inc.</b>				
				3,885 % fällig am 25.06.2024	\$	600	599	2,975 % fällig am 01.06.2021	900	904	0,14	
				4,519 % fällig am 25.06.2024		400	401	3,298 % fällig am 15.07.2021	1.300	1.313	0,21	
							3.904	0,61	5,150 % fällig am 15.02.2050	400	374	0,06
								5,300 % fällig am 15.08.2058	100	93	0,01	
								<b>Aviation Capital Group LLC</b>				
								7,125 % fällig am 15.10.2020	3.100	3.345	0,52	
								<b>BAT Capital Corp.</b>				
								2,945 % fällig am 14.08.2020	700	703	0,11	
								<b>Charter Communications Operating LLC</b>				
								4,464 % fällig am 23.07.2022	1.000	1.013	0,16	
								<b>Citicorp Lease Pass-Through Trust</b>				
								8,040 % fällig am 15.12.2019	223	238	0,04	
								<b>Consolidated Edison Co. of New York, Inc.</b>				
								2,739 % fällig am 25.06.2021	200	200	0,03	
								<b>CVS Health Corp.</b>				
								3,047 % fällig am 09.03.2021	500	503	0,08	
								3,700 % fällig am 09.03.2023	200	199	0,03	
								<b>Delta Air Lines, Inc.</b>				
								2,600 % fällig am 04.12.2020	1.900	1.860	0,29	
								3,625 % fällig am 15.03.2022	1.300	1.286	0,20	
								<b>DISH DBS Corp.</b>				
								7,875 % fällig am 01.09.2019	100	104	0,02	
								<b>Dominion Energy Gas Holdings LLC</b>				
								2,926 % fällig am 15.06.2021	800	800	0,13	
								<b>Dominion Energy, Inc.</b>				
								2,930 % fällig am 15.05.2020	1.300	1.301	0,20	
								<b>Duke Energy Corp.</b>				
								2,830 % fällig am 14.05.2021	1.700	1.700	0,27	
								<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>				
								2,459 % fällig am 27.03.2020	400	394	0,06	
								2,681 % fällig am 09.01.2020	800	793	0,12	
								2,875 % fällig am 01.10.2018	600	600	0,09	
								<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>				
								2,876 % fällig am 31.10.2022	700	684	0,11	
								3,541 % fällig am 15.09.2020	1.400	1.421	0,22	
								<b>HCA, Inc.</b>				
								3,750 % fällig am 15.03.2019	1.800	1.811	0,28	
								<b>International Lease Finance Corp.</b>				
								6,250 % fällig am 15.05.2019	1.700	1.743	0,27	
								7,125 % fällig am 01.09.2018	200	201	0,03	
								8,250 % fällig am 15.12.2020	100	110	0,02	
								<b>John Deere Capital Corp.</b>				
								2,622 % fällig am 22.06.2020	1.500	1.504	0,24	
								<b>Lehman Brothers Holdings, Inc.</b>				
								7,875 % fällig am 08.05.2018 ^	£ 100	5	0,00	
								<b>McDonald's Corp.</b>				
								2,759 % fällig am 28.10.2021	\$ 1.600	1.607	0,25	
								<b>Mississippi Power Co.</b>				
								2,987 % fällig am 27.03.2020	2.300	2.300	0,36	
								<b>Navient Corp.</b>				
								5,500 % fällig am 15.01.2019	400	404	0,06	
								5,875 % fällig am 25.03.2021	300	306	0,05	
								<b>Nevada Power Co.</b>				
								6,500 % fällig am 01.08.2018	200	201	0,03	
								<b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b>				
								2,636 % fällig am 03.09.2019	980	982	0,15	
								<b>Penske Truck Leasing Co. LP</b>				
								4,875 % fällig am 11.07.2022	400	416	0,07	
								<b>Sempra Energy</b>				
								2,791 % fällig am 15.03.2021	200	200	0,03	
								<b>Southern Power Co.</b>				
								2,875 % fällig am 20.12.2020	500	500	0,08	

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				
Spectra Energy Partners LP 3,018 % fällig am 05.06.2020 Sprint Capital Corp. 6,900 % fällig am 01.05.2019 Sprint Communications, Inc. 9,000 % fällig am 15.11.2018 Time Warner Cable LLC 4,000 % fällig am 01.09.2021 VMware, Inc. 2,950 % fällig am 21.08.2022 Volkswagen Group of America Finance LLC 2,450 % fällig am 20.11.2019 ZF North America Capital, Inc. 4,500 % fällig am 29.04.2022	\$ 100	\$ 101	0,02	GMAC Mortgage Corp. Loan Trust 4,235 % fällig am 25.06.2034 GreenPoint Mortgage Funding Trust 2,531 % fällig am 25.06.2045 GSR Mortgage Loan Trust 3,678 % fällig am 25.09.2035 3,892 % fällig am 25.06.2034 4,349 % fällig am 25.07.2035 HarborView Mortgage Loan Trust 2,684 % fällig am 20.06.2035 HomeBanc Mortgage Trust 2,421 % fällig am 25.10.2035 Impac CMB Trust 2,991 % fällig am 25.10.2033 IndyMac Mortgage Loan Trust 2,731 % fällig am 25.07.2045 JPMorgan Mortgage Trust 3,785 % fällig am 25.08.2035 3,819 % fällig am 25.10.2035 LMREC, Inc. 3,082 % fällig am 22.02.2032 Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 2,513 % fällig am 15.12.2030 3 3 Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust 3,459 % fällig am 25.10.2035 138 137 Regal Trust 2,316 % fällig am 29.09.2031 23 22 Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 6,500 % fällig am 25.03.2032 11 12 Sequoia Mortgage Trust 2,785 % fällig am 19.10.2026 10 10 3,764 % fällig am 20.04.2035 125 131 Structured Asset Mortgage Investments Trust 2,665 % fällig am 19.07.2034 5 5 2,745 % fällig am 19.10.2034 26 25 2,785 % fällig am 19.03.2034 21 21 Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates 4,150 % fällig am 25.07.2032 3 3 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 2,401 % fällig am 25.01.2045 41 41 2,461 % fällig am 25.01.2045 218 216 2,871 % fällig am 25.10.2044 444 444 2,958 % fällig am 25.06.2042 3 3 Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 3,739 % fällig am 25.12.2034 138 141 3,911 % fällig am 25.03.2035 88 90 4,149 % fällig am 25.12.2034 8 8 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ 110 110 7,279 1,14	\$ 13	\$ 13	0,00	2,925 % fällig am 20.07.2022 6,000 % fällig am 16.12.2029	\$ 134	\$ 145	0,02				
<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>US-SCHATZobligationen</b>				<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)</b>							
American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010 7,734 % fällig am 15.02.2033 Bay Area Toll Authority, California Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 6,918 % fällig am 01.04.2040 California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009 7,300 % fällig am 01.10.2039 7,500 % fällig am 01.04.2034 7,550 % fällig am 01.04.2039 Los Angeles Department of Water & Power, California Revenue Bonds, Series 2010 5,516 % fällig am 01.07.2027 New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 5,508 % fällig am 01.08.2037 New York State Urban Development Corp. Revenue Bonds, (BABs), Series 2009 5,770 % fällig am 15.03.2039	200 200 600 500 100 200 500 200 100	273 829 710 141 296 577 710 237 117	0,04 0,13 0,11 0,02 0,05 0,09 0,04 0,02	2,925 % fällig am 20.07.2022 0,125 % fällig am 15.04.2019 0,125 % fällig am 15.04.2020 (g) 0,125 % fällig am 15.04.2021 (g) 0,125 % fällig am 15.01.2022 0,125 % fällig am 15.04.2022 0,125 % fällig am 15.07.2024 0,125 % fällig am 15.07.2026 0,250 % fällig am 15.01.2025 0,375 % fällig am 15.07.2023 0,375 % fällig am 15.07.2025 0,375 % fällig am 15.01.2027 0,500 % fällig am 15.01.2028 0,625 % fällig am 15.07.2021 0,625 % fällig am 15.04.2023 0,625 % fällig am 15.01.2024 0,625 % fällig am 15.01.2026 0,625 % fällig am 15.01.2028 0,750 % fällig am 15.02.2045 0,875 % fällig am 15.02.2047 1,000 % fällig am 15.02.2048 1,250 % fällig am 15.07.2020 1,750 % fällig am 15.01.2028 2,000 % fällig am 15.01.2026 2,125 % fällig am 15.02.2040 2,125 % fällig am 15.02.2041 2,375 % fällig am 15.01.2025 2,500 % fällig am 15.01.2029 3,375 % fällig am 15.04.2032 3,625 % fällig am 15.04.2028 3,875 % fällig am 15.04.2029	134 134 600 30.606 64.057 72.281 885 5.798 20.094 7.766 8.930 5.529 664 18.481 8.336 1.513 10.902 11.629 2.021 2.654 1.785 15.966 8.428 1.344 139 1.830 21.131 4.806 912 1.304 1.173	\$ 1,436 145 92.296 30.430 63.385 71.179 871 5.680 19.539 2.094 7.556 8.852 5.433 645 18.087 8.369 1.510 10.890 11.570 1.964 2.657 1.847 16.228 9.214 1.473 175 2.321 23.437 5.653 1.219 1.657 1.548	0,23 0,02 14,46 4,77 9,93 11,15 0,14 0,89 3,06 0,33 1,18 1,39 0,85 0,10 2,83 1,31 0,24 1,70 1,81 0,31 0,42 0,29 2,54 1,44 0,23 0,03 0,36 3,67 0,88 0,19 0,26 0,24	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 28.02.2022 (g) 2,750 % fällig am 15.02.2024 (g)	1.400 13.900	1.361 13.884	0,21 2,18				
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
American Home Mortgage Investment Trust 3,746 % fällig am 25.10.2034 3,998 % fällig am 25.09.2045 Banc of America Funding Trust 3,602 % fällig am 20.09.2034 BCAP LLC Trust 5,250 % fällig am 26.04.2037 Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,624 % fällig am 25.01.2035 3,739 % fällig am 25.09.2034 3,832 % fällig am 25.02.2034 3,951 % fällig am 25.05.2047 ^ 3,977 % fällig am 25.11.2034 Bear Stearns ALT-A Trust 3,611 % fällig am 25.10.2033 3,737 % fällig am 25.08.2036 ^ Chase Mortgage Finance Trust 3,735 % fällig am 25.03.2037 ^ Citigroup Mortgage Loan Trust 2,160 % fällig am 25.06.2047 Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 3,890 % fällig am 25.09.2035 Countrywide Alternative Loan Trust 2,281 % fällig am 25.09.2046 ^ 2,294 % fällig am 20.07.2046 ^ 3,695 % fällig am 25.02.2037 ^ Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 2,551 % fällig am 25.05.2035 2,671 % fällig am 25.04.2035 2,731 % fällig am 25.03.2035 2,851 % fällig am 25.09.2034 3,466 % fällig am 25.09.2047 ^ 4,278 % fällig am 25.06.2033 Credit Suisse Mortgage Capital Trust 4,134 % fällig am 25.06.2050	4 69 31 31 503 80 170 23 18 15 30 21 13 789 9 23 18 18 170 105 142 3 17 123 1.516	4 70 32 425 80 171 23 16 15 31 14 13 791 9 21 14 17 157 97 140 3 16 124 1.226	0,00 0,01 0,01 0,07 0,01 0,03 0,00 0,00 0,00 0,00 0,01 0,00 0,00 0,01 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,02 0,02 0,02 0,00 0,00 0,02 0,19	Fannie Mae 2,661 % fällig am 25.09.2036 5,407 % fällig am 01.11.2034 6,000 % fällig am 25.02.2044 6,500 % fällig am 25.06.2028 Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 17.07.2033 - 13.08.2048 4,000 % fällig am 13.08.2048 Freddie Mac 2,371 % fällig am 25.09.2031 2,523 % fällig am 15.12.2031 2,573 % fällig am 15.04.2028 2,673 % fällig am 15.03.2024 2,723 % fällig am 15.03.2032 3,549 % fällig am 01.01.2034 5,000 % fällig am 15.01.2035 6,000 % fällig am 15.04.2036 Ginnie Mae 2,282 % fällig am 20.10.2043 2,334 % fällig am 20.02.2035 2,526 % fällig am 20.03.2060 2,574 % fällig am 20.02.2038 2,731 % fällig am 20.08.2062	7 905 8 18 46.580 37.800 21 2 14 9 149 5 711 7 1.850 65 55 36 1.960	7 916 216 444 3 141 90 216 0,02 110 46.337 38.485 21 2 14 9 150 6 752 8 1.848 65 55 37 1.961	0,00 0,15 0,00 0,00 7,26 6,03 0,00 0,00 0,00 0,00 0,02 0,00 0,12 0,00 0,29 0,01 0,01 0,01 0,31	Summe USA	501.928	78,61					
				<b>COMMERCIAL PAPER</b>				<b>KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>							
				HSBC Bank Canada 1,579 % fällig am 06.07.2018 1,584 % fällig am 04.07.2018 Royal Bank of Canada 1,527 % fällig am 06.07.2018				CAD 1.000 3.800	760 2.888	0,12 0,45	Letras del Banco Central de la Republica Argentina 25,600 % fällig am 18.07.2018 ARS 11.390 40,700 % fällig am 18.07.2018 27.570 Nigeria Open Market Operation Bills 15,432 % fällig am 25.10.2018 NGN 35.200 15,703 % fällig am 25.10.2018 15.300 15,737 % fällig am 08.11.2018 59.400 15,798 % fällig am 08.11.2018 15.300	387 937	0,06 0,15	1.657 0,26	
				<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>											
				(12,971) % fällig am 14.09.2018 (a)(b) ARS 556 (2,677) % fällig am 12.10.2018 (a)(b) 130 (0,978) % fällig am 12.10.2018 (a)(b) 1.910 2,480 % fällig am 12.10.2018 (a)(b) \$ 200 2,830 % fällig am 13.07.2018 (a)(b) 300 2,984 % fällig am 16.11.2018 (a)(b) 342 2,985 % fällig am 28.09.2018 (a)(b) 300 3,100 % fällig am 26.10.2018 (a)(b) 100				556 130 1.910 200 300 342 300 100	20 5 68 198 300 336 297 99	0,00 0,00 0,01 0,03 0,05 0,05 0,05 0,01					

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
25.350 % fällig am 14.09.2018 (a)(b)	ARS 1.200	\$ 38	0,01	15.542 % fällig am 11.10.2018 (a)(b)	NGN 11.400	\$ 31	0,01
25.450 % fällig am 14.09.2018 (a)(b)	1.200	38	0,01	15.566 % fällig am 29.11.2018 (a)(b)	4.600	12	0,00
25.500 % fällig am 14.09.2018 (a)(b)	3.900	125	0,02	15.609 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	11.400	31	0,01
		1.524	0,24			600	0,10
<b>GREECE TREASURY BILLS</b>				Summe kurzfristige Instrumente		41.598	6,52
0,800 % fällig am 13.07.2018 (a)(b)	€ 480	560	0,09				
1,082 % fällig am 05.10.2018 (a)(b)	490	571	0,09	<b>AKTIEN</b>			
1,211 % fällig am 31.08.2018 (a)(b)	2.640	3.079	0,48	<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
		4.210	0,66	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	1.717	17	0,00
<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente - Amtliche Börse/Geregelter Markt		\$ 799.419	125,20
0,156 % fällig am 30.07.2018 (a)(b)	¥ 950.000	8.578	1,34				
<b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>							
15,284 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	NGN 23.400	63	0,01				
15,450 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	122.300	329	0,05				
15,501 % fällig am 29.11.2018 (a)(b)	26.900	71	0,01				
15,504 % fällig am 29.11.2018 (a)(b)	23.700	63	0,01				

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 Nettover- mögens
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2018	3	\$ (2)	0,00
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2019	3	(3)	0,00
90-Day Eurodollar June Futures	Long	06/2019	3	(3)	0,00
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2019	3	(3)	0,00
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2018	3	(2)	0,00
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2019	3	(3)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09/2018	69	(20)	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	11	(13)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 162,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	48	(49)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Short	09/2018	30	(23)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09/2018	1	2	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	35	22	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	121	93	0,02
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	2	4	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	77	(101)	(0,02)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	4	(7)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 157,000 EUR auf Euro-Bund 10- Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	24	14	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	133	25	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	67	9	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09/2018	221	(231)	(0,04)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09/2018	270	(1.084)	(0,17)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	7	(28)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	94	(208)	(0,03)
				\$ (1.611)	(0,25)

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettover- mögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	\$ 141,000	27.07.2018	7	\$ (7)	\$ (1)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	142,000	27.07.2018	9	(6)	(1)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	143,000	27.07.2018	29	(22)	(9)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	145,000	27.07.2018	15	(9)	(15)	(0,01)
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	146,000	27.07.2018	16	(9)	(10)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	146,500	27.07.2018	16	(10)	(7)	0,00
				\$ (63)	\$ (43)	(0,01)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ (1.654) (0,26)

## 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>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
Daimler AG	1,000 %	20.12.2020	€ 190	\$ 0	0,00
Leonardo SpA	5,000	20.03.2019	300	(16)	0,00
				\$ (16)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
CDX.HY-30 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2023	\$ 9.643	\$ 48	0,01
iTraxx Europe Main 26 5-Year Index	(1,000)	20.12.2021	€ 2.200	(13)	0,00
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	6.300	62	0,01
				\$ 97	0,02

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
Erhalt		1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000 %	15.12.2047	\$ 1.750	\$ 161	0,02
Erhalt		1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,428	20.12.2047	400	0	0,00
Erhalt		1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,478	20.12.2047	1.115	(15)	0,00
Erhalt		1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,499	20.12.2047	570	(9)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	11,970	04.01.2027	BRL 7.300	21	0,00
Erhalt		3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	NZD 900	(21)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>		3-Month USD-LIBOR	1,850	20.07.2026	\$ 1.900	36	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>		3-Month USD-LIBOR	1,850	27.07.2026	2.100	39	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>		3-Month USD-LIBOR	1,950	08.11.2026	15.000	228	0,03
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,000	20.12.2019	200	3	0,00
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	18.700	(59)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2025	1.500	3	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>		3-Month USD-LIBOR	2,000	27.07.2026	13.600	208	0,03
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,150	19.06.2048	1.250	90	0,01
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	2,250	16.12.2022	14.900	(648)	(0,10)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	29.700	(842)	(0,13)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	7.550	49	0,01
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	13.000	52	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>		3-Month USD-LIBOR	2,300	27.04.2026	6.900	142	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>		3-Month USD-LIBOR	2,400	07.12.2026	300	4	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>		3-Month USD-LIBOR	2,500	19.12.2023	200	(7)	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,500	16.12.2035	900	66	0,01
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	7.160	(132)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>		3-Month USD-LIBOR	2,678	25.10.2023	4.000	(48)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	4.868	(3)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>		3-Month USD-LIBOR	2,969	25.10.2048	300	1	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>		3-Month USD-LIBOR	3,100	17.04.2028	650	2	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>		6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	£ 2.380	(46)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>		6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	2.130	41	0,01
Erhalt		6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 680.000	(17)	0,00
Erhalt		6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	230.000	(3)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>		6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	410.000	(18)	0,00
Erhalt		CPTFEMU	1,475	15.05.2023	€ 1.900	(4)	0,00
Erhalt		CPTFEMU	1,505	26.06.2021	600	0	0,00
Erhalt		CPTFEMU	1,535	15.06.2023	2.900	1	0,00
Erhalt		CPTFEMU	1,535	15.03.2028	2.100	(15)	0,00
Zahlung		CPTFEMU	1,710	15.03.2033	400	1	0,00
Erhalt		CPTFEMU	1,946	15.03.2048	400	(6)	0,00
Zahlung		CPURNSA	1,678	24.05.2021	\$ 4.400	76	0,01
Erhalt		CPURNSA	1,845	24.05.2026	1.100	(31)	0,00
Zahlung		CPURNSA	1,550	26.07.2021	1.100	3	0,00
Zahlung		CPURNSA	1,603	12.09.2021	770	2	0,00
Erhalt		CPURNSA	1,730	26.07.2026	1.100	(6)	0,00
Erhalt		CPURNSA	1,762	30.08.2026	2.300	(13)	0,00
Erhalt		CPURNSA	1,780	15.09.2026	900	(5)	0,00
Erhalt		CPURNSA	1,801	12.09.2026	770	(4)	0,00
Zahlung		CPURNSA	1,970	27.04.2019	11.520	9	0,00
Zahlung		CPURNSA	1,980	10.04.2019	3.160	4	0,00
Zahlung		CPURNSA	2,070	23.03.2019	7.900	12	0,00
Erhalt		CPURNSA	2,080	25.07.2027	1.600	(47)	(0,01)
Erhalt		CPURNSA	2,122	01.08.2027	2.100	(54)	(0,01)
Erhalt		CPURNSA	2,143	25.04.2020	1.360	0	0,00
Erhalt		CPURNSA	2,150	25.09.2027	800	(20)	0,00
Erhalt		CPURNSA	2,155	17.10.2027	1.900	(47)	(0,01)
Zahlung		CPURNSA	2,168	15.07.2020	2.600	13	0,00
Erhalt		CPURNSA	2,180	20.09.2027	840	(19)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
Zahlung	CPURNSA	2,210 %	05.02.2023	\$ 5.270	\$ 35	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,263	27.04.2023	1.450	2	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,263	09.05.2023	1.790	3	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,281	10.05.2023	2.750	3	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,335	05.02.2028	2.680	(16)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,353	09.05.2028	1.790	0	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,360	09.05.2028	2.690	2	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,364	10.05.2028	2.750	3	0,00
Zahlung	FRCPXTOB	1,345	15.06.2021	€ 3.700	2	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,350	15.01.2023	3.000	(17)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,575	15.01.2028	960	(4)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,590	15.02.2028	3.080	(6)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,606	15.02.2028	400	0	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,910	15.01.2038	890	8	0,00
Erhalt	UKRPI	3,100	15.06.2031	£ 2.300	89	0,01
Erhalt	UKRPI	3,190	15.04.2030	700	19	0,00
Erhalt	UKRPI	3,350	15.05.2030	900	27	0,00
Erhalt	UKRPI	3,358	15.04.2035	300	14	0,00
Erhalt	UKRPI	3,400	15.06.2030	2.700	66	0,01
Zahlung	UKRPI	3,428	15.03.2047	440	(13)	0,00
Erhalt	UKRPI	3,470	15.09.2032	1.130	31	0,00
Erhalt	UKRPI	3,530	15.10.2031	540	7	0,00
Zahlung	UKRPI	3,585	15.10.2046	340	(31)	(0,01)
					\$ (648)	(0,11)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (567)</b>	<b>(0,09)</b>

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* 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	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettover- mögens
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,765 %	16.07.2018	\$ 3.700	\$ 43	\$ 67	0,01

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettover- mögens
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.07.2018	\$ 1.500	\$ (2)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	3.300	(4)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	€ 3.300	(6)	(4)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 800	(2)	0	0,00
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	1.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	1.500	(2)	(2)	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 6.500	(13)	(16)	(0,01)
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 800	(1)	0	0,00
						\$ (31)	\$ (27)	(0,01)

### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettover- mögens
CBK	Call - OTC USD versus MXN	MXN 21,100	22.08.2018	\$ 2.107	\$ (24)	\$ (13)	0,00

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,152	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	€ 1.200	\$ (55)	\$ (7)	0,00
JPM	Floor - OTC YOY CPURNSA	234,812	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	24.03.2020	\$ 3.700	(42)	(3)	0,00
	Floor - OTC YOY CPURNSA	238,654	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	02.10.2020	2.000	(37)	(3)	0,00
						\$ (134)	\$ (13)	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,250 %	04.12.2018	\$ 5.700	\$ (32)	\$ (21)	0,00

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

## ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	10-Year USD-ISDA - 2-Year USD-ISDA	0,000 %	02.01.2020	39.200	\$ (30)	\$ (57)	(0,01)

<sup>(1)</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	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 %	20.06.2022	\$ 100	\$ (6)	\$ 1	\$ (5)	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2021	100	(9)	7	(2)	0,00
DUB	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2021	200	(17)	12	(5)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	400	(26)	7	(19)	0,00
					\$ (58)	\$ 27	\$ (31)	0,00

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
DUB	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 1.500	\$ (104)	\$ 109	\$ 5	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	1.800	(94)	99	5	0,00
					\$ (198)	\$ 208	\$ 10	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	1-Year BRL-CDI	1,998	20.06.2028	ILS 890	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
BRC	Erhalt	1-Year BRL-CDI	(0,374)	20.06.2020	3.790	0	2	2	0,00
	Zahlung	1-Year BRL-CDI	1,950	20.06.2028	810	0	(1)	(1)	0,00
DUB	Zahlung	1-Year BRL-CDI	2,100	20.06.2028	750	0	1	1	0,00
GLM	Erhalt	1-Year BRL-CDI	(0,370)	20.06.2020	2.850	0	1	1	0,00
	Erhalt	1-Year BRL-CDI	(0,290)	16.02.2020	6.800	0	0	0	0,00
	Erhalt	1-Year BRL-CDI	(0,270)	21.03.2020	4.250	0	1	1	0,00
	Zahlung	1-Year BRL-CDI	1,971	16.02.2028	1.430	0	2	2	0,00
	Zahlung	1-Year BRL-CDI	1,998	20.06.2028	610	0	0	0	0,00
HUS	Erhalt	1-Year BRL-CDI	(0,370)	20.06.2020	2.230	0	1	1	0,00
	Zahlung	1-Year BRL-CDI	1,998	20.06.2028	480	0	0	0	0,00
JPM	Erhalt	1-Year BRL-CDI	(0,420)	20.06.2020	3.510	0	0	0	0,00
MYC	Erhalt	CPURNSA	1,800	20.07.2026	\$ 400	0	(21)	(21)	(0,01)
	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	300	0	(15)	(15)	0,00
						\$ 0	\$ (30)	\$ (30)	(0,01)

# Aufstellung der Wertpapiieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettover- mögens
BPS	Erhalt	BCOMTR Index	306.973	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 55.385	15.08.2018	\$ 0	\$ (191)	\$ (191)	(0,03)
CBK	Erhalt	BCOMTR Index	592.435	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	106.889	15.08.2018	(737)	377	(360)	(0,05)
	Erhalt	CIXBSTR3 Index	548.678	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	107.642	15.08.2018	0	(356)	(356)	(0,05)
CIB	Erhalt	BCOMTR Index	154.350	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	27.848	15.08.2018	0	(96)	(96)	(0,01)
FBF	Erhalt	BCOMTR Index	77.214	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	13.931	15.08.2018	0	(48)	(48)	(0,01)
GST	Erhalt	BCOMF1T Index	75.522	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	26.908	15.08.2018	0	(105)	(105)	(0,02)
	Erhalt	BCOMTR Index	580.609	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	104.755	15.08.2018	(47)	(314)	(361)	(0,06)
	Erhalt	BCOMTR2 Index	50.957	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	9.271	15.08.2018	0	(32)	(32)	(0,01)
JPM	Erhalt	BCOMF1T Index	276.501	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	98.515	15.08.2018	0	(385)	(385)	(0,06)
	Erhalt	BCOMTR Index	280.080	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	50.533	15.08.2018	0	(174)	(174)	(0,03)
	Erhalt	JMABDEWU Index	494.170	0,300	75.326	15.08.2018	0	218	218	0,04
MEI	Erhalt	BCOMTR Index	171.159	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	30.881	15.08.2018	0	(106)	(106)	(0,02)
SOG	Erhalt	BCOMTR Index	17.598	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	3.175	15.08.2018	0	(11)	(11)	0,00
							\$ (784)	\$ (1.223)	\$ (2.007)	(0,31)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BOA	07/2018	\$ 9.889	AUD 13.396	\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,00
	08/2018	AUD 13.396	\$ 9.890	0	(9)	(9)	0,00
BPS	07/2018	ARS 7.226	261	13	0	13	0,00
	07/2018	\$ 263	ARS 7.226	0	(13)	(13)	0,00
	07/2018	€ 98.831	€ 84.943	344	0	344	0,05
	07/2018	¥ 3.151	¥ 342.200	0	(61)	(61)	(0,01)
	08/2018	ARS 17.880	\$ 831	237	0	237	0,04
	08/2018	€ 84.943	€ 99.051	0	(339)	(339)	(0,05)
	09/2018	\$ 46	IDR 653.475	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	1.435	INR 98.002	0	(19)	(19)	0,00
BRC	08/2018	591	MXN 11.261	0	(23)	(23)	0,00
	09/2018	KRW 802.033	\$ 724	2	0	2	0,00
CBK	07/2018	CAD 5.736	4.406	46	0	46	0,01
	07/2018	DKK 10.856	1.809	108	0	108	0,02
	07/2018	£ 28.390	37.613	131	0	131	0,02
	07/2018	RUB 96.646	1.528	0	(12)	(12)	0,00
	07/2018	\$ 101	ARS 2.644	0	(11)	(11)	0,00
	07/2018	72	TRY 332	0	0	0	0,00
	07/2018	ARS 15.049	\$ 540	18	0	18	0,00
	07/2018	\$ 78	ARS 1.954	0	(10)	(10)	0,00
	07/2018	€ 70	\$ 87	5	0	5	0,00
	07/2018	\$ 1.398	COP 4.019.559	0	(30)	(30)	(0,01)
GLM	07/2018	AUD 13.396	\$ 10.070	173	0	173	0,03
	07/2018	€ 22.579	€ 26.288	0	(74)	(74)	(0,01)
	07/2018	£ 327	436	4	0	4	0,00
	07/2018	PEN 4.124	1.257	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 2.703	€ 2.314	0	(2)	(2)	0,00
	09/2018	INR 96.599	\$ 1.402	6	0	6	0,00
HUS	07/2018	ARS 16.328	772	215	0	215	0,03
	07/2018	€ 191	223	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 315	ARS 8.162	0	(33)	(33)	(0,01)
	07/2018	4.311	CAD 5.736	49	0	49	0,01
	07/2018	17	€ 15	0	0	0	0,00
	07/2018	1.533	RUB 96.646	7	0	7	0,00
	08/2018	CAD 5.736	\$ 4.314	0	(49)	(49)	(0,01)
	08/2018	€ 2.640	3.270	174	0	174	0,03
	08/2018	RUB 96.646	1.526	0	(7)	(7)	0,00
	08/2018	\$ 1.476	RUB 92.232	0	(13)	(13)	0,00
	09/2018	CNH 18.227	\$ 2.864	122	0	122	0,02
	10/2018	€ 120	149	8	0	8	0,00
JPM	07/2018	3.784	4.482	64	0	64	0,01
	07/2018	¥ 650.000	5.981	102	0	102	0,01
	07/2018	NZD 2.544	1.791	69	0	69	0,01
	10/2018	NGN 172.852	461	0	(12)	(12)	0,00
	11/2018	117.940	313	0	(7)	(7)	0,00
MSB	07/2018	ARS 18.792	666	25	0	25	0,00
	07/2018	CAD 2.100	1.618	22	0	22	0,00
	07/2018	¥ 300.000	2.761	47	0	47	0,01
	07/2018	\$ 21.776	€ 18.854	237	0	237	0,04
	08/2018	€ 18.854	\$ 21.824	0	(236)	(236)	(0,04)
	09/2018	ARS 1.589	72	20	0	20	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mogens
NGF	10/2018	NGN 21.952	\$ 59	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07/2018	ARS 8.778	309	9	0	9	0,00
	09/2018	KRW 490.689	443	1	0	1	0,00
	09/2018	SGD 1.582	1.167	4	0	4	0,00
RYL	09/2018	TWD 35.296	1.167	3	0	3	0,00
	10/2018	€ 370	462	27	0	27	0,00
SCX	07/2018	CAD 3.800	2.938	49	0	49	0,01
	07/2018	€ 79.994	92.669	0	(728)	(728)	(0,11)
	07/2018	\$ 1.701	DKK 10.854	0	0	0	0,00
	07/2018	2.909	SEK 25.905	0	(14)	(14)	0,00
	08/2018	SEK 25.905	\$ 2.916	14	0	14	0,00
	09/2018	KRW 1.083.452	1.008	32	0	32	0,01
	10/2018	DKK 10.854	1.714	1	0	1	0,00
	10/2018	NGN 10.688	29	0	(1)	(1)	0,00
	11/2018	4.338	12	0	0	0	0,00
	07/2018	SEK 25.905	2.908	11	0	11	0,00
SOG	08/2018	\$ 44	ARS 904	0	(13)	(13)	0,00
SSB	09/2018	631	IDR 8.849.665	0	(20)	(20)	0,00
TOR	07/2018	¥ 342.200	\$ 3.115	25	0	25	0,00
	08/2018	\$ 3.121	¥ 342.200	0	(25)	(25)	(0,01)
UAG	07/2018	37.971	£ 28.717	0	(57)	(57)	(0,01)
	08/2018	£ 28.717	\$ 38.025	60	0	60	0,01
				\$ 2.493	\$ (1.822)	\$ 671	0,10

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class G Institutional EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mogens
BOA	07/2018	\$ 20.779	€ 17.702	\$ 0	\$ (112)	\$ (112)	(0,01)
BPS	07/2018	21.375	18.429	142	0	142	0,02
BRC	07/2018	€ 253	\$ 298	3	0	3	0,00
	07/2018	\$ 610	€ 528	6	0	6	0,00
CBK	07/2018	€ 109	\$ 129	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 554	€ 480	6	0	6	0,00
GLM	07/2018	199	170	0	0	0	0,00
MSB	07/2018	€ 21.157	\$ 24.436	0	(266)	(266)	(0,04)
	08/2018	\$ 24.490	€ 21.157	265	0	265	0,04
RBC	07/2018	337	290	2	0	2	0,00
RYL	07/2018	€ 1.240	\$ 1.454	7	0	7	0,00
	07/2018	\$ 813	€ 696	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	€ 248	\$ 291	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 13.069	€ 11.224	37	(1)	36	0,01
SSB	07/2018	€ 20.975	\$ 24.417	0	(72)	(72)	(0,01)
	07/2018	\$ 21.489	€ 18.467	72	0	72	0,01
	08/2018	24.471	20.975	71	0	71	0,01
				\$ 615	\$ (451)	\$ 164	0,03

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mogens
BOA	07/2018	\$ 5.027	£ 3.765	\$ 0	\$ (56)	\$ (56)	(0,01)
BPS	07/2018	£ 477	\$ 634	4	0	4	0,00
BRC	07/2018	3.584	4.686	0	(45)	(45)	(0,01)
	08/2018	\$ 4.693	£ 3.584	45	0	45	0,01
CBK	07/2018	5.180	3.910	0	(18)	(18)	0,00
GLM	07/2018	£ 65	\$ 86	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 144	£ 108	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07/2018	5.152	3.876	0	(35)	(35)	(0,01)
SSB	07/2018	£ 5	\$ 6	0	0	0	0,00
UAG	07/2018	3.560	4.708	7	0	7	0,00
	08/2018	\$ 4.714	£ 3.560	0	(8)	(8)	0,00
				\$ 56	\$ (164)	\$ (108)	(0,02)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (1.395)	(0,22)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARK TWERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Fannie Mae, TBA			
3,000 % fällig am 01.08.2048	\$ 6.600	\$ (6.388)	(1,00)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (6.388)	(1,00)
Summe Anlagen		\$ 789.415	123,63
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (150.892)	(23,63)
Nettovermögen		\$ 638.523	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) Nullkuponwertpapier.

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

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 78.825 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 5.243 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 6.040 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(h) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsge- schäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettover- mögens
DEU	1,900 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 12.500	U.S. Treasury Bond 3,375 % fällig am 15.05.2044	\$ (12.684)	\$ 12.500	\$ 12.501	1,96
RDR	2,220	29.06.2018	02.07.2018	7.900	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.08.2020	(8.072)	7.900	7.901	1,24
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	145	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.01.2022	(150)	145	145	0,02
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (20.906)	\$ 20.545	\$ 20.547	3,22

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 24.063	\$ 775.356	\$ 0	\$ 799.419
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.654)	(1.962)	0	(3.616)
Leerverkäufe	0	(6.388)	0	(6.388)
<b>Summen</b>	<b>\$ 22.409</b>	<b>\$ 767.006</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 789.415</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 24.098	\$ 578.757	\$ 0	\$ 602.855
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	8	22.111	0	22.119
Leerverkäufe	0	(12.086)	0	(12.086)
<b>Summen</b>	<b>\$ 24.106</b>	<b>\$ 588.782</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 612.888</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 der Wertpapieranlagen.

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	1,980 %	01.05.2018	02.07.2018	\$ (18.357)	\$ (18.419)	(2,88)
	2,000	08.05.2018	09.07.2018	(1.036)	(1.039)	(0,16)
	2,170	12.06.2018	12.07.2018	(1.706)	(1.708)	(0,27)
BPS	2,180	20.06.2018	05.07.2018	(4.882)	(4.885)	(0,76)
	(0,450)	19.04.2018	19.07.2018	€ (1.508)	(1.759)	(0,27)
	1,990	27.04.2018	27.07.2018	\$ (1.035)	(1.039)	(0,16)
GRE	2,040	10.05.2018	17.07.2018	(933)	(935)	(0,15)
	2,060	20.06.2018	23.07.2018	(2.597)	(2.598)	(0,41)
	2,110	08.06.2018	09.07.2018	(1.789)	(1.791)	(0,28)
IND	2,130	11.06.2018	11.07.2018	(25.108)	(25.137)	(3,94)
	2,160	13.06.2018	05.07.2018	(2.535)	(2.538)	(0,40)
	2,040	11.05.2018	11.07.2018	(1.360)	(1.364)	(0,21)
SCX	2,120	05.06.2018	06.08.2018	(13.046)	(13.066)	(2,05)
	2,160	13.06.2018	13.08.2018	(2.535)	(2.538)	(0,40)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (78.816)</b>	<b>(12,34)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (174)	\$ 410	\$ 236
BPS	107	480	587
BRC	(11)	0	(11)
CBK	(502)	1.720	1.218
CIB	(96)	360	264
CKL	(16)	0	(16)
DUB	9	0	9
FBF	(73)	270	197
GLM	101	(300)	(199)
GST	(493)	1.460	967
HUS	455	(380)	75
JPM	(131)	1.030	899
MEI	(106)	200	94
MSB	112	0	112
MYC	(26)	(96)	(122)
NGF	17	0	17
RBC	2	0	2
RYL	34	0	34
SCX	(644)	110	(534)
SOG	(13)	0	(13)
SSB	51	0	51
UAG	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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	94,67	57,84
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	15,01	53,49
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	15,52	4,93
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,26)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,09)	(0,11)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,22)	4,38
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,00)	(2,33)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(12,34)	(9,29)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Commodity Real Return Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2021 (a)	\$	28.685	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£	13.416
United Kingdom Gilt 1,875 % fällig am 22.11.2022	£	15.278	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 28.02.2022	\$	9.300
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (a)	\$	22.406	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2024		7.700
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2019	€	18.223	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.12.2024		5.900
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2020 (a)	\$	20.352	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (a)		5.841
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (a)		16.190	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2023	€	4.604
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£	9.426	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2027	¥	544.216
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€	8.307	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2022	€	3.937
France Government International Bond 1,850 % fällig am 25.07.2027		7.117	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2020 (a)	\$	4.836
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 21.06.2018	\$	9.500	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2019 (a)		4.715
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.01.2018	¥	950.000	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (a)		4.662
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.07.2018		950.000	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 15.05.2024		4.550
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2021 (a)	\$	8.205	Letras del Banco Central de la Republica Argentina 1,000 % fällig am 16.05.2018	ARS	94.010
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2025	€	6.372	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (a)	\$	4.136
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (a)	\$	6.767	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€	2.812
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	¥	700.000	U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.05.2048	\$	3.800
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.09.2018		645.900	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,100 % fällig am 15.09.2026	€	2.514
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2023	€	4.581	Letras del Banco Central de Argentina 0,010 % fällig am 18.04.2018	ARS	52.570
U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.12.2024	\$	5.900	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,250 % fällig am 15.07.2020 (a)	\$	2.422
Letras del Banco Central de la Republica Argentina 1,000 % fällig am 16.05.2018	ARS	94.010	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2021 (a)		2.430
Australia Government International Bond 1,250 % fällig am 21.02.2022	AUD	5.000	France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2021	€	1.860
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a)	\$	4.246	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a)	\$	2.013
U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.05.2048		3.800	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (a)		1.744
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,100 % fällig am 15.09.2026	€	2.509	Letras del Banco Central de la Republica Argentina 1,000 % fällig am 21.06.2018	ARS	46.020
			United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2046	£	674

(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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Absolute Return 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
Blackstone CQP Holdco LP				MGM Resorts International				Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
6,500 % fällig am 20.03.2021	\$ 2.677	\$ 2.690	1,47	4,625 % fällig am 01.09.2026	\$ 1.600	\$ 1.488	0,81	4,137 % fällig am 25.07.2036 ^	\$ 162	\$ 153	0,08
Blue Racer Midstream LLC				6,000 % fällig am 15.03.2023	1.600	1.652	0,90	Citigroup Mortgage Loan Trust			
6,625 % fällig am 15.07.2026	700	695	0,38	Mueller Water Products, Inc.				3,837 % fällig am 25.09.2037 ^	77	67	0,04
Brand Industrial Services, Inc.				5,500 % fällig am 15.06.2026	200	202	0,11	Countrywide Alternative Loan Trust			
8,500 % fällig am 15.07.2025	815	828	0,45	Navient Corp.				2,274 % fällig am 20.09.2046	31	26	0,01
Cantor Fitzgerald LP				6,500 % fällig am 15.06.2022	950	974	0,53	2,281 % fällig am 25.09.2046 ^	14	13	0,01
7,875 % fällig am 15.10.2019	1.200	1.255	0,69	8,000 % fällig am 25.03.2020	200	212	0,12	2,958 % fällig am 25.08.2035	29	30	0,02
Centene Escrow Corp.				Olin Corp.				3,391 % fällig am 25.10.2035 ^	26	24	0,01
5,375 % fällig am 01.06.2026	300	305	0,17	5,000 % fällig am 01.02.2030	500	473	0,26	5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	558	484	0,26
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC				Omega Healthcare Investors, Inc.				6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	252	248	0,14
5,875 % fällig am 31.03.2025	600	626	0,34	4,750 % fällig am 15.01.2028	600	580	0,32	6,500 % fällig am 25.08.2037 ^	2.431	1.806	0,99
Community Health Systems, Inc.				Oppenheimer Holdings, Inc.				14,049 % fällig am 25.07.2035	331	372	0,20
5,125 % fällig am 01.08.2021	350	326	0,18	6,750 % fällig am 01.07.2022	1.200	1.231	0,67	20,035 % fällig am 25.09.2037	491	636	0,35
6,250 % fällig am 31.03.2023	300	276	0,15	Oxford Finance LLC				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
8,625 % fällig am 15.01.2024 (a)	400	402	0,22	6,375 % fällig am 15.12.2022	425	432	0,24	3,473 % fällig am 25.09.2037 ^	423	407	0,22
Core & Main LP				Protective Life Global Funding				5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	17	15	0,01
6,125 % fällig am 15.08.2025	700	667	0,36	1,999 % fällig am 14.09.2021	200	192	0,11	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
Covey Park Energy LLC				Quicken Loans, Inc.				6,000 % fällig am 25.09.2035	359	274	0,15
7,500 % fällig am 15.05.2025	700	717	0,39	5,250 % fällig am 15.01.2028	1.500	1.389	0,76	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
CPG Merger Sub LLC				Radiate Holdco LLC				3,151 % fällig am 29.12.2037	1.161	968	0,53
8,000 % fällig am 01.10.2021	1.485	1.511	0,83	6,875 % fällig am 15.02.2023	1.200	1.158	0,63	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
Crown Americas LLC				RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				6,000 % fällig am 25.07.2036	233	195	0,11
4,750 % fällig am 01.02.2026	700	667	0,36	8,250 % fällig am 01.05.2023	850	898	0,49	6,500 % fällig am 25.10.2021 ^	219	161	0,09
DAE Funding LLC				Rio Oil Finance Trust				Deutsche ALT-A Securities, Inc.			
4,500 % fällig am 01.08.2022	1.175	1.143	0,63	9,250 % fällig am 06.07.2024	1.158	1.245	0,68	2,231 % fällig am 25.07.2047	30	28	0,01
5,000 % fällig am 01.08.2024	300	289	0,16	Sanchez Energy Corp.				2,241 % fällig am 25.02.2047	5.728	4.748	2,59
Dall International LLC				7,250 % fällig am 15.02.2023	700	696	0,38	2,281 % fällig am 25.10.2036 ^	247	134	0,07
6,020 % fällig am 15.06.2026	1.100	1.157	0,63	7,750 % fällig am 15.06.2021	500	429	0,23	2,974 % fällig am 25.08.2035 ^	32	27	0,01
Diamond Resorts International, Inc.				Six Flags Entertainment Corp.				First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
7,750 % fällig am 01.09.2023	700	736	0,40	5,500 % fällig am 15.04.2027	600	584	0,32	3,324 % fällig am 25.08.2035 ^	17	15	0,01
10,750 % fällig am 01.09.2024	350	377	0,21	Springleaf Finance Corp.				First Horizon Asset Securities, Inc.			
Diamondback Energy, Inc.				6,000 % fällig am 01.06.2020	1.500	1.545	0,84	5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	76	67	0,04
5,375 % fällig am 31.05.2025	600	601	0,33	Sprint Corp.				Impac Secured Assets Trust			
DISH DBS Corp.				7,250 % fällig am 15.09.2021	2.100	2.189	1,20	2,241 % fällig am 25.11.2036	777	697	0,38
7,875 % fällig am 01.09.2019	800	832	0,46	Standard Industries, Inc.				IndyMac Mortgage Loan Trust			
DriveTime Automotive Group, Inc.				4,750 % fällig am 15.01.2028	700	646	0,35	2,341 % fällig am 25.02.2037	47	33	0,02
8,000 % fällig am 01.06.2021	850	863	0,47	Starwood Property Trust, Inc.				3,241 % fällig am 25.12.2034	564	549	0,30
Equinix, Inc.				4,750 % fällig am 15.03.2025	525	505	0,28	3,786 % fällig am 25.05.2037 ^	135	120	0,07
2,875 % fällig am 15.03.2024	€ 1.400	1.607	0,88	Stearns Holdings LLC				JPMorgan Alternative Loan Trust			
2,875 % fällig am 01.02.2026	800	885	0,48	9,375 % fällig am 15.08.2020	2.942	2.957	1,62	3,381 % fällig am 25.11.2036 ^	129	134	0,07
ESH Hospitality, Inc.				Targa Resources Partners LP				JPMorgan Mortgage Trust			
5,250 % fällig am 01.05.2025	\$ 1.200	1.161	0,63	5,000 % fällig am 15.01.2028	1.100	1.026	0,56	6,500 % fällig am 25.07.2036 ^	340	259	0,14
Exeter Finance Corp.				Tenet Healthcare Corp.				Lehman XS Trust			
9,750 % fällig am 20.05.2019	3.300	3.294	1,80	8,125 % fällig am 01.04.2022	825	866	0,47	2,140 % fällig am 25.07.2037 ^	624	630	0,34
FBM Finance, Inc.				Univision Communications, Inc.				2,991 % fällig am 25.08.2047 ^	450	381	0,21
8,250 % fällig am 15.08.2021	950	994	0,54	5,125 % fällig am 15.02.2025	650	602	0,33	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
Flagstar Bancorp, Inc.				VICI Properties LLC				3,479 % fällig am 25.11.2037	387	361	0,20
6,125 % fällig am 15.07.2021	1.100	1.153	0,63	8,000 % fällig am 15.10.2023	76	85	0,05	Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				Washington Prime Group LP				2,441 % fällig am 25.08.2035 ^	52	46	0,02
6,750 % fällig am 15.03.2022	775	795	0,43	5,950 % fällig am 15.08.2024	1.400	1.351	0,74	2,841 % fällig am 25.11.2036 ^	1.185	891	0,49
Freedom Mortgage Corp.								4,330 % fällig am 25.07.2035	7	7	0,00
8,125 % fällig am 15.11.2024	1.500	1.459	0,80					4,523 % fällig am 25.12.2035 ^	36	33	0,02
GLP Capital LP								4,630 % fällig am 25.09.2035 ^	3	3	0,00
5,250 % fällig am 01.06.2025	675	678	0,37					Residential Asset Securitization Trust			
Howard Hughes Corp.								5,750 % fällig am 25.03.2037 ^	296	193	0,11
5,375 % fällig am 15.03.2025	650	639	0,35					6,000 % fällig am 25.02.2036	423	326	0,18
Intrepid Aviation Group Holdings LLC								6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	547	369	0,20
6,875 % fällig am 15.02.2019	1.301	1.303	0,71					Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
Jefferies Finance LLC								2,331 % fällig am 25.05.2037 ^	191	196	0,11
6,875 % fällig am 15.04.2022	1.225	1.228	0,67					Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
7,375 % fällig am 01.04.2020	685	692	0,38					2,541 % fällig am 25.05.2035 ^	2.785	2.376	1,30
Jeld-Wen, Inc.											
4,625 % fällig am 15.12.2025	1.100	1.050	0,57								
4,875 % fällig am 15.12.2027	500	466	0,25								
Kennedy-Wilson, Inc.											
5,875 % fällig am 01.04.2024	1.400	1.365	0,75								
Kinetic Concepts Inc.											
12,500 % fällig am 01.11.2021	925	1.027	0,56								
Live Nation Entertainment, Inc.											
5,625 % fällig am 15.03.2026	1.000	995	0,54								
Matterhorn Merger Sub LLC											
8,500 % fällig am 01.06.2026	600	580	0,32								



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Absolute Return Fund (Forts.)

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	1,000 %	20.06.2019	€ 100	\$ 0	0,00
DISH DBS Corp.	5,000	20.12.2022	\$ 1.000	(74)	(0,04)
MBA, Inc.	5,000	20.12.2019	800	116	0,06
				\$ 42	0,02

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2022	€ 6.100	\$ 73	0,04

## 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.EM-29 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 1.300	\$ (26)	(0,01)
CDX.HY-30 5-Year Index	5,000	20.06.2023	2.400	(14)	(0,01)
CDX.IG-30 5-Year Index	1,000	20.06.2023	18.000	(36)	(0,02)
				\$ (76)	(0,04)

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,500 %	02.01.2020	BRL 30.100	\$ (69)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,033	04.01.2021	20.500	(112)	(0,06)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	21.06.2022	\$ 5.700	(131)	(0,07)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	19.09.2023	ZAR 22.700	(40)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	19.09.2028	14.400	(48)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	€ 2.900	(68)	(0,04)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	£ 11.200	106	0,06
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	200	2	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	3.700	47	0,03
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month HUF-BBR	1,000	19.09.2023	HUF 159.000	(25)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	486.500	(79)	(0,04)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 310.000	(7)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	299.100	(11)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,415	25.03.2029	40.000	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,630	11.10.2021	MXN 96.200	(306)	(0,17)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,750	30.09.2021	35.900	(119)	(0,07)
					\$ (863)	(0,47)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (839)</b>	<b>(0,46)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

## OPTIONSKAUF

### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variable Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,450 %	29.01.2019	\$ 4.500	\$ 11	\$ 4	0,01
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,940	18.02.2020	6.300	46	38	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,945	09.12.2019	800	39	52	0,03
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,945	11.12.2019	300	14	20	0,01

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettvermögens
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,000 %	27.11.2018	\$ 15.900	\$ 39	\$ 1	0,00
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,000	04.12.2018	3.800	8	0	0,00
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,930	09.12.2019	1.100	51	74	0,04
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,943	12.12.2019	300	14	20	0,01
							\$ 222	\$ 209	0,12

## VERKAUFSOPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,700 %	18.07.2018	\$ 1.000	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	1.700	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,700	15.08.2018	200	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.08.2018	600	(1)	0	0,00
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	1.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	800	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	1.200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	1,000	15.08.2018	€ 1.100	(2)	(1)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 300	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 1.100	(2)	(3)	0,00
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.07.2018	\$ 900	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.08.2018	1.600	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	400	(1)	(1)	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	€ 1.200	(3)	(5)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 1.100	(2)	(3)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	\$ 800	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	600	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	€ 500	(1)	(1)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.07.2018	\$ 1.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	€ 400	(1)	(1)	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	\$ 300	0	0	0,00
MEI	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 1.200	(2)	(3)	0,00
						\$ (29)	\$ (23)	(0,01)

## DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
BOA	Call - OTC USD versus BRL	BRL 3,700	12.07.2018	\$ 2,015	\$ (18)	\$ (82)	(0,05)
CBK	Call - OTC USD versus BRL	3,700	12.07.2018	92	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 20,500	09.07.2018	1,030	(10)	(3)	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	20,650	09.08.2018	1,062	(13)	(8)	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	20,300	03.10.2018	1,139	(25)	(27)	(0,02)
					\$ (67)	\$ (124)	(0,07)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750 %	09.12.2019	\$ 3,500	\$ (38)	\$ (73)	(0,04)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	11.12.2019	1,300	(14)	(27)	(0,02)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,553	29.01.2019	900	(11)	(4)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,086	18.02.2020	600	(46)	(44)	(0,02)
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180	27.11.2018	1,100	(11)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,200	27.11.2018	1,100	(14)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,210	27.11.2018	1,100	(14)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,173	04.12.2018	800	(8)	(1)	0,00
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	09.12.2019	4,800	(51)	(100)	(0,05)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	12.12.2019	1,300	(14)	(27)	(0,02)
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,835	11.07.2018	800	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,085	11.07.2018	800	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,770	02.07.2018	1,100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,010	02.07.2018	1,100	(1)	0	0,00
						\$ (225)	\$ (279)	(0,15)	

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 Nettvermögens
BOA	Petrobras Global Finance BV	1,000 %	20.06.2023	\$ 800	\$ (82)	\$ (4)	\$ (86)	(0,05)
CBK	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2023	400	(24)	(1)	(25)	(0,01)
HUS	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	800	(89)	4	(85)	(0,05)
					\$ (195)	\$ (1)	\$ (196)	(0,11)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Absolute 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.BBB-.7 Index	3,000 %	17.01.2047	\$ 675	\$ (67)	\$ 20	\$ (47)	(0,03)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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
FBF	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,280 %	14.11.2021	CLP 1.911.600	\$ 0	\$ (28)	\$ (28)	(0,02)
GLM	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,520	16.11.2022	320.200	0	(5)	(5)	0,00
						\$ 0	\$ (33)	\$ (33)	(0,02)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07/2018	\$ 1.324	BRL 5.007	\$ 0	\$ (23)	\$ (23)	(0,01)
	08/2018	BRL 5.007	\$ 1.320	24	0	24	0,01
	08/2018	ZAR 1.573	122	8	0	8	0,00
	09/2018	SGD 3.849	2.898	71	0	71	0,04
	01/2019	\$ 411	EGP 7.698	0	(7)	(7)	0,00
BPS	07/2018	ARS 15.565	\$ 562	28	0	28	0,01
	07/2018	€ 5.898	6.841	0	(45)	(45)	(0,03)
	07/2018	\$ 567	ARS 15.565	0	(28)	(28)	(0,02)
	08/2018	HUF 13.403	\$ 52	4	0	4	0,00
	09/2018	\$ 565	INR 38.621	0	(7)	(7)	0,00
BRC	07/2018	ARS 26.040	\$ 976	86	0	86	0,05
CBK	07/2018	\$ 658	RUB 41.624	5	0	5	0,00
	08/2018	HUF 21.787	\$ 81	3	0	3	0,00
	08/2018	MXN 48.006	2.343	2	(81)	(79)	(0,04)
	08/2018	RUB 47.774	740	0	(18)	(18)	(0,01)
	08/2018	\$ 176	MXN 3.506	1	0	1	0,00
	08/2018	2.296	TRY 10.162	0	(118)	(118)	(0,06)
	11/2018	NGN 3.601	\$ 10	0	0	0	0,00
DUB	07/2018	ARS 15.565	558	19	0	19	0,01
	07/2018	TRY 5.216	1.058	0	(72)	(72)	(0,04)
FBF	07/2018	\$ 703	COP 2.024.919	0	(15)	(15)	(0,01)
GLM	07/2018	BRL 5.374	\$ 1.420	23	0	23	0,01
	07/2018	COP 44.784	16	1	0	1	0,00
	07/2018	£ 746	995	10	0	10	0,01
	07/2018	¥ 8.200	75	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 688	€ 589	0	0	0	0,00
	07/2018	620	£ 470	0	0	0	0,00
	08/2018	INR 28.243	\$ 407	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	RUB 20.068	317	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	ZAR 3.563	257	0	(2)	(2)	0,00
	09/2018	INR 18.212	262	0	(2)	(2)	0,00
HUS	07/2018	RUB 41.624	660	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	\$ 496	BRL 1.847	0	(16)	(16)	(0,01)
	07/2018	25	€ 22	0	0	0	0,00
	08/2018	1.971	RUB 123.723	3	(11)	(8)	0,00
	08/2018	409	ZAR 5.203	0	(31)	(31)	(0,02)
	09/2018	CNH 804	\$ 126	5	0	5	0,00
	10/2018	NGN 21.609	58	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07/2018	BRL 1.480	392	7	0	7	0,00
	07/2018	CAD 157	121	2	0	2	0,00
	07/2018	COP 1.996.344	714	35	0	35	0,02
	07/2018	NZD 1.003	706	27	0	27	0,01
	07/2018	\$ 123	€ 105	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	MXN 6.023	\$ 306	2	0	2	0,00
	08/2018	NGN 28.976	76	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	\$ 2.015	MXN 39.299	0	(33)	(33)	(0,02)
	08/2018	ZAR 1.747	\$ 137	10	0	10	0,01
	10/2018	NGN 85.872	228	0	(7)	(7)	0,00
	11/2018	13.942	37	0	(1)	(1)	0,00
	12/2018	19.646	52	0	(1)	(1)	0,00
NGF	10/2018	\$ 370	MXN 7.288	0	(4)	(5)	0,00
RBC	07/2018	TRY 2.427	\$ 535	9	0	10	0,01
RYL	09/2018	\$ 569	SGD 762	0	(9)	(9)	(0,01)
SCX	07/2018	NGN 11.211	\$ 29	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	\$ 690	NZD 1.001	0	(12)	(12)	(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
	08/2018	NGN 33.728	\$ 90	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	09/2018	KRW 245.127	\$ 228	7	0	7	0,00
	09/2018	NGN 54.050	\$ 143	0	(5)	(5)	0,00
	10/2018	26.562	70	0	(2)	(2)	0,00
	11/2018	6.974	19	0	0	0	0,00
	01/2019	\$ 259	EGP 4.841	0	(5)	(5)	0,00
SOG	09/2018	ARS 3.049	\$ 103	5	0	5	0,00
SSB	07/2018	\$ 6.058	€ 5.204	18	0	18	0,01
	08/2018	€ 5.204	\$ 6.071	0	(18)	(18)	(0,01)
				\$ 416	\$ (592)	\$ (176)	(0,10)

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CHF (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 7.765	CHF 7.647	\$ 0	\$ (64)	\$ (64)	(0,04)
CBK	07/2018	7.750	7.655	0	(41)	(41)	(0,02)
GLM	07/2018	CHF 7.686	\$ 7.701	1	(40)	(39)	(0,02)
	07/2018	\$ 7.743	CHF 7.662	0	(26)	(26)	(0,01)
	08/2018	7.660	7.626	40	0	40	0,02
JPM	07/2018	CHF 7.626	\$ 7.696	16	0	16	0,01
	08/2018	\$ 7.716	CHF 7.626	0	(17)	(17)	(0,01)
				\$ 57	\$ (188)	\$ (131)	(0,07)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 37.923	€ 32.307	\$ 0	\$ (203)	\$ (203)	(0,11)
BPS	07/2018	37.787	32.579	250	0	250	0,14
BRC	07/2018	€ 75	\$ 88	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 196	€ 169	2	0	2	0,00
CBK	07/2018	€ 557	\$ 653	4	(1)	3	0,00
	07/2018	\$ 6	€ 5	0	0	0	0,00
GLM	07/2018	€ 46	\$ 54	0	0	0	0,00
MSB	07/2018	30.806	35.581	0	(387)	(387)	(0,21)
	08/2018	\$ 35.660	€ 30.806	386	0	386	0,21
RBC	07/2018	€ 40	\$ 46	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	306	356	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 7	€ 6	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	€ 3.966	\$ 4.623	1	(8)	(7)	(0,01)
SSB	07/2018	30.801	35.856	0	(106)	(106)	(0,06)
	07/2018	\$ 37.911	€ 32.579	127	0	127	0,07
	08/2018	35.936	30.801	105	0	105	0,06
				\$ 876	\$ (706)	\$ 170	0,09

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (630) (0,35)

Summe Anlagen

\$ 207.249 113,26

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (24.267) (13,26)

Nettovermogen

\$ 182.982 100,00

#### ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (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) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Absolute Return Fund (Forts.)

## (i) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
AWAS Aviation Capital Ltd.	4,870 %	03.10.2021	02.10.2014	\$ 3.473	\$ 3.466	1,89
VICI Properties, Inc.			13.03.2017 - 06.11.2017	409	448	0,25
				\$ 3.882	\$ 3.914	2,14

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 32.727 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 2.623 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 1.030 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

## (k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
MBC	2,260 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 6.100	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 30.04.2025	\$ (6.294)	\$ 6.100	\$ 6.100	3,33
SSB	2,260	29.06.2018	02.07.2018	789	U.S. Treasury Notes 1,500% fällig am 31.01.2022	(807)	789	789	0,43
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (7.083)</b>	<b>\$ 6.889</b>	<b>\$ 6.889</b>	<b>3,76</b>

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

## Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 19.084	\$ 180.933	\$ 7.171	\$ 207.188
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.530	(1.469)	0	61
<b>Summen</b>	<b>\$ 20.614</b>	<b>\$ 179.464</b>	<b>\$ 7.171</b>	<b>\$ 207.249</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 6.043	\$ 292.826	\$ 9.139	\$ 308.008
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	703	2.050	0	2.753
<b>Summen</b>	<b>\$ 6.746</b>	<b>\$ 294.876</b>	<b>\$ 9.139</b>	<b>\$ 310.761</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 der Wertpapieranlagen.

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
GRE	2,040 %	10.05.2018	17.07.2018	\$ (32.744)	\$ (32.840)	(17,95)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (32.840)</b>	<b>(17,95)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (398)	\$ 710	\$ 312
BPS	199	0	199
BRC	86	0	86
CBK	(316)	320	4
CKL	(8)	0	(8)
DUB	(54)	(60)	(114)
FBF	(43)	0	(43)
GLM	(36)	0	(36)
GST	(48)	0	(48)
HUS	(140)	0	(140)
JPM	35	0	35

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
MEI	\$ (3)	\$ 0	\$ (3)
MSB	(1)	0	(1)
MYC	0	(77)	(77)
NGF	(5)	0	(5)
RBC	10	(20)	(10)
RYL	(10)	0	(10)
SCX	(29)	0	(29)
SOG	5	0	5
SSB	126	0	126

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	39,49	65,21
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	57,98	35,28
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	15,76	6,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,84	0,24
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,46)	(0,68)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,35)	1,39
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(17,95)	(10,43)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Credit Absolute Return Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	9.840.725	\$ 98.527
	<b>PARI (000S)</b>	
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
1,875 % fällig am 31.07.2022	\$ 24.400	23.997
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
2,500 % fällig am 31.03.2023	10.500	10.435
<b>Japan Treasury Bills</b>		
0,000 % fällig am 21.05.2018	¥ 910.000	8.568
<b>Kronos Acquisition Holdings, Inc.</b>		
9,000 % fällig am 15.08.2023	\$ 3.300	3.195
<b>Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.</b>		
6,720 % fällig am 01.12.2022	2.702	2.611
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
2,125 % fällig am 31.12.2022	2.500	2.486
<b>Viking Cruises Ltd.</b>		
5,875 % fällig am 15.09.2027	2.400	2.373
<b>Navient Corp.</b>		
6,625 % fällig am 26.07.2021	2.100	2.187
<b>Intesa Sanpaolo SpA</b>		
7,750 % fällig am 11.01.2027	€ 1.400	2.123
<b>Cheniere Corpus Christi Holdings LLC</b>		
5,875 % fällig am 31.03.2025	\$ 1.950	2.046
<b>Ambac LSNI LLC</b>		
7,337 % fällig am 12.02.2023	1.800	1.820
<b>BWAY Holding Co.</b>		
7,250 % fällig am 15.04.2025	1.700	1.785
<b>Equinix, Inc.</b>		
2,875 % fällig am 15.03.2024	€ 1.400	1.708
<b>Radiate Holdco LLC</b>		
6,875 % fällig am 15.02.2023	\$ 1.700	1.700
<b>MGM Resorts International</b>		
6,000 % fällig am 15.03.2023	1.600	1.678
<b>MGM Resorts International</b>		
4,625 % fällig am 01.09.2026	1.700	1.620
<b>Avon International Operations, Inc.</b>		
7,875 % fällig am 15.08.2022	1.500	1.539
<b>Sigma Bidco BV</b>		
0,000 % fällig am 06.03.2025	€ 1.200	1.481
<b>Argentina Government International Bond</b>		
5,875 % fällig am 11.01.2028	\$ 1.600	1.432

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	8.240.260	\$ 82.500
	<b>PARI (000S)</b>	
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
1,875 % fällig am 31.07.2022	\$ 36.200	35.036
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
1,125 % fällig am 31.08.2021	30.500	29.389
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
2,125 % fällig am 30.06.2022	14.900	14.572
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
2,500 % fällig am 31.03.2023	10.500	10.433
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
2,000 % fällig am 31.12.2021	7.905	7.685
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
1,750 % fällig am 30.09.2022	7.900	7.624
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
1,125 % fällig am 31.07.2021	7.200	6.878
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
1,750 % fällig am 30.06.2022	5.800	5.604
<b>Brand Industrial Services, Inc.</b>		
8,500 % fällig am 15.07.2025	3.000	3.110
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
1,750 % fällig am 31.12.2020	2.970	2.907
<b>Viking Cruises Ltd.</b>		
5,875 % fällig am 15.09.2027	2.900	2.797
<b>Kronos Acquisition Holdings, Inc.</b>		
9,000 % fällig am 15.08.2023	2.925	2.775
<b>Univision Communications, Inc.</b>		
5,125 % fällig am 15.02.2025	2.600	2.558
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
2,125 % fällig am 31.12.2022	2.500	2.433
<b>Intesa Sanpaolo SpA</b>		
7,750 % fällig am 11.01.2027	€ 1.400	2.110
<b>Genesis Energy LP</b>		
6,750 % fällig am 01.08.2022	\$ 2.000	2.096
<b>Dell International LLC</b>		
4,420 % fällig am 15.06.2021	1.800	1.831
<b>BWAY Holding Co.</b>		
7,250 % fällig am 15.04.2025	1.700	1.745
<b>Barclays PLC</b>		
7,250 % fällig am 15.03.2023	£ 1.100	1.685

(a) Der PIMCO Credit Absolute Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

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 UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>Madison Park Funding Ltd.</b>				<b>CURACAO</b>			
3,689 % fällig am 20.04.2026				\$ 3.100				3,689 % fällig am 20.04.2026			
								5.508			
								0,08			
<b>ARGENTINIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				<b>Argentina Government International Bond</b>				<b>Teva Pharmaceutical Finance BV</b>			
2,260 % fällig am 31.12.2038				€ 23.500				\$ 3.700			
3,375 % fällig am 15.01.2023				\$ 16.257				\$ 3.546			
5,000 % fällig am 15.01.2027				8.300				3,650 % fällig am 10.11.2021			
5,250 % fällig am 15.01.2028				8.831				2,984			
6,250 % fällig am 22.04.2019				14.600				3,650 % fällig am 18.12.2022			
7,820 % fällig am 31.12.2033				8.354				18.901			
				805				24.380			
				62.750				0,35			
Summe Argentinien				122.200				1,75			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>DÄNEMARK</b>			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>TORRENS Trust</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
3,265 % fällig am 16.05.2042				AUD 835				<b>TDC A/S</b>			
				618				5,625 % fällig am 23.02.2023			
				0,01				£ 7.100			
								9.970			
								0,14			
								11.548			
								0,17			
								6.200			
								5.217			
								9.200			
								8.165			
								5.300			
								4.984			
								10.923			
								0,16			
								29.289			
								0,42			
								2.800			
								19.332			
								2.850			
								2.832			
								2.200			
								2.177			
								0,03			
								44.200			
								44.408			
								35.262			
								0,50			
								800			
								779			
								0,01			
								£ 4.100			
								5.043			
								0,07			
								94			
								141			
								0,00			
								\$ 4.000			
								3.990			
								0,06			
								€ 10.000			
								11.310			
								0,16			
								18.900			
								22.394			
								0,32			
								192.060			
								2,74			
								197.568			
								2,82			
								Summe Cayman Inseln			
								197.568			
								2,82			
								<b>CHILE</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								<b>GNL Quintero S.A.</b>			
								4,634 % fällig am 31.07.2029			
								\$ 4.400			
								4.323			
								0,06			
								<b>CHINA</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								<b>CSCEC Finance Cayman Ltd.</b>			
								2,250 % fällig am 14.06.2019			
								300			
								296			
								0,01			
								<b>Sinopec Group Overseas Development Ltd.</b>			
								1,750 % fällig am 29.09.2019			
								1.500			
								1.473			
								0,02			
								Summe China			
								1.769			
								0,03			
								<b>KOLUMBIEN</b>			
								<b>STAAITSEMISSIONEN</b>			
								<b>Colombia Government International Bond</b>			
								5,000 % fällig am 15.06.2045			
								52.900			
								52.173			
								0,75			
								2.600			
								2.769			
								0,04			
								100			
								112			
								0,00			
								Summe Kolumbien			
								55.054			
								0,79			
								<b>KROATIEN</b>			
								<b>STAAITSEMISSIONEN</b>			
								<b>Croatia Government International Bond</b>			
								6,625 % fällig am 14.07.2020			
								2.800			
								2.949			
								0,04			
								<b>FRANKREICH</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								<b>Altice France S.A.</b>			
								5,375 % fällig am 15.05.2022			
								€ 600			
								721			
								0,01			
								5,625 % fällig am 15.05.2024			
								1.950			
								2.366			
								0,03			
								7,375 % fällig am 01.05.2026			
								\$ 46.911			
								46.041			
								0,66			
								<b>Crown European Holdings S.A.</b>			
								3,375 % fällig am 15.05.2025			
								€ 11.000			
								13.023			
								0,19			
								<b>La Mondiale SAM</b>			
								5,050 % fällig am 17.12.2025			
								13.265			
								16.644			
								0,24			
								<b>Peugeot S.A.</b>			
								2,000 % fällig am 20.03.2025			
								1.100			
								1.253			
								0,02			
								<b>Societe Generale S.A.</b>			
								8,250 % fällig am 29.11.2018			
								\$ 1.600			
								1.620			
								0,02			
								(h)(j)			
								81.668			
								1,17			
								<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
								<b>Numericable Group S.A.</b>			
								3,000 % fällig am 31.07.2025			
								€ 4.213			
								4.821			
								0,07			
								3,000 % fällig am 31.01.2026			
								22.400			
								25.612			
								0,36			
								4,844 % fällig am 31.07.2025			
								\$ 6.550			
								6.447			
								0,09			
								5,348 % fällig am 31.01.2026			
								597			
								588			
								0,01			
								37.468			
								0,53			
								Summe Frankreich			
								119.136			
								1,70			
								<b>DEUTSCHLAND</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								<b>ADLER Real Estate AG</b>			
								3,000 % fällig am 27.04.2026			
								€ 1.400			
								1.597			
								0,02			
								<b>Deutsche Bank AG</b>			
								3,150 % fällig am 22.01.2021			
								\$ 3.900			
								3.777			
								0,05			
								4,250 % fällig am 14.10.2021			
								46.600			
								45.976			
								0,66			
								<b>IHO Verwaltungs GmbH</b>			
								(3,750 % bar oder 4,500 % PIK)			
								3,750 % fällig am 15.09.2026 (d)			
								€ 29.850			
								35.546			
								0,51			
								<b>ProSiebenSat.1 Media SE</b>			
								2,625 % fällig am 15.04.2021			
								2.000			
								2.446			
								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
<b>National Fuel Gas Co.</b>				<b>Verizon Communications, Inc.</b>				<b>American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010</b>			
5,200 % fällig am 15.07.2025	\$ 2.910	\$ 2.994	0,04	4,125 % fällig am 16.03.2027	\$ 5.500	\$ 5.453	0,08	8,084 % fällig am 15.02.2050	\$ 5.400	\$ 8.769	0,12
<b>Navigent Corp.</b>				4,672 % fällig am 15.03.2055	6.500	5.797	0,08	<b>Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015</b>			
4,875 % fällig am 17.06.2019	33.734	33.945	0,49	5,012 % fällig am 21.08.2054	100	94	0,00	7,375 % fällig am 01.01.2033	3.050	3.397	0,05
5,000 % fällig am 26.10.2020	1.100	1.100	0,02	5,250 % fällig am 16.03.2037	6.700	6.901	0,10	7,750 % fällig am 01.01.2042	5.150	5.585	0,08
5,500 % fällig am 15.01.2019	100	101	0,00	5,500 % fällig am 16.03.2047	1.900	1.998	0,03	<b>Chicago, Illinois Waterworks Revenue Bonds, Series 2010</b>			
5,875 % fällig am 25.03.2021	4.200	4.279	0,06	<b>Vistra Energy Corp.</b>				6,642 % fällig am 01.11.2029	150	175	0,00
6,500 % fällig am 15.06.2022	8.200	8.405	0,12	7,375 % fällig am 01.11.2022	9.050	9.480	0,14	<b>Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010</b>			
6,625 % fällig am 26.07.2021	400	412	0,01	8,125 % fällig am 30.01.2026	9.100	9.919	0,14	6,630 % fällig am 01.02.2035	1.880	1.995	0,03
7,250 % fällig am 25.01.2022	5.700	5.985	0,09	<b>VMware, Inc.</b>				6,725 % fällig am 01.04.2035	900	961	0,01
8,000 % fällig am 25.03.2020	18.066	19.105	0,27	3,900 % fällig am 21.08.2027	1.000	925	0,01	7,350 % fällig am 01.07.2035	2.040	2.281	0,03
<b>Northwest Airlines Pass-Through Trust</b>				<b>Washington Prime Group LP</b>				<b>Los Angeles County, California Public Works Financing Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010</b>			
7,150 % fällig am 01.04.2021	186	191	0,00	5,950 % fällig am 15.08.2024	5.100	4.922	0,07	7,618 % fällig am 01.08.2040	1.500	2.215	0,03
<b>Oceaneering International, Inc.</b>				<b>Weyerhaeuser Co.</b>				<b>Massachusetts Port Authority Revenue Bonds, Series 2011</b>			
4,650 % fällig am 15.11.2024	2.243	2.146	0,03	7,950 % fällig am 15.03.2025	12.900	15.533	0,22	6,202 % fällig am 01.07.2031	500	585	0,01
<b>Oxford Finance LLC</b>				<b>Wynn Las Vegas LLC</b>				<b>Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010</b>			
6,375 % fällig am 15.12.2022	1.600	1.628	0,02	5,250 % fällig am 15.05.2027	13.200	12.358	0,18	6,655 % fällig am 01.04.2057	4.587	5.756	0,08
<b>Pitney Bowes, Inc.</b>				5,500 % fällig am 01.03.2025	49.500	48.757	0,70	<b>Riverside, California Electric Revenue Bonds, (BABs), Series 2010</b>			
3,625 % fällig am 15.09.2020	300	294	0,00	<b>ZF North America Capital, Inc.</b>				7,605 % fällig am 01.10.2040	2.200	3.224	0,05
<b>Plains All American Pipeline LP</b>				4,500 % fällig am 29.04.2022	4.138	4.217	0,06	<b>San Diego Redevelopment Agency, California Tax Allocation Bonds, Series 2010</b>			
3,600 % fällig am 01.11.2024	300	285	0,00	4,750 % fällig am 29.04.2025	8.329	8.340	0,12	7,625 % fällig am 01.09.2030	500	550	0,01
3,850 % fällig am 15.10.2023	100	98	0,00					7,750 % fällig am 01.09.2040	200	220	0,00
4,500 % fällig am 15.12.2026	800	784	0,01					<b>Texas Public Finance Authority Revenue Notes, Series 2014</b>			
5,750 % fällig am 15.01.2020	200	207	0,00					8,250 % fällig am 01.07.2024	1.990	2.026	0,03
<b>QEP Resources, Inc.</b>								<b>Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007</b>			
5,625 % fällig am 01.03.2026	6.600	6.344	0,09					7,467 % fällig am 01.06.2047	700	700	0,01
<b>Quicken Loans, Inc.</b>											
5,250 % fällig am 15.01.2028	14.100	13.057	0,19								
<b>QVC, Inc.</b>											
4,375 % fällig am 15.03.2023	9.723	9.617	0,14								
5,450 % fällig am 15.08.2034	8.000	7.409	0,11								
<b>Reliance Steel &amp; Aluminum Co.</b>											
4,500 % fällig am 15.04.2023	1.000	1.024	0,01								
<b>Rio Oil Finance Trust</b>											
9,250 % fällig am 06.07.2024	30.250	32.520	0,46								
9,750 % fällig am 06.01.2027	2.746	2.965	0,04								
<b>Rockies Express Pipeline LLC</b>											
5,625 % fällig am 15.04.2020	48.700	50.100	0,72								
6,000 % fällig am 15.01.2019	3.150	3.201	0,05								
6,850 % fällig am 15.07.2018	71.386	71.465	1,02								
<b>Sabine Pass Liquefaction LLC</b>											
5,000 % fällig am 15.03.2027	4.900	4.983	0,07								
5,625 % fällig am 01.02.2021	13.900	14.534	0,21								
5,625 % fällig am 15.04.2023	1.300	1.381	0,02								
5,625 % fällig am 01.03.2025	54.725	58.288	0,83								
5,750 % fällig am 15.05.2024	11.965	12.778	0,18								
5,875 % fällig am 30.06.2026	6.000	6.445	0,09								
<b>Springleaf Finance Corp.</b>											
5,250 % fällig am 15.12.2019	5.468	5.550	0,08								
6,000 % fällig am 01.06.2020	784	808	0,01								
6,125 % fällig am 15.05.2022	28.400	29.110	0,42								
6,875 % fällig am 15.03.2025	10.400	10.348	0,15								
7,125 % fällig am 15.03.2026	21.400	21.346	0,30								
7,750 % fällig am 01.10.2021	1.200	1.294	0,02								
8,250 % fällig am 15.12.2020	2.508	2.709	0,04								
<b>Sprint Communications, Inc.</b>											
7,000 % fällig am 15.08.2020	3.200	3.320	0,05								
<b>Sprint Spectrum Co. LLC</b>											
5,152 % fällig am 20.09.2029	11.800	11.593	0,17								
<b>Standard Industries, Inc.</b>											
5,500 % fällig am 15.02.2023	500	506	0,01								
<b>Sunoco Logistics Partners Operations LP</b>											
6,100 % fällig am 15.02.2042	800	806	0,01								
<b>Sunoco LP</b>											
4,875 % fällig am 15.01.2023	1.000	963	0,01								
<b>Tallgrass Energy Partners LP</b>											
5,500 % fällig am 15.01.2028	3.700	3.644	0,05								
<b>Tennessee Gas Pipeline Co. LLC</b>											
8,375 % fällig am 15.06.2032	1.451	1.807	0,03								
<b>Time Warner Cable LLC</b>											
5,875 % fällig am 15.11.2040	5.700	5.593	0,08								
6,750 % fällig am 15.06.2039	1.300	1.390	0,02								
<b>UAL Pass-Through Trust</b>											
7,336 % fällig am 02.01.2021	243	250	0,00								
<b>VEREIT Operating Partnership LP</b>											
4,125 % fällig am 01.06.2021	900	913	0,01								



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>Morgan Stanley Securitization Trust</b>				2,511 % fällig am 25.06.2044	\$ 755	\$ 733	0,01	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
2,270 % fällig am 26.01.2051	\$ 350	\$ 347	0,01	2,558 % fällig am 25.08.2046	899	848	0,01	<b>Letras del Banco Central de la Republica Argentina</b>			
<b>Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust</b>				2,731 % fällig am 25.01.2045	829	857	0,01	25,600 % fällig am 18.07.2018 ARS	39.975	\$ 1.358	0,02
4,463 % fällig am 25.08.2035	296	298	0,01	2,758 % fällig am 25.11.2042	12	11	0,00	25,650 % fällig am 15.08.2018	62.740	2.067	0,03
<b>Nomura Securitization Trust</b>				2,831 % fällig am 25.11.2034	708	699	0,01	40,700 % fällig am 18.07.2018	100.860	3.427	0,05
2,815 % fällig am 26.02.2037	4.995	5.010	0,07	2,867 % fällig am 25.01.2037 ^	29	28	0,00				
<b>Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>				2,958 % fällig am 25.04.2044	4	4	0,00				
2,371 % fällig am 25.12.2035	766	753	0,01	3,097 % fällig am 25.12.2036 ^	18	18	0,00	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
<b>Prime Mortgage Trust</b>				3,136 % fällig am 25.04.2037 ^	20	18	0,00	2,480 % fällig am 12.10.2018			
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	410	385	0,01	3,314 % fällig am 25.07.2037 ^	1.005	835	0,01	(f)(g)	\$ 4.500	4.450	0,06
<b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>				3,321 % fällig am 25.09.2036 ^	283	276	0,00	2,799 % fällig am 27.07.2018			
2,191 % fällig am 25.05.2037	738	682	0,01	3,346 % fällig am 25.05.2037 ^	33	28	0,00	(f)(g)	6.800	6.781	0,10
2,221 % fällig am 25.02.2037	722	702	0,01	3,358 % fällig am 25.08.2036 ^	126	123	0,00	2,827 % fällig am 14.09.2018			
2,231 % fällig am 25.01.2037	789	750	0,01	3,389 % fällig am 25.02.2037 ^	67	65	0,00	(f)(g)	5.800	5.753	0,08
2,241 % fällig am 25.02.2037	544	514	0,01	3,395 % fällig am 25.03.2036	402	382	0,01	3,025 % fällig am 16.11.2018			
2,241 % fällig am 25.02.2047	1.152	738	0,01	3,398 % fällig am 25.12.2035	189	190	0,00	(f)(g)	13.300	13.078	0,19
2,281 % fällig am 25.08.2036 ^	426	397	0,01	3,405 % fällig am 25.10.2036 ^	607	558	0,01	3,091 % fällig am 28.09.2018			
2,281 % fällig am 25.09.2036 ^	1.120	1.054	0,02	3,425 % fällig am 25.02.2033	28	28	0,00	(f)(g)	19.000	18.818	0,27
2,441 % fällig am 25.08.2035 ^	1.083	962	0,01	3,438 % fällig am 25.12.2036 ^	55	54	0,00	3,103 % fällig am 26.10.2018			
2,491 % fällig am 25.11.2036 ^	374	261	0,00	3,707 % fällig am 25.04.2035	39	40	0,00	(f)(g)	5.700	5.627	0,08
3,918 % fällig am 25.02.2035 ^	107	92	0,00	4,099 % fällig am 25.06.2037 ^	100	101	0,00	25,601 % fällig am 14.09.2018	ARS 176.752	5.663	0,08
5,500 % fällig am 25.03.2037 ^	175	158	0,00	<b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>				(f)(g)			
6,000 % fällig am 25.09.2035 ^	121	85	0,00	2,251 % fällig am 25.02.2037 ^	1.301	1.047	0,02				
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	856	787	0,01	2,541 % fällig am 25.05.2035 ^	464	396	0,01	<b>GREECE TREASURY BILLS</b>			
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^	2.056	1.891	0,03	5,500 % fällig am 25.02.2037 ^	933	884	0,01	0,742 % fällig am 06.07.2018			
6,250 % fällig am 25.03.2037 ^	354	316	0,01	5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	277	259	0,00	(f)(g)	€ 4.900	5.722	0,08
6,500 % fällig am 25.07.2037 ^	509	474	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	1.090	1.094	0,02	0,877 % fällig am 03.08.2018			
6,500 % fällig am 25.09.2037 ^	500	443	0,01	<b>Wells Fargo Alternative Loan Trust</b>				(f)(g)	14.400	16.807	0,24
<b>Residential Asset Securitization Trust</b>				5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	115	108	0,00	1,082 % fällig am 05.10.2018			
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	128	109	0,00	<b>Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust</b>				(f)(g)	7.100	8.271	0,12
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	314	265	0,00	3,589 % fällig am 25.11.2033	51	52	0,00	1,211 % fällig am 31.08.2018			
6,500 % fällig am 25.04.2037 ^	1.400	790	0,01	3,640 % fällig am 25.10.2036 ^	66	65	0,00	(f)(g)	17.400	20.294	0,29
<b>Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust</b>				3,680 % fällig am 25.11.2034	509	516	0,01	1,267 % fällig am 15.03.2019			
6,000 % fällig am 25.10.2036 ^	289	271	0,00	3,706 % fällig am 25.12.2036 ^	238	224	0,00	(f)(g)	13.900	16.120	0,23
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	230	219	0,00	3,713 % fällig am 25.11.2037 ^	301	289	0,01				
<b>Sequoia Mortgage Trust</b>				3,873 % fällig am 25.03.2035	668	678	0,01	Summe kurzfristige Instrumente			
3,398 % fällig am 20.01.2047 ^	11	9	0,00	3,881 % fällig am 25.04.2036	7	7	0,00				
<b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>				3,913 % fällig am 25.07.2036 ^	1.026	1.039	0,02	<b>AKTIEN</b>			
2,311 % fällig am 25.06.2037	295	283	0,00	3,933 % fällig am 25.04.2036 ^	684	696	0,01	<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
2,411 % fällig am 25.10.2035	171	167	0,00	3,970 % fällig am 25.04.2035	98	98	0,00	<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. -</b>			
3,444 % fällig am 25.11.2035 ^	90	84	0,00	4,003 % fällig am 25.04.2035	415	423	0,01	<b>PIMCO US Dollar Short-Term</b>			
3,650 % fällig am 25.11.2036 ^	852	829	0,01	4,093 % fällig am 25.10.2035	16	16	0,00	<b>Floating NAV Fund (i)</b>	14.034.952	140.532	2,01
3,720 % fällig am 25.10.2036 ^	168	152	0,00	4,097 % fällig am 25.10.2035	172	174	0,00	Summe Übertragbare Wertpapiere und			
3,742 % fällig am 25.09.2035	46	38	0,00	4,120 % fällig am 25.07.2036 ^	1.680	1.649	0,02	Geldmarktinstrumente – Amtliche			
3,763 % fällig am 25.09.2035	375	339	0,01	4,181 % fällig am 25.04.2036 ^	691	661	0,01	Börse/Geregelter Markt	\$ 7.196.081	102,82	
3,800 % fällig am 25.04.2035	22	22	0,00	4,222 % fällig am 25.04.2036 ^	28	26	0,00				
3,834 % fällig am 25.02.2035	555	554	0,01	4,323 % fällig am 25.05.2036 ^	461	472	0,01				
3,967 % fällig am 25.10.2037 ^	123	110	0,00	5,750 % fällig am 25.03.2036	6	6	0,00				
<b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>				6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	723	721	0,01				
2,271 % fällig am 25.07.2046	280	259	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2037	1.743	1.736	0,03				
2,271 % fällig am 25.09.2047	97	95	0,00								
2,281 % fällig am 25.06.2036	258	255	0,00								
2,281 % fällig am 25.09.2047	1.212	1.172	0,02	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>							
2,301 % fällig am 25.04.2036	143	133	0,00	<b>Fannie Mae, TBA</b>							
2,301 % fällig am 25.05.2036	90	81	0,00	3,000 % fällig am 12.07.2048	64.000	61.955	0,88				
2,391 % fällig am 25.08.2036 ^	643	468	0,01	3,500 % fällig am 12.07.2048	320.900	319.119	4,56				
2,745 % fällig am 19.10.2034	82	79	0,00								
2,785 % fällig am 19.03.2034	11	11	0,00								
<b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates</b>				Summe USA		2.668.237	38,12				
4,248 % fällig am 25.06.2033	35	34	0,00								
<b>Structured Asset Securities Corp. Trust</b>				<b>URUGUAY</b>							
5,500 % fällig am 25.12.2034	52	52	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
<b>SunTrust Alternative Loan Trust</b>				<b>Uruguay Government International Bond</b>							
2,741 % fällig am 25.12.2035 ^	567	470	0,01	7,625 % fällig am 21.03.2036	100	130	0,00				
5,750 % fällig am 25.12.2035 ^	652	612	0,01								
<b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>				<b>VENEZUELA</b>							
3,424 % fällig am 25.09.2037	96	96	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
<b>Wachovia Mortgage Loan Trust LLC</b>				<b>Venezuela Government International Bond</b>							
3,712 % fällig am 20.10.2035 ^	182	184	0,00	6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	2.651	709	0,01				
3,855 % fällig am 20.03.2037 ^	336	329	0,01	7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	16.792	4.596	0,07				
<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>				9,250 % fällig am 07.05.2028 ^	7.813	2.154	0,03				
2,145 % fällig am 27.02.2034	385	382	0,01	Summe Venezuela		7.459	0,11				
2,274 % fällig am 25.12.2046	135	133	0,00								
2,274 % fällig am 25.07.2047	879	807	0,01	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
2,314 % fällig am 25.05.2046	122	115	0,00	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (o)</b>							
2,381 % fällig am 25.10.2045	89	89	0,00								
2,395 % fällig am 25.10.2046	44	43	0,00								

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income 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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	156	\$ 244	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09/2018	282	881	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	156	790	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09/2018	7.361	23	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	4.482	(1.089)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	7.552	6.417	0,09
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09/2018	974	2.780	0,04
				\$ 10.046	0,14
<b>Summe der an einem gereglten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ 10.046</b>	<b>0,14</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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.06.2022	\$ 8.350	\$ (241)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2022	8.700	(13)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2023	29.500	(264)	(0,01)
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2023	2.200	(107)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2022	600	(9)	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2022	€ 26.200	193	0,00
Navient Corp.	5,000	20.12.2021	\$ 150	(2)	0,00
Navient Corp.	5,000	20.06.2022	3.500	(35)	0,00
Navient Corp.	5,000	20.12.2022	1.450	(9)	0,00
Novo Banco S.A.	5,000	20.12.2021	€ 5.000	824	0,01
Telefonica Emisiones S.A.U.	1,000	20.06.2023	24.300	(474)	(0,01)
Telefonica Emisiones S.A.U.	1,000	20.12.2022	16.100	(197)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2023	9.200	(222)	0,00
				\$ (556)	(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.EM-28 5-Year Index	1,000 %	20.12.2022	\$ 59.946	\$ (1.054)	(0,01)
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000	20.06.2023	752.900	(11.649)	(0,17)
CDX.HY-30 5-Year Index	5,000	20.06.2023	331.900	(602)	(0,01)
CDX.IG-30 5-Year Index	1,000	20.06.2023	351.000	(581)	(0,01)
				\$ (13.886)	(0,20)

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,750 %	20.06.2020	\$ 416.300	\$ (198)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	€ 210.500	(4.642)	(0,07)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.12.2028	73.200	(1.028)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	£ 19.600	(186)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	59.100	(987)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	22.600	286	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	¥ 11.990.000	(535)	(0,01)
					\$ (7.290)	(0,10)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (21.732)</b>	<b>(0,31)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

## VERKAUFSOPTIEN

## CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/		Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
		-verkauf	Ausübungskurs					
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	15.08.2018	€ 115.600	\$ (253)	\$ (160)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	1,000	15.08.2018	31.000	(59)	(24)	0,00
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	32.100	(81)	(44)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.08.2018	32.100	(53)	(33)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	31.600	(66)	(119)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	93.500	(217)	(234)	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.08.2018	31.000	(50)	(32)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	92.300	(247)	(348)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	120.900	(245)	(303)	(0,01)
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	92.100	(202)	(190)	0,00
GST	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	32.000	(97)	(80)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	62.800	(144)	(129)	0,00
						\$ (1.714)	\$ (1.696)	(0,02)

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)	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
					Abschlussprämien			
BRC	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2022	\$ 350	\$ (21)	\$ 5	\$ (16)	0,00
	Kazakhstan Government International Bond	1,000	20.12.2020	7.500	(591)	694	103	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.09.2022	12.500	(458)	391	(67)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	27.520	(1.082)	92	(990)	(0,01)
	Peru Government International Bond	1,000	20.03.2023	7.400	(201)	252	51	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2022	11.500	(652)	304	(348)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	42.400	(3.038)	(14)	(3.052)	(0,04)
GST	Brazil Government International Bond	0,000	20.06.2023	16.800	(924)	(311)	(1.235)	(0,02)
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	29.580	(1.163)	99	(1.064)	(0,02)
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2020	18.050	(1.836)	1.859	23	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2022	21.300	(643)	483	(160)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2022	500	(28)	13	(15)	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.12.2021	100	(3)	14	11	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.06.2022	400	34	9	43	0,00
HUS	Argentine Republic Government International Bond	0,000	20.12.2018	1.600	17	3	20	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	7.600	(482)	(77)	(559)	(0,01)
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2024	93.700	(766)	(2.826)	(3.592)	(0,05)
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2021	19.700	(1.431)	1.410	(21)	0,00
JPM	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	800	(49)	12	(37)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2020	20.600	(2.257)	2.283	26	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2021	500	(36)	35	(1)	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.12.2021	200	(8)	29	21	0,00
	UniCredit SpA	1,000	20.12.2022	€ 5.800	(395)	(223)	(618)	(0,01)
MYC	Novo Banco S.A.	5,000	20.12.2021	600	(166)	136	(30)	0,00
UAG	Mexico Government International Bond	1,000	20.09.2022	\$ 8.900	(326)	278	(48)	0,00
	Park Aerospace Holdings Ltd.	5,000	01.07.2020	600	35	(12)	23	0,00
					\$ (16.470)	\$ 4.938	\$ (11.532)	(0,17)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene)	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
							Abschlussprämien			
GST	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	€ 16.300	20.09.2018	\$ 1	\$ (33)	\$ (32)	0,00
	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	56.600	20.09.2018	52	102	154	0,00
MYC	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	16.600	20.12.2018	2	3	5	0,00
							\$ 55	\$ 72	\$ 127	0,00

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
								BOA	07/2018
	07/2018		20.286	€	17.218	0	(183)	(183)	0,00
	08/2018	AUD	1.293	\$	955	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	€	5.100		6.355	387	0	387	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen 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
	08/2018	\$ 9.189	RUB 575.048	\$ 0	\$ (68)	\$ (68)	0,00
	09/2018	SGD 351	\$ 265	6	0	6	0,00
	10/2018	€ 5.100	\$ 6.361	364	0	364	0,01
BPS	07/2018	\$ 5.161	¥ 560.561	0	(100)	(100)	0,00
	08/2018	ARS 62.740	\$ 2.914	831	0	831	0,01
	08/2018	\$ 2.453	RUB 153.484	0	(19)	(19)	0,00
	09/2018	€ 295	INR 20.168	0	(4)	(4)	0,00
	02/2019	€ 49.460	\$ 59.078	244	0	244	0,00
BRC	07/2018	RUB 808.672	\$ 12.862	0	(26)	(26)	0,00
	07/2018	\$ 563.911	£ 431.104	5.353	(98)	5.255	0,08
	08/2018	£ 425.086	\$ 556.642	0	(5.339)	(5.339)	(0,08)
	08/2018	\$ 11.490	MXN 219.119	0	(438)	(438)	(0,01)
	08/2018	12.802	RUB 808.672	25	0	25	0,00
CBK	07/2018	CAD 62.823	\$ 48.256	499	0	499	0,01
	07/2018	\$ 356	ARS 9.280	0	(39)	(39)	0,00
	07/2018	€ 8.086	€ 6.830	0	(112)	(112)	0,00
	07/2018	€ 3.194	£ 2.378	0	(55)	(55)	0,00
	09/2018	KRW 949.900	\$ 888	33	0	33	0,00
	09/2018	\$ 24.590	RUB 1.547.411	0	(94)	(94)	0,00
DUB	07/2018	ARS 65.775	\$ 2.332	88	0	88	0,00
	07/2018	€ 4.900	\$ 6.093	371	0	371	0,01
GLM	07/2018	BRL 102.724	26.979	283	0	283	0,00
	07/2018	€ 30.546	35.715	116	(65)	51	0,00
	07/2018	\$ 13.580	BRL 51.362	0	(234)	(234)	0,00
	07/2018	€ 11.713	€ 9.926	0	(124)	(124)	0,00
	07/2018	5.482	£ 4.094	0	(77)	(77)	0,00
	07/2018	12.662	RUB 808.672	226	0	226	0,00
	08/2018	RUB 4.608.945	\$ 73.307	202	0	202	0,00
	08/2018	\$ 13.359	BRL 51.362	0	(57)	(57)	0,00
	08/2018	14.199	RUB 888.606	0	(104)	(104)	0,00
	08/2018	34.363	TRY 158.899	0	(384)	(384)	(0,01)
HUS	07/2018	ARS 57.305	\$ 2.708	753	0	753	0,01
	07/2018	AUD 90	67	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 309	ARS 8.050	0	(34)	(34)	0,00
	07/2018	43	AUD 58	0	0	0	0,00
	07/2018	302	BRL 1.125	0	(10)	(10)	0,00
	07/2018	47.218	CAD 62.823	540	0	540	0,01
	07/2018	1.407	€ 1.214	11	0	11	0,00
	07/2018	6	£ 5	0	0	0	0,00
	08/2018	CAD 62.823	\$ 47.244	0	(538)	(538)	(0,01)
	08/2018	\$ 134	RUB 8.348	0	(1)	(1)	0,00
	03/2019	€ 11.653	\$ 14.854	965	0	965	0,01
JPM	07/2018	AUD 1.293	974	18	0	18	0,00
	07/2018	\$ 74.674	€ 63.724	107	(380)	(273)	0,00
	08/2018	25.498	MXN 497.292	0	(415)	(415)	(0,01)
	08/2018	668	ZAR 8.525	0	(49)	(49)	0,00
MSB	07/2018	13.671	BRL 50.237	0	(613)	(613)	(0,01)
	07/2018	1.365.927	€ 1.182.621	14.843	0	14.843	0,21
	07/2018	1.791	PLN 6.085	0	(165)	(165)	0,00
	08/2018	€ 1.181.155	\$ 1.367.241	0	(14.812)	(14.812)	(0,21)
	08/2018	\$ 10.700	RUB 669.392	0	(82)	(82)	0,00
NGF	07/2018	ARS 35.085	\$ 1.234	37	0	37	0,00
	09/2018	TWD 1.079.097	35.522	0	(59)	(59)	0,00
RBC	08/2018	€ 3.287	4.125	278	0	278	0,00
RYL	10/2018	1.990	2.472	132	0	132	0,00
SCX	07/2018	£ 438.359	582.748	4.004	0	4.004	0,06
	07/2018	\$ 1.037	£ 783	0	(3)	(3)	0,00
SSB	07/2018	€ 1.249.773	\$ 1.454.305	0	(4.868)	(4.868)	(0,07)
	09/2018	\$ 214	MYR 856	0	(2)	(2)	0,00
TOR	07/2018	¥ 560.561	\$ 5.102	41	0	41	0,00
	08/2018	€ 17.296	21.411	1.130	0	1.130	0,02
	08/2018	\$ 5.113	¥ 560.561	0	(42)	(42)	0,00
UAG	02/2019	€ 5.670	\$ 6.805	56	0	56	0,00
	02/2019	\$ 31.028	€ 24.480	0	(1.890)	(1.890)	(0,03)
	03/2019	€ 2.074	\$ 2.638	166	0	166	0,00
				\$ 32.110	\$ (31.584)	\$ 526	0,01

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen für die Class M Retail AUD (Hedged) 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	07/2018	\$ 4.250	AUD 5.648	\$ 0	\$ (78)	\$ (78)	0,00
BOA	07/2018	AUD 5.591	\$ 4.127	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	\$ 4.128	AUD 5.591	4	0	4	0,00
BRC	07/2018	1	1	0	0	0	0,00
GLM	07/2018	AUD 5.626	\$ 4.132	0	(24)	(24)	0,00
	07/2018	\$ 4.260	AUD 5.667	0	(73)	(73)	0,00
	08/2018	4.133	5.626	25	0	25	0,00
HUS	07/2018	4	5	0	0	0	0,00
JPM	07/2018	4.281	5.645	0	(110)	(110)	0,00
RBC	07/2018	66	90	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
RYL	07/2018	AUD 77	\$ 59	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
SCX	07/2018	3	2	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 2	AUD 3	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	2	3	0	0	0	0,00
TOR	07/2018	AUD 27	\$ 21	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 2	AUD 2	0	0	0	0,00
				\$ 31	\$ (289)	\$ (258)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional CHF (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	07/2018	\$ 4.143	CHF 4.080	\$ 0	\$ (34)	\$ (34)	0,00
CBK	07/2018	€ 934.512	\$ 1.087.304	0	(22)	(22)	0,00
GLM	07/2018	CHF 4.083	\$ 4.091	0	(21)	(21)	0,00
	07/2018	\$ 4.125	CHF 4.082	0	(14)	(14)	0,00
	08/2018	4.072	4.054	21	0	21	0,00
JPM	07/2018	CHF 4.051	\$ 4.088	9	0	9	0,00
	08/2018	\$ 4.099	CHF 4.051	0	(9)	(9)	0,00
SSB	07/2018	CHF 7	\$ 7	0	0	0	0,00
				\$ 30	\$ (100)	\$ (70)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative (EUR) Hedged Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 1.112.610	€ 949.916	\$ 0	\$ (3.535)	\$ (3.535)	(0,05)
BPS	07/2018	€ 934.512	\$ 1.087.304	0	(3.785)	(3.785)	(0,05)
	08/2018	\$ 1.089.725	€ 934.512	3.733	0	3.733	0,05
BRC	07/2018	€ 3.228	\$ 3.779	25	(14)	11	0,00
CBK	07/2018	11.624	13.468	17	(120)	(103)	0,00
	07/2018	\$ 9.231	€ 7.986	93	0	93	0,00
GLM	07/2018	€ 3.974	\$ 4.641	11	(10)	1	0,00
	07/2018	\$ 11.537	€ 9.867	0	(17)	(17)	0,00
MSB	07/2018	1.109.846	951.257	795	0	795	0,01
RBC	07/2018	€ 4.528	\$ 5.256	0	(31)	(31)	0,00
RYL	07/2018	22.527	26.332	37	(7)	30	0,00
SCX	07/2018	10.040	11.815	98	(5)	93	0,00
SSB	07/2018	933.829	1.081.654	0	(8.638)	(8.638)	(0,12)
	07/2018	\$ 1.103.317	€ 952.897	9.239	0	9.239	0,13
	08/2018	1.084.047	933.829	8.613	0	8.613	0,12
				\$ 22.661	\$ (16.162)	\$ 6.499	0,09

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und die Administrative GBP (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
AZD	07/2018	\$ 816	£ 608	\$ 0	\$ (13)	\$ (13)	0,00
BOA	07/2018	666.550	499.204	0	(7.475)	(7.475)	(0,11)
BPS	07/2018	£ 54	\$ 71	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 344	£ 261	1	0	1	0,00
BRC	07/2018	£ 496.158	\$ 648.805	0	(6.248)	(6.248)	(0,09)
	08/2018	\$ 649.694	£ 496.147	6.232	0	6.232	0,09
CBK	07/2018	£ 711	\$ 954	14	0	14	0,00
	07/2018	\$ 661.734	£ 499.470	0	(2.309)	(2.309)	(0,03)
GLM	07/2018	£ 2.919	\$ 3.892	39	0	39	0,00
RYL	07/2018	10	13	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	\$ 664.674	£ 499.986	0	(4.568)	(4.568)	(0,07)
SSB	07/2018	£ 1.157	\$ 1.517	1	(12)	(11)	0,00
	07/2018	\$ 126	£ 94	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07/2018	£ 496.266	\$ 656.188	993	0	993	0,01
	08/2018	\$ 657.117	£ 496.266	0	(1.034)	(1.034)	(0,01)
				\$ 7.280	\$ (21.661)	\$ (14.381)	(0,21)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional SEK (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	07/2018	\$ 5.628	SEK 50.000	\$ 0	\$ (39)	\$ (39)	0,00
GLM	07/2018	SEK 1.217	\$ 138	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 22.088	SEK 193.419	0	(468)	(468)	(0,01)
JPM	07/2018	21.857	193.663	0	(209)	(209)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen 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 Nettover- mögens
MSB	07/2018	SEK	208.828	\$	23.212	\$	0,00
	08/2018	\$	23.264	SEK	208.828	\$	0,00
RBC	07/2018	SEK	515	\$	59	\$	0,00
SCX	07/2018		208.765		23.445		0,00
	08/2018	\$	23.498	SEK	208.765	\$	0,00
SOG	07/2018		21.721		193.524		0,00
						\$	(0,01)
						\$	(21.587)
						\$	(0,31)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Credit Suisse AG			
2,722 % fällig am 28.09.2018	\$ 23.000	\$ 23.024	0,33
Summe Einlagenzertifikate		23.024	0,33
Summe Anlagen		7.185.832	102,67
Sonstige Aktiva und Passiva		(186.824)	(2,67)
Nettovermögen		6.999.008	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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

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

(i) Mit dem Fonds verbunden.

(j) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(k) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.	4,150 %	06.03.2019	16.01.2018	\$ 3.616	\$ 3.600	0,05

(l) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 17.665 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 186.161 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 63.599 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(m) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsge- schäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
MBC	2,260 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 103.000	U.S. Treasury Notes 2,000 % - 2,875 % fällig am 31.08.2021 - 30.04.2025	\$ (106.312)	\$ 103.000	\$ 103.013	1,47
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	37.653	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	(38.407)	37.653	37.653	0,54
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (144.719)	\$ 140.653	\$ 140.666	2,01

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

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 707.282	\$ 6.464.975	\$ 23.824	\$ 7.196.081
Einlagen bei Kreditinstituten	0	23.024	0	23.024
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	10.046	(43.343)	24	(33.273)
<b>Summen</b>	<b>\$ 717.328</b>	<b>\$ 6.444.656</b>	<b>\$ 23.848</b>	<b>\$ 7.185.832</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 736.325	\$ 6.986.418	\$ 47.612	\$ 7.770.355
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(11.414)	35.683	29	24.298
<b>Summen</b>	<b>\$ 724.911</b>	<b>\$ 7.022.101</b>	<b>\$ 47.641</b>	<b>\$ 7.794.653</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 der Wertpapieranlagen.

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:**

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BCY	(1,500) %	09.05.2018	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (5.068)	\$ (5.057)	(0,07)
	(0,250)	01.02.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(5.014)	(5.009)	(0,07)
	0,800	18.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(5.174)	(5.175)	(0,08)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (15.241)</b>	<b>(0,22)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (91)	\$ 0	\$ (91)
BOA	(10.577)	28.640	18.063
BPS	717	(1.180)	(463)
BRC	(5.278)	5.450	172
CBK	(2.095)	8.170	6.075
CKL	(683)	0	(683)
DUB	269	(590)	(321)
GLM	(747)	800	53
GST	(2.638)	2.489	(149)
HUS	(2.466)	2.820	354
ICE	4.865	0	4.865
JPM	(1.493)	2.790	1.297
MSB	(34)	9.240	9.206
MYC	(25)	(60)	(85)
NGF	(22)	0	(22)
RBC	248	(480)	(232)
RYL	164	(640)	(476)
SCX	(475)	1.060	585
SOG	(88)	280	192
SSB	4.331	(7.770)	(3.439)
TOR	1.129	(1.050)	79
UAG	(1.734)	1.860	126

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	54,75	63,25
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	31,24	21,36
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	16,83	13,51
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,14	(0,14)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,31)	0,09
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,31)	0,36
Einlagenzertifikate	0,33	0,00
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,22)	(0,11)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		
	21.820.672	\$ 218.485		24.978.656	\$ 250.100
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
QNB Finance Ltd. 3,705 % fällig am 12.02.2020	\$ 44.200	44.200	Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027	€ 28.800	37.668
Petroleos Mexicanos 4,750 % fällig am 26.02.2029	€ 37.500	43.949	Indonesia Government International Bond 6,750 % fällig am 15.01.2044	\$ 30.100	36.872
Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % fällig am 15.04.2023	32.500	39.612	Mexico Government International Bond 4,750 % fällig am 08.03.2044	39.600	36.227
Syngenta Finance NV 4,892 % fällig am 24.04.2025	\$ 38.000	37.668	Novatek OAO via Novatek Finance DAC 6,604 % fällig am 03.02.2021	31.600	33.338
HCA, Inc. 4,094 % fällig am 13.03.2025	36.583	36.583	Uruguay Government International Bond 5,100 % fällig am 18.06.2050	23.800	24.370
Turkey Government International Bond 5,125 % fällig am 17.02.2028	36.500	36.285	Valeant Pharmaceuticals International, Inc. 4,500 % fällig am 15.05.2023	€ 20.400	23.097
QNB Finance Ltd. 3,713 % fällig am 07.02.2020	35.000	35.000	AT&T, Inc. 5,300 % fällig am 15.08.2058	\$ 20.000	19.113
Saudi Government International Bond 4,000 % fällig am 17.04.2025	35.200	34.874	Province of Quebec 2,750 % fällig am 01.09.2025	CAD 23.900	18.373
Province of Quebec 2,500 % fällig am 01.09.2026	CAD 40.700	30.612	Intelsat Jackson Holdings S.A. 5,853 % fällig am 27.11.2023	\$ 18.100	18.125
Perusahaan Listrik Negara PT 5,450 % fällig am 21.05.2028	\$ 28.100	27.993	Co-operative Group Holdings Ltd. 7,500 % fällig am 08.07.2026	£ 10.000	17.372
Techem GmbH 3,000 % fällig am 02.10.2024	€ 21.963	27.167	Indonesia Government International Bond 3,375 % fällig am 30.07.2025	€ 12.100	16.881
AA Bond Co. Ltd. 2,875 % fällig am 31.07.2043	£ 17.923	24.728	Algeco Global Finance PLC 6,500 % fällig am 15.02.2023	13.190	16.296
Bacardi Ltd. 4,700 % fällig am 15.05.2028	\$ 24.840	24.634	Dynegy, Inc. 7,625 % fällig am 01.11.2024	\$ 15.000	16.115
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 4,500 % fällig am 01.03.2025	€ 19.500	24.185	Letras del Banco Central de Argentina 1,000 % fällig am 16.05.2018	ARS 340.370	15.792
DISH DBS Corp. 6,750 % fällig am 01.06.2021	\$ 22.700	23.793	Russia Government International Bond 5,625 % fällig am 04.04.2042	\$ 15.400	15.646
Springleaf Finance Corp. 7,125 % fällig am 15.03.2026	21.400	21.400	SFR Group S.A. 6,250 % fällig am 15.05.2024	14.600	14.600
Greece Treasury Bills 0,000 % fällig am 31.08.2018	€ 17.400	21.095	Croatia Government International Bond 3,000 % fällig am 20.03.2027	€ 10.500	13.603
State Of Qatar 0,000 % fällig am 21.12.2020	\$ 20.000	19.770	Kazakhstan Government International Bond 6,500 % fällig am 21.07.2045	\$ 10.700	12.782
Travis Perkins PLC 4,500 % fällig am 07.09.2023	£ 13.205	19.103	Croatia Government International Bond 2,750 % fällig am 27.01.2030	€ 10.500	12.066
Argentina Government International Bond 7,820 % fällig am 31.12.2033	€ 12.935	18.324	SoftBank Group Corp. 4,750 % fällig am 19.09.2024	\$ 12.200	11.747
Petrobras Global Finance BV 5,750 % fällig am 01.02.2029	\$ 18.100	17.811	Barclays PLC 5,875 % fällig am 15.09.2024	£ 8.800	11.343
Greece Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.08.2018	€ 14.400	17.666	Argentina Government International Bond 3,875 % fällig am 15.01.2022	€ 8.800	11.299
Oman Government International Bond 6,750 % fällig am 17.01.2048	\$ 17.800	17.586	Letras del Banco Central de Argentina 0,010 % fällig am 18.04.2018	ARS 200.670	9.858
Sigma Bidco BV 0,000 % fällig am 06.03.2025	€ 14.200	17.523	Banco Santander S.A. 4,750 % fällig am 19.03.2025	€ 8.400	9.504
Ball Corp. 4,875 % fällig am 15.03.2026	\$ 17.500	17.500	Costa Rica Government International Bonds 7,000 % fällig am 04.04.2044	\$ 9.000	9.228
Greece Treasury Bills 0,000 % fällig am 15.03.2019	€ 13.900	16.957			
Letras del Banco Central de Argentina 1,000 % fällig am 16.05.2018	ARS 340.370	16.304			
Algeco Global Finance Plc 6,500 % fällig am 15.02.2023	€ 13.300	16.077			
Equinix, Inc. 2,875 % fällig am 15.03.2024	11.800	14.565			

(a) Der Diversified Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapiieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund

30. Juni 2018

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>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGLER MARKT</b>				<b>Melco Resorts Finance Ltd.</b>				<b>DÄNEMARK</b>			
<b>ARGENTINIEN</b>				<b>Odebrecht Drilling Norbe Ltd.</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>6,350 % fällig am 01.12.2021</b>				<b>TDC AIS</b>			
<b>Argentina Government International Bond</b>				<b>6,350 % fällig am 01.12.2021 (6,350 % bar oder 7,350 % PIK)</b>				<b>5,625 % fällig am 23.02.2023</b>			
2,260 % fällig am 31.12.2038	€	4.300	2,975	0,23	7,350 % fällig am 01.12.2026 (c)	4.127	2.054	0,16			
3,375 % fällig am 15.01.2023		1.500	1.596	0,12				<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>			
5,000 % fällig am 15.01.2027		2.600	2.605	0,20				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
5,250 % fällig am 15.01.2028		1.500	1.510	0,11				<b>Dominican Republic International Bond</b>			
6,250 % fällig am 22.04.2019	\$	300	302	0,02				<b>6,850 % fällig am 27.01.2045</b>			
7,820 % fällig am 31.12.2033	€	10.734	12.542	0,95				<b>6,875 % fällig am 29.01.2026</b>			
40,000 % fällig am 21.06.2020	ARS	3.400	123	0,01				<b>Summe Dominikanische Republik</b>			
<b>Summe Argentinien</b>				<b>21.653</b>				<b>1,64</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>Park Aerospace Holdings Ltd.</b>				<b>ECUADOR</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>3,625 % fällig am 15.03.2021</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Virgin Australia Pass-Through Trust</b>				<b>4,500 % fällig am 15.03.2023</b>				<b>Ecuador Government International Bond</b>			
6,000 % fällig am 23.04.2022	\$	152	154	0,01				<b>7,875 % fällig am 23.01.2028</b>			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>5,250 % fällig am 15.08.2022</b>				<b>8,875 % fällig am 23.10.2027</b>			
<b>TORRENS Trust</b>				<b>5,500 % fällig am 15.02.2024</b>				<b>9,650 % fällig am 13.12.2026</b>			
3,265 % fällig am 16.05.2042	AUD	146	108	0,01				<b>10,750 % fällig am 28.03.2022</b>			
<b>Summe Australien</b>				<b>262</b>				<b>0,02</b>			
<b>BERMUDAS</b>				<b>Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.</b>				<b>ÄGYPTEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>3,705 % fällig am 12.02.2020</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Bacardi Ltd.</b>				<b>3,713 % fällig am 07.02.2020</b>				<b>Egypt Government International Bond</b>			
4,700 % fällig am 15.05.2028	\$	4.500	4.435	0,34				<b>4,750 % fällig am 16.04.2026</b>			
<b>BRASILIEN</b>				<b>Trafford Centre Finance Ltd.</b>				<b>8,500 % fällig am 31.01.2047</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>1,435 % fällig am 28.07.2038</b>				<b>Summe Ägypten</b>			
<b>Banco do Brasil S.A.</b>				<b>Transocean Guardian Ltd.</b>				<b>5,250 % fällig am 15.06.2029</b>			
3,875 % fällig am 10.10.2022		290	272	0,02				<b>4,000 % fällig am 15.01.2027</b>			
<b>Odebrecht Oil &amp; Gas Finance Ltd.</b>				<b>UPCB Finance Ltd.</b>				<b>Summe Cayman Inseln</b>			
0,000 % fällig am 30.07.2018		2.332	37	0,00				<b>CHILE</b>			
<b>Petrobras Global Finance BV</b>				<b>5,875 % fällig am 15.01.2024 (b)</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
5,299 % fällig am 27.01.2025		7.118	6.586	0,50				<b>GNL Quintero S.A.</b>			
5,750 % fällig am 01.02.2029		3.200	2.818	0,21				<b>4,634 % fällig am 31.07.2029</b>			
5,999 % fällig am 27.01.2028		3.055	2.770	0,21				<b>CHINA</b>			
7,375 % fällig am 17.01.2027		2.400	2.403	0,18				<b>Sinopec Group Overseas Development Ltd.</b>			
<b>Summe Brasilien</b>				<b>14.886</b>				<b>1,12</b>			
<b>KANADA</b>				<b>Summe China</b>				<b>600</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>1,750 % fällig am 29.09.2019</b>				<b>0,04</b>			
<b>Fairfax Financial Holdings Ltd.</b>				<b>KOLUMBIEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
2,750 % fällig am 29.03.2028	€	800	933	0,07				<b>Colombia Government International Bond</b>			
<b>Harvest Operations Corp.</b>				<b>5,000 % fällig am 15.06.2045</b>				<b>8,800</b>			
2,330 % fällig am 14.04.2021	\$	504	484	0,04				<b>5,625 % fällig am 26.02.2044</b>			
<b>Valeant Pharmaceuticals International, Inc.</b>				<b>Summe Kolumbien</b>				<b>9.211</b>			
4,500 % fällig am 15.05.2023	€	2.160	2.391	0,18				<b>0,70</b>			
<b>Summe Kanada</b>				<b>3.808</b>				<b>0,29</b>			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>COSTA RICA</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Valeant Pharmaceuticals International, Inc.</b>				<b>Costa Rica Government International Bond</b>				<b>7,000 % fällig am 04.04.2044</b>			
4,982 % fällig am 01.06.2025	\$	506	505	0,04				<b>7,158 % fällig am 12.03.2045</b>			
<b>Summe Kanada</b>				<b>4.313</b>				<b>0,33</b>			
<b>CAYMAN INSELN</b>				<b>KROATIEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Croatia Government International Bond</b>			
<b>Ares CLO Ltd.</b>				<b>6,625 % fällig am 14.07.2020</b>				<b>6,625 % fällig am 14.07.2020</b>			
3,668 % fällig am 05.12.2025		500	501	0,04				<b>400</b>			
<b>Madison Park Funding Ltd.</b>				<b>Summe Kroatien</b>				<b>421</b>			
3,689 % fällig am 20.04.2026		700	701	0,05				<b>0,03</b>			
<b>Summe Cayman Inseln</b>				<b>1.202</b>				<b>0,09</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>CURACAO</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Avolon Holdings Funding Ltd.</b>				<b>Teva Pharmaceutical Finance BV</b>				<b>Teva Pharmaceutical Finance BV</b>			
5,500 % fällig am 15.01.2023		800	800	0,06				<b>3,650 % fällig am 10.11.2021</b>			
<b>Baidu, Inc.</b>				<b>Teva Pharmaceutical Finance Co. BV</b>				<b>2,950 % fällig am 18.12.2022</b>			
3,875 % fällig am 29.09.2023		200	199	0,02				<b>3,650 % fällig am 10.11.2021</b>			
<b>Lima Metro Line Finance Ltd.</b>				<b>Summe Curacao</b>				<b>6.991</b>			
5,875 % fällig am 05.07.2034		1.300	1.329	0,10				<b>0,53</b>			
<b>Summe Deutschland</b>				<b>24.501</b>				<b>1,85</b>			

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged 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	
<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>				<b>ITALIEN</b>				<b>Telenet Finance Luxembourg Notes SARL</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>3,500 % fällig am 01.03.2028</b>				
Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust		\$ 1.502	1,553	0,12	Intesa Sanpaolo SpA	\$ 1.800	1.636	0,12		\$ 1.600	1.775	0,13
5,125 % fällig am 30.11.2024				5,017 % fällig am 26.06.2024				Summe Luxemburg		60.208	4,55	
Globalworth Real Estate Investments Ltd.		€ 800	959	0,07	5,710 % fällig am 15.01.2026		2.800	2.564	0,19			
2,875 % fällig am 20.06.2022				6,500 % fällig am 24.02.2021		5.600	5.806	0,44	<b>MAZEDONIEN</b>			
3,000 % fällig am 29.03.2025		€ 100	116	0,01	7,000 % fällig am 19.01.2021 (f)(h)	€ 4.100	4.900	0,37	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Summe Guernsey, Kanalinseln		2.628	0,20	7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h)	€ 800	1.010	0,08	Macedonia Government International Bond	300	345	0,03	
<b>HONGKONG</b>				<b>LEONARDO SpA</b>				<b>MEXIKO</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>8,000 % fällig am 16.12.2019</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
CNOOC Finance Ltd.		\$ 600	579	0,04	UniCredit SpA	\$ 200	191	0,01	<b>Cemex S.A.B. de C.V.</b>			
3,000 % fällig am 09.05.2023				3,750 % fällig am 12.04.2022				<b>4,375 % fällig am 05.03.2023</b>				
<b>INDIEN</b>				<b>Wind Tre SpA</b>				<b>Petroleos Mexicanos</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>2,625 % fällig am 20.01.2023</b>				<b>2,750 % fällig am 21.04.2027</b>				
ONGC Videsh Ltd.				2,750 % fällig am 20.01.2024	€ 1.300	1.267	0,10	3,750 % fällig am 21.02.2024	2.500	2.969	0,22	
3,250 % fällig am 15.07.2019	400	399	0,03	3,125 % fällig am 20.01.2025	€ 8.500	8.076	0,61	4,750 % fällig am 26.02.2029	6.500	7.615	0,58	
Summe Indien		1.504	0,11	Summe Italien		35.078	2,65	4,875 % fällig am 21.02.2028	4.100	4.972	0,38	
<b>INDONESIEN</b>				<b>JAPAN</b>				<b>6,500 % fällig am 13.03.2027</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>6,500 % fällig am 02.06.2041</b>				
Pelabuhan Indonesia Persero PT		700	698	0,05	SoftBank Group Corp.	1.800	2.171	0,16	6,625 % fällig am 15.06.2035	3.400	3.336	0,25
6,875 % fällig am 01.10.2024				4,000 % fällig am 20.04.2023				6,750 % fällig am 21.09.2047	3.400	3.214	0,24	
Perusahaan Listrik Negara PT		5.000	5.098	0,39	Summe Japan					33.633	2,54	
5,450 % fällig am 21.05.2028			5,796	0,44	<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Summe Indonesien		22.885	1,73	3,400 % fällig am 10.10.2018	\$ 4.192	4.176	0,32	<b>Mexico Government International Bond</b>				
<b>IRLAND</b>				<b>KASACHSTAN</b>				<b>4,750 % fällig am 08.03.2044</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Summe Mexiko</b>				
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC		€ 1.700	1.989	0,15	Kazakhstan Government International Bond	4.200	4.435	0,34		6.600	6.140	0,47
2,626 % fällig am 28.04.2020				5,125 % fällig am 21.07.2025	1.700	2.007	0,15	Summe Niederlande		39.773	3,01	
AerCap Ireland Capital DAC		\$ 6.000	5.969	0,45	6,500 % fällig am 21.07.2045			6,25 % fällig am 29.06.2021 (f)(h)	2.400	3.157	0,24	
3,950 % fällig am 01.02.2022				Summe Kasachstan		6.442	0,49	<b>NIEDERLANDE</b>				
4,250 % fällig am 01.07.2020		€ 400	405	0,03	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Cooperatieve Rabobank UA</b>			
4,500 % fällig am 15.05.2021		€ 600	612	0,05	Altice Financing S.A.	€ 7.900	9.534	0,72	5,500 % fällig am 29.06.2020 (f)(h)	€ 2.300	2.875	0,22
4,625 % fällig am 30.10.2020		€ 700	713	0,05	6,625 % fällig am 15.02.2023	\$ 1.260	1.245	0,09	6,625 % fällig am 29.06.2021 (f)(h)	2.400	3.157	0,24
Bank of Ireland		€ 600	753	0,06	7,500 % fällig am 15.05.2026	€ 4.100	3.976	0,30	ING Bank NV	\$ 5.400	5.728	0,43
7,375 % fällig am 18.06.2020 (f)(h)				6,250 % fällig am 15.02.2025	€ 2.300	2.578	0,19	LeasePlan Corp. NV	200	200	0,01	
Borets Finance DAC		\$ 10.500	10.552	0,80	7,250 % fällig am 15.05.2022	€ 9.000	10.593	0,80	2,875 % fällig am 22.01.2019	200	200	0,01
7,625 % fällig am 26.09.2018				7,625 % fällig am 15.02.2025	\$ 800	739	0,06	Metinvest BV	400	376	0,03	
Novatek OAO via Novatek Finance DAC		€ 200	213	0,02	7,750 % fällig am 15.05.2022	€ 800	777	0,06	7,750 % fällig am 23.04.2023			
6,604 % fällig am 03.02.2021				Corestate Capital Holding S.A.	€ 7.300	8.404	0,63	NN Group NV	€ 3.700	4.471	0,34	
Smurfit Kappa Acquisitions ULC		€ 1.500	1.745	0,13	CPI Property Group S.A.	600	689	0,05	Schaeffler Finance BV	950	1.173	0,09
2,875 % fällig am 15.01.2026			22.951	1,74	2,125 % fällig am 04.10.2024	€ 600	689	0,05	Syngenta Finance NV	\$ 200	200	0,02
Summe Irland		126.040	9,53	Emerald Bay S.A.	6.320	6.908	0,52	3,933 % fällig am 23.04.2021	200	199	0,01	
<b>AKTIEN</b>				<b>LUXEMBURG</b>				<b>4,441 % fällig am 24.04.2023</b>				
<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>4,892 % fällig am 24.04.2025</b>				
PIMCO Fixed Income Source ETFs		521.370	52.898	4,00	Altice Financing S.A.	€ 7.900	9.534	0,72	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV	€ 1.200	1.190	0,09
plc - PIMCO US Dollar Short				5,250 % fällig am 15.02.2023	\$ 1.260	1.245	0,09	1,125 % fällig am 15.10.2024	€ 1.200	1.190	0,09	
Maturity Source UCITS ETF (g)				6,625 % fällig am 15.02.2023	\$ 4.100	3.976	0,30	1,250 % fällig am 31.03.2023	\$ 1.300	1.382	0,10	
Summe Börsengehandelte Fonds				7,500 % fällig am 15.05.2026				2,200 % fällig am 21.07.2021	\$ 600	557	0,04	
<b>INVESTMENTFONDS</b>				<b>NIELSEN Co. Luxembourg SARL</b>				<b>2,800 % fällig am 21.07.2023</b>				
PIMCO Funds: Global Investors		4.944.930	50.191	3,79	5,500 % fällig am 01.10.2021	5.100	5.138	0,39	4,500 % fällig am 01.03.2025	€ 3.500	4.194	0,32
Series plc - US Short-Term				9,500 % fällig am 09.11.2024 *(c)	401	169	0,01	VIVAT NV	1.500	1.821	0,14	
Fund (g)				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.	€ 2.100	2.485	0,19	2,375 % fällig am 17.05.2024				
Summe Investmentfonds				3,080 % fällig am 07.03.2019	€ 600	600	0,05	Volkswagen International Finance NV	\$ 200	199	0,01	
<b>OMAN</b>				<b>SCHMOLZ + BICKENBACH Luxembourg Finance S.A.</b>				<b>2,125 % fällig am 20.11.2018</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>5,625 % fällig am 15.07.2022</b>				<b>4,625 % fällig am 27.06.2028 (f)</b>				
<b>Oman Government International Bond</b>								<b>42.295</b>				
6,500 % fällig am 08.03.2047	2.800	2.517	0,19					Summe Kreditbeteiligungen und -abtretung	2.500	2.866	0,22	

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
6,750 % fällig am 17.01.2048	\$ 2.600	\$ 2.363	0,18	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Lloyds Banking Group PLC</b>			
Summe Oman		4.880	0,37	Autonomous Community of Catalonia	€ 2.300	\$ 2.919	0,22	6,375 % fällig am 27.06.2020 (f)(h)	€ 600	\$ 747	0,06
<b>PANAMA</b>				4,900 % fällig am 15.09.2021	€ 700	865	0,07	7,000 % fällig am 27.06.2019 (f)(h)	£ 800	1.079	0,08
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,950 % fällig am 11.02.2020		3.784	0,29	<b>Marks &amp; Spencer PLC</b>			
Banistmo S.A.				Summe Spanien		19.987	1,51	3,000 % fällig am 08.12.2023	500	671	0,05
3,650 % fällig am 19.09.2022	300	284	0,02	<b>SCHWEIZ</b>				<b>Mitchells &amp; Butlers Finance PLC</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				1,081 % fällig am 15.12.2030	336	419	0,03
Panama Government International Bond	3.600	4.428	0,34	Credit Suisse AG	\$ 12.500	13.325	1,00	2,791 % fällig am 15.12.2030	\$ 1.344	1.267	0,10
6,700 % fällig am 26.01.2036		137	0,01	6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)				6,469 % fällig am 15.09.2032	£ 432	662	0,05
8,125 % fällig am 28.04.2034	100			UBS AG	4.050	4.481	0,34	<b>Nationwide Building Society</b>			
Summe Panama		4.849	0,37	7,625 % fällig am 17.08.2022 (h)				6,875 % fällig am 20.06.2019 (f)(h)	600	811	0,06
				UBS Group Funding Switzerland AG	2.900	2.873	0,22	<b>RAC Bond Co. PLC</b>			
<b>KATAR</b>				4,125 % fällig am 15.04.2026				4,565 % fällig am 06.05.2046	700	965	0,07
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Schweiz		20.679	1,56	4,870 % fällig am 22.03.2023	1.900	2.614	0,20
Nakilat, Inc.				<b>TRINIDAD UND TOBAGO</b>				<b>Royal Bank of Scotland Group PLC</b>			
6,067 % fällig am 31.12.2033	1.800	1.976	0,15	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				2,500 % fällig am 22.03.2023	€ 4.900	6.029	0,46
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.				Trinidad & Tobago Government International Bond	700	672	0,05	4,800 % fällig am 05.04.2026	\$ 7.200	7.252	0,55
5,838 % fällig am 30.09.2027	2.700	2.889	0,22	4,500 % fällig am 04.08.2026				4,892 % fällig am 18.05.2029	1.400	1.397	0,11
Summe Katar		4.865	0,37	<b>TÜRKEI</b>				7,500 % fällig am 10.08.2020 (f)(h)	400	409	0,03
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Turkey Government International Bond				8,625 % fällig am 15.08.2021 (f)(h)	2.100	2.237	0,17
Qatar Government International Bond				4,875 % fällig am 09.10.2026	7.100	6.264	0,47	<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>			
4,500 % fällig am 23.04.2028	2.000	2.022	0,15	5,125 % fällig am 25.03.2022	8.300	8.057	0,61	6,750 % fällig am 24.06.2024 (f)(h)	£ 4.200	5.742	0,43
5,103 % fällig am 23.04.2048	2.000	1.999	0,15	5,125 % fällig am 17.02.2028	5.700	5.035	0,38	<b>Spirit Issuer PLC</b>			
Summe Katar		4.021	0,30	5,750 % fällig am 22.03.2024	4.600	4.444	0,34	3,368 % fällig am 28.12.2031	100	130	0,01
		8.886	0,67	5,750 % fällig am 11.05.2047	2.700	2.186	0,17	6,582 % fällig am 28.12.2027	1.311	1.774	0,13
<b>RUMÄNIEN</b>				6,125 % fällig am 24.10.2028	900	845	0,06	<b>Tesco Property Finance PLC</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Türkei		26.831	2,03	5,411 % fällig am 13.07.2044	3.692	5.527	0,42
Romania Government International Bond				<b>UKRAINE</b>				5,744 % fällig am 13.04.2040	681	1.050	0,08
2,375 % fällig am 19.04.2027	€ 3.100	3.627	0,27	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				6,052 % fällig am 13.10.2039	2.265	3.540	0,27
<b>RUSSLAND</b>				Ukraine Government International Bond				<b>TP ICAP PLC</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				7,375 % fällig am 25.09.2032	1.200	1.032	0,08	5,250 % fällig am 26.01.2024	700	953	0,07
Russia Government International Bond				7,750 % fällig am 01.09.2019	7.800	7.800	0,59	<b>Travis Perkins PLC</b>			
5,625 % fällig am 04.04.2042	\$ 3.200	3.354	0,25	7,750 % fällig am 01.09.2020	3.900	3.888	0,29	4,375 % fällig am 15.09.2021	600	826	0,06
Summe Russland				Summe Ukraine		12.720	0,96	4,500 % fällig am 07.09.2023	2.600	3.547	0,27
<b>SAUDI-ARABIEN</b>				<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>Unique Pub Finance Co. PLC</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,659 % fällig am 30.06.2027	1.832	2.679	0,20
Saudi Government International Bond				Barclays Bank PLC				6,542 % fällig am 30.03.2021	504	703	0,05
2,875 % fällig am 04.03.2023	800	771	0,06	7,625 % fällig am 21.11.2022 (h)	1.400	1.510	0,11	<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b>			
4,000 % fällig am 17.04.2025	6.300	6.278	0,47	10,000 % fällig am 21.05.2021	£ 7.600	12.042	0,91	4,875 % fällig am 15.01.2027	5.000	6.440	0,49
Summe Saudi-Arabien		7.049	0,53	14,000 % fällig am 15.06.2019 (f)	2.100	3.070	0,23	5,000 % fällig am 15.04.2027	2.600	3.360	0,25
<b>SENEGAL</b>				<b>Barclays PLC</b>				5,125 % fällig am 15.01.2025	300	404	0,03
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				5,875 % fällig am 15.09.2024 (f)(h)	400	503	0,04	6,250 % fällig am 28.03.2029	100	138	0,01
Senegal Government International Bond				6,500 % fällig am 15.09.2019 (f)(h)	€ 1.400	1.686	0,13	Summe Großbritannien		104.253	7,88
4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 200	218	0,02	7,000 % fällig am 15.09.2019 (f)(h)	€ 200	270	0,02	<b>USA</b>			
6,250 % fällig am 23.05.2033	\$ 600	534	0,04	7,250 % fällig am 15.03.2023 (f)(h)	700	951	0,07	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Summe Senegal		752	0,06	7,875 % fällig am 15.09.2022 (f)(h)	3.900	5.475	0,41	<b>Ames Mortgage Investment Trust</b>			
<b>SÜDAFRIKA</b>				8,000 % fällig am 15.12.2020 (f)(h)	€ 400	518	0,04	2,871 % fällig am 25.10.2035	\$ 200	197	0,02
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Co-operative Group Holdings Ltd.				3,291 % fällig am 25.06.2035	700	680	0,05
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.				6,875 % fällig am 08.07.2020	£ 1.100	1.577	0,12	<b>Accredited Mortgage Loan Trust</b>			
5,872 % fällig am 02.05.2023	400	407	0,03	7,500 % fällig am 08.07.2026	2.600	4.130	0,31	2,577 % fällig am 25.09.2035	100	97	0,01
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>EI Group PLC</b>				<b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>			
South Africa Government International Bond				6,875 % fällig am 15.02.2021	1.900	2.732	0,21	2,391 % fällig am 25.02.2036	448	447	0,03
5,875 % fällig am 16.09.2025	1.700	1.748	0,13	6,875 % fällig am 09.05.2025	900	1.315	0,10	2,561 % fällig am 25.10.2035	1.000	996	0,08
Summe Südafrika		2.155	0,16	<b>Enso PLC</b>				<b>Aircraft Certificate Owner Trust</b>			
<b>SPANIEN</b>				5,750 % fällig am 01.10.2044	\$ 900	641	0,05	7,001 % fällig am 20.09.2022	123	128	0,01
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				8,000 % fällig am 31.01.2024	528	533	0,04	<b>Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through</b>			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				Greene King Finance PLC				<b>Certificates</b>			
6,750 % fällig am 18.02.2020 (f)(h)	€ 9.000	10.953	0,83	2,711 % fällig am 15.03.2036	£ 200	231	0,02	2,561 % fällig am 25.11.2035	200	194	0,02
7,000 % fällig am 19.02.2019 (f)(h)	2.400	2.872	0,21	<b>HBOS PLC</b>				3,141 % fällig am 25.10.2033	53	52	0,00
Banco Santander S.A.				5,374 % fällig am 30.06.2021	€ 1.000	1.340	0,10	5,466 % fällig am 25.11.2032 ^	863	833	0,06
4,750 % fällig am 19.03.2025 (f)(h)	2.200	2.378	0,18	<b>HSBC Holdings PLC</b>				<b>Argent Securities Trust</b>			
Summe Spanien		16.203	1,22	3,600 % fällig am 25.05.2023	\$ 400	396	0,03	2,251 % fällig am 25.05.2036	683	260	0,02
				4,750 % fällig am 04.07.2029 (f)(h)	€ 800	923	0,07	<b>Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>			
				<b>INEOS Finance PLC</b>				2,451 % fällig am 25.10.2035	818	821	0,06
				4,000 % fällig am 01.05.2023	300	357	0,03	<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>			
				<b>Lloyds Bank PLC</b>				2,201 % fällig am 25.02.2037	350	361	0,03
				7,625 % fällig am 22.04.2025	£ 400	681	0,05	2,241 % fällig am 25.06.2036	170	170	0,01
								2,431 % fällig am 25.05.2036 ^	219	255	0,02
								2,511 % fällig am 25.12.2035	300	301	0,02
								3,098 % fällig am 25.06.2035	1.000	1.003	0,08
								3,891 % fällig am 25.07.2034	175	170	0,01
								<b>Carrington Mortgage Loan Trust</b>			
								2,151 % fällig am 25.01.2037	233	220	0,02
								2,241 % fällig am 25.05.2036	69	69	0,01
								2,351 % fällig am 25.02.2037	1.000	921	0,07
								3,141 % fällig am 25.05.2035	300	294	0,02



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
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC	\$ 1.040	\$ 1.067	0,08	5,875 % fällig am 30.06.2026	\$ 900	\$ 967	0,07	Level 3 Financing, Inc.	\$ 4.800	\$ 4.795	0,36
Freedom Mortgage Corp.				Solvay Finance America LLC	200	204	0,02	Nielsen Finance LLC	2.183	2.185	0,16
8,125 % fällig am 15.11.2024	300	292	0,02	4,450 % fällig am 03.12.2025				Virgin Media Bristol LLC	6.600	6.561	0,50
GLP Capital LP				Springleaf Finance Corp.	204	207	0,02	Ziggo Secured Finance BV	11.000	12.647	0,96
5,750 % fällig am 01.06.2028	600	608	0,05	5,250 % fällig am 15.12.2019	82	84	0,01	3,000 % fällig am 15.04.2025		84.343	6,37
Goldman Sachs Group, Inc.	500	496	0,04	6,000 % fällig am 01.06.2020	4.300	4.407	0,33				
3,850 % fällig am 08.07.2024				6,125 % fällig am 15.05.2022	4.100	4.080	0,31				
Hartford HealthCare Corp.	800	940	0,07	6,875 % fällig am 15.03.2025	3.500	3.491	0,26				
5,746 % fällig am 01.04.2044				7,125 % fällig am 15.03.2026	790	853	0,06				
HCA, Inc.	500	472	0,04	8,250 % fällig am 15.12.2020							
4,500 % fällig am 15.02.2027	500	472	0,04	Sprint Communications, Inc.	544	564	0,04				
4,750 % fällig am 01.05.2023	3.150	3.150	0,24	7,000 % fällig am 15.01.2028							
Hilton Worldwide Finance LLC				Sprint Spectrum Co. LLC	2.100	2.063	0,16				
4,875 % fällig am 01.04.2027	100	97	0,01	5,152 % fällig am 20.09.2029							
Howard Hughes Corp.	400	394	0,03	Standard Industries, Inc.	100	101	0,01				
5,375 % fällig am 15.03.2025				5,500 % fällig am 15.02.2023							
Ingram Micro, Inc.	500	493	0,04	Sunoco LP	200	193	0,01				
5,000 % fällig am 10.08.2022				4,875 % fällig am 15.01.2023							
International Lease Finance Corp.				Tallgrass Energy Partners LP	700	690	0,05				
5,875 % fällig am 15.08.2022	4.300	4.571	0,34	5,500 % fällig am 15.01.2028							
6,250 % fällig am 15.05.2019	1.100	1.128	0,08	Time Warner Cable LLC	1.500	1.472	0,11				
8,250 % fällig am 15.12.2020	800	883	0,07	5,875 % fällig am 15.11.2040							
8,625 % fällig am 15.01.2022	450	517	0,04	VEREIT Operating Partnership LP	200	203	0,01				
IQVIA, Inc.				4,125 % fällig am 01.06.2021							
3,250 % fällig am 15.03.2025	€ 1.000	1.138	0,09	Verizon Communications, Inc.	1.200	1.190	0,09				
Jefferies Finance LLC				4,125 % fällig am 16.03.2027	1.000	892	0,07				
6,875 % fällig am 15.04.2022	\$ 300	301	0,02	4,672 % fällig am 15.03.2055	100	94	0,01				
7,250 % fällig am 15.08.2024	400	394	0,03	5,012 % fällig am 21.08.2054	1.300	1.339	0,10				
7,375 % fällig am 01.04.2020	2.500	2.524	0,19	5,250 % fällig am 16.03.2037	400	421	0,03				
7,500 % fällig am 15.04.2021	1.400	1.428	0,11	5,500 % fällig am 16.03.2047							
Kinder Morgan Energy Partners LP				Vistra Energy Corp.	900	943	0,07				
6,500 % fällig am 01.02.2037	600	650	0,05	7,375 % fällig am 01.11.2022	1.300	1.417	0,11				
6,950 % fällig am 15.01.2038	1.900	2.172	0,16	8,125 % fällig am 30.01.2026	4.000	3.936	0,30				
Kinder Morgan, Inc.				Volkswagen Group of America Finance LLC							
5,300 % fällig am 01.12.2034	300	298	0,02	2,400 % fällig am 22.05.2020							
7,750 % fällig am 15.01.2032	1.800	2.203	0,17	Washington Prime Group LP	800	772	0,06				
7,800 % fällig am 01.08.2031	2.300	2.788	0,21	5,950 % fällig am 15.08.2024							
Midcontinent Express Pipeline LLC				Wynn Las Vegas LLC	2.500	2.341	0,18				
6,700 % fällig am 15.09.2019	4.700	4.862	0,37	5,250 % fällig am 15.05.2027	8.700	8.569	0,65				
Morgan Stanley				5,500 % fällig am 01.03.2025							
4,000 % fällig am 23.07.2025	1.600	1.597	0,12	ZF North America Capital, Inc.	817	833	0,06				
National Fuel Gas Co.				4,500 % fällig am 29.04.2022	1.470	1.472	0,11				
5,200 % fällig am 15.07.2025	600	617	0,05	4,750 % fällig am 29.04.2025							
Navient Corp.											
4,875 % fällig am 17.06.2019	5.966	6.003	0,45								
6,500 % fällig am 15.06.2022	2.600	2.665	0,20								
7,250 % fällig am 25.01.2022	500	525	0,04								
8,000 % fällig am 25.03.2020	4.610	4.875	0,37								
Oceaneering International, Inc.											
4,650 % fällig am 15.11.2024	500	478	0,04								
Oxford Finance LLC											
6,375 % fällig am 15.12.2022	300	305	0,02								
Pitney Bowes, Inc.											
3,625 % fällig am 15.09.2020	100	98	0,01								
Plains All American Pipeline LP											
4,500 % fällig am 15.12.2026	300	294	0,02								
QEP Resources, Inc.											
5,625 % fällig am 01.03.2026	1.100	1.057	0,08								
Quicken Loans, Inc.											
5,250 % fällig am 15.01.2028	2.300	2.130	0,16								
QVC, Inc.											
4,375 % fällig am 15.03.2023	100	99	0,01								
5,450 % fällig am 15.08.2034	1.600	1.482	0,11								
Rio Oil Finance Trust											
9,250 % fällig am 06.07.2024	5.178	5.566	0,42								
9,750 % fällig am 06.01.2027	191	206	0,02								
Rockies Express Pipeline LLC											
5,625 % fällig am 15.04.2020	8.740	8.991	0,68								
6,000 % fällig am 15.01.2019	2.400	2.439	0,18								
6,850 % fällig am 15.07.2018	10.800	10.812	0,82								
Sabine Pass Liquefaction LLC											
5,000 % fällig am 15.03.2027	200	203	0,01								
5,625 % fällig am 01.02.2021	2.200	2.300	0,17								
5,625 % fällig am 15.04.2023	600	637	0,05								
5,625 % fällig am 01.03.2025	8.700	9.266	0,70								
5,750 % fällig am 15.05.2024	2.700	2.883	0,22								

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged 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
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				Thornburg Mortgage Securities Trust				ARGENTINA TREASURY BILLS			
6,500 % fällig am 25.04.2033	\$ 1	\$ 1	0,00	3,341 % fällig am 25.06.2037 ^	33	\$ 30	0,00	2,480 % fällig am 12.10.2018			
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates	808	806	0,06	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	21	20	0,00	(d)(e)	\$ 700	\$ 692	0,05
3,500 % fällig am 26.04.2038				2,758 % fällig am 25.11.2042				3,010 % fällig am 14.09.2018	1.000	992	0,08
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust	46	45	0,00	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust	168	85	0,01	(d)(e)	2.200	2.163	0,17
3,680 % fällig am 25.09.2035				4,404 % fällig am 25.09.2036 ^				3,011 % fällig am 16.11.2018	3.500	3.467	0,26
HarborView Mortgage Loan Trust	963	944	0,07	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust	181	183	0,01	(d)(e)	300	296	0,02
2,354 % fällig am 20.10.2045				3,873 % fällig am 25.03.2035	5	5	0,00	3,089 % fällig am 28.09.2018	2.200	2.140	0,16
2,395 % fällig am 19.11.2035	407	393	0,03	3,881 % fällig am 25.04.2036	322	320	0,03	(d)(e)	25.601	901	0,07
2,525 % fällig am 19.05.2035	10	10	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2037				3,118 % fällig am 26.10.2018			
2,565 % fällig am 19.06.2035					18.582	1,41		(d)(e)			
HSI Asset Securitization Corp. Trust	2.597	2.345	0,18					25,601 % fällig am 14.09.2018	ARS 28.120		0,81
2,311 % fällig am 25.11.2035				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				(d)(e)			
Impac Secured Assets Trust	200	184	0,02	Fannie Mae, TBA							
2,251 % fällig am 25.03.2037 ^	72	69	0,01	3,000 % fällig am 01.07.2048	11.300	10.937	0,83				
2,261 % fällig am 25.01.2037	124	104	0,01	3,500 % fällig am 01.07.2048	57.800	57.481	4,34				
IndyMac Mortgage Loan Trust	24	22	0,00					GREECE TREASURY BILLS			
2,271 % fällig am 25.07.2047	5	5	0,00	Summe USA		474.866	35,89	0,742 % fällig am 06.07.2018	€ 1.000	1.168	0,09
3,273 % fällig am 25.06.2037 ^								(d)(e)			
3,752 % fällig am 25.12.2036 ^								0,889 % fällig am 03.08.2018	2.600	3.035	0,23
Lehman Mortgage Trust	282	282	0,02	VENEZUELA				(d)(e)	1.200	1.398	0,11
6,000 % fällig am 25.09.2037 ^				STAATSEMISSIONEN				1,082 % fällig am 05.10.2018	3.400	3.965	0,30
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust	2	2	0,00	Venezuela Government International Bond	241	64	0,01	(d)(e)	2.200	2.551	0,19
2,751 % fällig am 25.11.2029	13	12	0,00	6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	1.528	418	0,03	1,211 % fällig am 31.08.2018			
3,800 % fällig am 25.05.2036	79	70	0,01	7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	1.900	526	0,04	(d)(e)			
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust	6	6	0,00	7,750 % fällig am 13.10.2019 ^				1,267 % fällig am 15.03.2019			
3,721 % fällig am 25.03.2036 ^				Summe Venezuela		1.008	0,08				
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust	2.031	2.037	0,16								
4,463 % fällig am 25.08.2035				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				Summe kurzfristige Instrumente		87.681	6,63
Nomura Resecuritization Trust	167	163	0,01	PENSIONSGESCHÄFTE (k)		63.696	4,81				
2,815 % fällig am 26.02.2037											
Residential Accredit Loans, Inc. Trust	545	523	0,04	KURZFRISTIGE SCHULDITITEL				AKTIEN			
2,291 % fällig am 25.05.2047				Letras del Banco Central de la Republica Argentina				ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS			
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust	1.042	953	0,07	25,600 % fällig am 18.07.2018	ARS 7.099	241	0,02	PIMCO Funds Ireland p.l.c. -			
2,311 % fällig am 25.06.2037	1.237	1.198	0,09	25,650 % fällig am 15.08.2018	11.140	367	0,03	PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund	3.025.696	30.296	2,29
Structured Asset Mortgage Investments Trust	7	6	0,00	40,700 % fällig am 18.07.2018	17.910	609	0,04	(g)			
2,291 % fällig am 25.05.2036								Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt		\$ 1.334.841	100,88
2,301 % fällig am 25.09.2047 ^											
SunTrust Alternative Loan Trust											
2,741 % fällig am 25.12.2035 ^											

## 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-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09/2018	51	\$ 159	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09/2018	66	(78)	(0,02)
				\$ 81	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 81	0,00

### 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
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.06.2022	\$ 2.700	\$ (78)	(0,01)
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2022	1.400	(2)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2023	4.800	(43)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2022	1.100	(18)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2022	200	(6)	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2022	€ 5.200	38	0,00
Navigent Corp.	5,000	20.06.2022	\$ 300	(3)	0,00
Navigent Corp.	5,000	20.12.2022	200	(1)	0,00
Novo Banco S.A.	5,000	20.12.2021	€ 1.250	206	0,02
Telefonica Emisiones S.A.U.	1,000	20.06.2023	5.000	(97)	(0,01)
Telefonica Emisiones S.A.U.	1,000	20.12.2022	2.600	(32)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2023	600	(14)	0,00
				\$ (50)	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 Nettöver- mögens
CDX.EM-28 5-Year Index	1,000 %	20.12.2022	\$ 10.476	\$ (181)	(0,02)
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000	20.06.2023	144.300	(2.122)	(0,16)
CDX.HY-30 5-Year Index	5,000	20.06.2023	63.200	(159)	(0,01)
CDX.IG-30 5-Year Index	1,000	20.06.2023	66.800	(112)	(0,01)
				\$ (2.574)	(0,20)

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettöver- mögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750 %	21.12.2026	\$ 39.200	\$ 1.699	0,13
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.06.2047	2.500	179	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	15.100	(35)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	22.900	246	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	112.200	(128)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	11.100	862	0,06
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027	13.200	640	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	15.06.2046	7.600	611	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	33.700	(554)	(0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	10.500	888	0,07
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	19.09.2020	€ 58.100	(180)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	60.000	(873)	(0,07)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	1.400	(20)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.12.2023	11.400	(114)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	57.000	(1.343)	(0,10)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.12.2028	14.900	(209)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.09.2048	1.800	(64)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	£ 9.200	(91)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	18.000	(302)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	3.705	31	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	2.200	28	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	¥ 2.120.000	(95)	(0,01)
					\$ 1.176	0,09
					\$ (1.448)	(0,11)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungseiner 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 Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

## VERKAUFSOPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettöver- mögens
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	15.08.2018	€ 21.200	\$ (46)	\$ (29)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	1,000	15.08.2018	5.700	(11)	(4)	0,00
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	5.800	(15)	(8)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.08.2018	5.800	(10)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	5.700	(12)	(21)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	17.500	(40)	(44)	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.08.2018	5.600	(9)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	16.600	(45)	(63)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	22.400	(45)	(56)	(0,01)
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	17.400	(38)	(36)	0,00
GST	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	5.700	(17)	(14)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	11.500	(26)	(24)	0,00
						\$ (314)	\$ (311)	(0,02)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

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

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender		Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
		Festzinssatz	Fälligkeitsdatum					
BOA	Mexico Government International Bond	1,000 %	20.06.2023	\$ 2.400	\$ (26)	(10)	\$(36)	0,00
BRC	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	2.800	(137)	(32)	(169)	(0,01)
	Kazakhstan Government International Bond	1,000	20.12.2020	2.500	(192)	226	34	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.490	(59)	5	(54)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2022	2.100	(119)	55	(64)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	7.300	(523)	(3)	(526)	(0,04)
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.12.2021	100	(3)	14	11	0,00
CBK	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.400	(14)	(7)	(21)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	300	(12)	(10)	(22)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.610	(63)	5	(58)	(0,00)
	Peru Government International Bond	1,000	20.09.2020	800	(19)	30	11	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2020	1.900	(207)	209	2	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2022	2.300	(70)	53	(17)	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.06.2022	100	9	2	11	0,00
HUS	Argentina Republic Government International Bond	5,000	20.12.2018	600	6	1	7	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.000	(63)	(11)	(74)	(0,01)
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2024	17.100	(140)	(516)	(656)	(0,05)
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2021	1.400	(102)	101	(1)	0,00
JPM	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2022	4.000	(192)	158	(34)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2020	3.900	(427)	432	5	0,00
	UniCredit SpA	1,000	20.12.2020	€ 1.400	(95)	(54)	(149)	(0,01)
MYC	Novo Banco S.A.	5,000	20.12.2021	200	(55)	45	(10)	0,00
UAG	Park Aerospace Holdings Ltd.	5,000	01.07.2020	\$ 300	17	(5)	12	0,00
					\$ (2.486)	\$ 688	\$ (1.798)	(0,13)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	10.800	20.09.2018	10	19	29	0,00
MYC	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	3.100	20.12.2018	0	1	1	0,00
							\$ 10	\$ 14	\$ 24	0,00

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07/2018	\$ 3.259	€ 2.766	0	(30)	(30)	0,00
	08/2018	€ 2.200	\$ 2.741	167	0	167	0,01
	08/2018	\$ 1.500	RUB 93.870	0	(11)	(11)	0,00
	09/2018	SGD 144	\$ 109	2	0	2	0,00
	10/2018	€ 900	1.122	64	0	64	0,00
BPS	07/2018	\$ 483	¥ 52.500	0	(9)	(9)	0,00
	08/2018	ARS 11.140	\$ 517	147	0	147	0,01
	08/2018	\$ 400	RUB 25.028	0	(3)	(3)	0,00
	09/2018	13	IDR 182.899	0	0	0	0,00
	02/2019	€ 8.620	\$ 10.296	42	0	42	0,00
BRC	07/2018	RUB 374.090	5.950	0	(12)	(12)	0,00
	08/2018	\$ 5.922	RUB 374.090	12	0	12	0,00
CBK	07/2018	£ 74.173	\$ 98.269	343	0	343	0,03
	07/2018	\$ 63	ARS 1.648	0	(7)	(7)	0,00
	07/2018	237	PLN 810	0	(21)	(21)	0,00
DUB	07/2018	ARS 11.676	\$ 414	15	0	15	0,00
	07/2018	€ 1.000	1.243	76	0	76	0,01
GLM	07/2018	BRL 14.396	3.781	40	0	40	0,00
	07/2018	€ 2.082	2.430	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 1.903	BRL 7.198	0	(33)	(33)	0,00
	07/2018	2.109	€ 1.787	0	(22)	(22)	0,00
	08/2018	RUB 833.995	\$ 13.265	37	0	37	0,00
	08/2018	\$ 1.872	BRL 7.198	0	(8)	(8)	0,00
	08/2018	2.639	RUB 165.155	0	(19)	(19)	0,00
HUS	07/2018	ARS 10.177	\$ 481	134	0	134	0,01
	07/2018	€ 271	314	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	£ 20	26	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 55	ARS 1.430	0	(6)	(6)	0,00
	07/2018	196	€ 169	2	0	2	0,00
	08/2018	957	RUB 59.797	0	(8)	(8)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	03/2019	€ 2.173	\$ 2.769	\$ 180	\$ 0	\$ 180	0,01
JPM	07/2018	\$ 15.035	€ 12.850	30	(62)	(32)	0,00
	07/2018	5.855	RUB 374.090	106	0	106	0,01
	08/2018	6.499	MXN 126.754	0	(106)	(106)	(0,01)
MSB	07/2018	1.959	BRL 7.198	0	(88)	(88)	(0,01)
	08/2018	1.900	RUB 118.864	0	(15)	(15)	0,00
NGF	07/2018	ARS 6.234	\$ 219	6	0	6	0,00
	09/2018	TWD 201.013	6.617	0	(11)	(11)	0,00
RBC	08/2018	€ 398	500	34	0	34	0,00
RYL	10/2018	298	371	20	0	20	0,00
SCX	08/2018	\$ 6.317	TRY 28.213	0	(271)	(271)	(0,02)
SSB	07/2018	€ 230.855	\$ 267.296	0	(2.238)	(2.238)	(0,17)
	09/2018	\$ 177	IDR 2.476.906	0	(6)	(6)	0,00
TOR	07/2018	¥ 52.500	\$ 478	4	0	4	0,00
	08/2018	€ 3.380	4.184	221	0	221	0,02
	08/2018	\$ 479	¥ 52.500	0	(4)	(4)	0,00
UAG	07/2018	252.910	€ 217.810	1.394	0	1.394	0,11
	07/2018	98.075	£ 74.173	0	(149)	(149)	(0,01)
	08/2018	€ 217.810	\$ 253.475	0	(1.381)	(1.381)	(0,10)
	08/2018	£ 74.173	98.214	155	0	155	0,01
	02/2019	€ 980	1.176	10	0	10	0,00
	02/2019	\$ 5.400	€ 4.260	0	(328)	(328)	(0,03)
				\$ 3.247	\$ (4.851)	\$ (1.604)	(0,12)

**ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutionell EUR (Hegend) Class und Class E EUR (Hegend) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07/2018	\$ 208.083	€ 177.266	\$ 0	\$ (1.116)	\$ (1.116)	(0,08)
BRC	07/2018	€ 3.335	\$ 3.867	5	(32)	(27)	0,00
CBK	07/2018	385	447	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	\$ 399	€ 338	0	(4)	(4)	0,00
GLM	07/2018	€ 1.516	\$ 1.772	3	(1)	2	0,00
MSB	07/2018	174.715	201.796	0	(2.192)	(2.192)	(0,17)
	07/2018	\$ 8.387	€ 7.145	0	(45)	(45)	0,00
	08/2018	202.241	174.715	2.191	0	2.191	0,17
RBC	07/2018	805	692	4	0	4	0,00
RYL	07/2018	€ 5.759	\$ 6.735	11	0	11	0,00
SCX	07/2018	577	680	6	0	6	0,00
	07/2018	\$ 202.970	€ 175.206	1.592	0	1.592	0,12
SSB	07/2018	€ 175.034	\$ 203.757	0	(604)	(604)	(0,05)
	07/2018	\$ 205.972	€ 177.004	689	0	689	0,05
	08/2018	204.209	175.034	595	0	595	0,04
				\$ 5.096	\$ (3.996)	\$ 1.100	0,08

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Heged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07/2018	\$ 164.397	£ 123.123	\$ 0	\$ (1.844)	\$ (1.844)	(0,14)
BPS	07/2018	24	18	0	0	0	0,00
BRC	07/2018	£ 121.583	\$ 158.989	0	(1.531)	(1.531)	(0,12)
	07/2018	\$ 5.709	£ 4.310	0	(19)	(19)	0,00
	08/2018	159.211	121.583	1.527	0	1.527	0,12
CBK	07/2018	£ 218	\$ 292	5	0	5	0,00
	07/2018	\$ 163.827	£ 123.655	0	(571)	(571)	(0,04)
GLM	07/2018	£ 12.684	\$ 16.706	8	(49)	(41)	0,00
RYL	07/2018	290	383	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	\$ 163.427	£ 122.934	0	(1.123)	(1.123)	(0,09)
SSB	07/2018	6.124	4.674	48	(2)	46	0,00
UAG	07/2018	£ 120.311	\$ 159.081	241	0	241	0,02
	08/2018	\$ 159.307	£ 120.311	0	(251)	(251)	(0,02)
				\$ 1.829	\$ (5.390)	\$ (3.561)	(0,27)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ (6.150)</b>	<b>(0,46)</b>

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

	PARI (000S)	
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>		
Credit Suisse AG 2,722 % fällig am 28.09.2018	\$ 4.100	\$ 4.104 0,31
Summe Einlagenzertifikate		\$ 4.104 0,31
Summe Anlagen		\$ 1.331.428 100,62
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (8.190) (0,62)
Nettovermögen		\$ 1.323.238 100,00

## 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) Reines Kapitalwertpapier.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(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:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.	4,150 %	06.03.2019	16.01.2018	\$ 603	\$ 600	0,05

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 2.449 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 2.449 als Sicherheiten verpfändet. Barmittel in Höhe von USD 42.865 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 2.449 als Sicherheiten verpfändet. Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 13.310 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	2,220 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 53.200	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 15.05.2024	\$ (54.275)	\$ 53.200	\$ 53.207	4,02
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	10.496	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	(10.707)	10.496	10.496	0,79
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (64.982)	\$ 63.696	\$ 63.703	4,81

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 133.385	\$ 1.201.256	\$ 200	\$ 1.334.841
Einlagen bei Kreditinstituten	0	4.104	0	4.104
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	81	(7.610)	12	(7.517)
Summen	\$ 133.466	\$ 1.197.750	\$ 212	\$ 1.331.428

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 121.900	\$ 1.098.846	\$ 4.542	\$ 1.225.288
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(94)	7.177	14	7.097
Summen	\$ 121.806	\$ 1.106.023	\$ 4.556	\$ 1.232.385

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BCY	(1,500) %	09.05.2018	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (987)	\$ (985)	(0,08)
	0,800	18.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(1.071)	(1.071)	(0,08)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (2.056)</b>	<b>(0,16)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (2.798)	\$ 6.500	\$ 3.702
BPS	144	0	144
BRC	(897)	803	(94)
CBK	(278)	970	692
CKL	(125)	0	(125)
DUB	55	(250)	(195)
GLM	(45)	0	(45)
GST	(117)	162	45
HUS	(424)	270	(154)
JPM	(181)	460	279
MSB	(149)	60	(89)
MYC	(9)	25	16
NGF	(5)	0	(5)
RBC	38	(270)	(232)
RYL	31	(80)	(49)
SCX	204	2.830	3.034
SSB	(1.518)	950	(568)
TOR	221	(260)	(39)
UAG	(297)	280	(17)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	52,43	60,85
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	29,22	21,28
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	19,23	15,19
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,11)	0,23
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,46)	0,35
Einlagenzertifikate	0,31	0,00
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,16)	(0,09)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income Duration Hedged Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	7.122.488	\$ 71.309	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	6.023.380	\$ 60.300
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % fällig am 15.04.2023	€ 7.300	8.888	Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027	€ 4.500	5.843
QNB Finance Ltd. 3,705 % fällig am 12.02.2020	\$ 8.000	8.000	Vistra Energy Corp. 7,625 % fällig am 01.11.2024	\$ 4.300	4.620
Petroleos Mexicanos 4,750 % fällig am 26.02.2029	€ 6.500	7.618	Valeant Pharmaceuticals International, Inc. 4,500 % fällig am 15.05.2023	€ 3.500	3.963
Syngenta Finance NV 4,892 % fällig am 24.04.2025	\$ 6.600	6.545	Uruguay Government International Bond 5,100 % fällig am 18.06.2050	\$ 4.000	3.812
HCA, Inc. 4,094 % fällig am 13.03.2025	6.524	6.524	Novatek OAO via Novatek Finance DAC 6,604 % fällig am 03.02.2021	3.500	3.693
Saudi Government International Bond 4,000 % fällig am 17.04.2025	6.300	6.242	Intelsat Jackson Holdings S.A. 5,853 % fällig am 27.11.2023	3.500	3.505
Techem GmbH 3,000 % fällig am 02.10.2024	€ 4.950	6.118	Indonesia Government International Bond 3,375 % fällig am 30.07.2025	€ 2.400	3.348
QNB Finance Ltd. 3,713 % fällig am 07.02.2020	\$ 5.800	5.800	L Brands, Inc. 6,875 % fällig am 01.11.2035	\$ 3.590	3.330
Turkey Government International Bond 5,125 % fällig am 17.02.2028	5.700	5.666	Altice France S.A. 6,250 % fällig am 15.05.2024	3.000	3.000
Perusahaan Listrik Negara PT 5,450 % fällig am 21.05.2028	5.000	4.981	Algeco Global Finance PLC 6,500 % fällig am 15.02.2023	€ 2.300	2.833
DISH DBS Corp. 6,750 % fällig am 01.06.2021	4.400	4.612	Letras del Banco Central de la Republica Argentina 1,000 % fällig am 16.05.2018	ARS 59.390	2.754
Bacardi Ltd. 4,700 % fällig am 15.05.2028	4.500	4.463	SoftBank Group Corp. 4,750 % fällig am 19.09.2024	\$ 2.200	2.120
AA Bond Co. Ltd. 2,875 % fällig am 31.07.2043	£ 3.200	4.393	Argentina Government International Bond 5,000 % fällig am 15.01.2027	€ 1.600	1.977
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 4,500 % fällig am 01.03.2025	€ 3.500	4.341	Croatia Government International Bond 3,000 % fällig am 20.03.2027	1.500	1.943
Greece Treasury Bills 0,000 % fällig am 31.08.2018	3.400	4.122	Co-operative Group Holdings Ltd. 7,500 % fällig am 08.07.2026	£ 1.100	1.918
Springleaf Finance Corp. 6,875 % fällig am 15.03.2025	\$ 4.100	4.100	Croatia Government International Bond 2,750 % fällig am 27.01.2030	€ 1.500	1.724
Argentina Government International Bond 7,820 % fällig am 31.12.2033	2.615	3.694	Argentina Government International Bond 3,875 % fällig am 15.01.2022	1.200	1.541
Springleaf Finance Corp. 7,125 % fällig am 15.03.2026	\$ 3.500	3.500	Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 15.03.2115	1.300	1.383
Greece Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.08.2018	€ 2.600	3.189	Verizon Communications, Inc. 3,125 % fällig am 16.03.2022	\$ 1.300	1.300
Travis Perkins PLC 4,500 % fällig am 07.09.2023	£ 2.200	3.180			
Ball Corp. 4,875 % fällig am 15.03.2026	\$ 3.100	3.100			
Sigma Bidco BV 0,000 % fällig am 06.03.2025	€ 2.500	3.085			
Altice Financing S.A. 7,500 % fällig am 15.05.2026	\$ 3.000	2.906			

(a) Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

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 UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>Springleaf Finance Corp.</b>				<b>6,000 % fällig am 25.07.2036</b>			
5,250 % fällig am 15.12.2019				\$ 100 € 87				\$ 162 € 121			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Stichting AK Rabobank Certificaten</b>				<b>6,500 % fällig am 25.12.2037</b>			
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				6,500 % (f)				142 98			
<b>AerCap Ireland Capital DAC</b>				€ 1.000 1.188				<b>Downey Savings &amp; Loan Association Mortgage Loan Trust</b>			
3,750 % fällig am 15.05.2019				€ 250 € 216				2,275 % fällig am 19.10.2036			
1,500 % fällig am 23.01.2022				€ 400 409				186 134			
<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b>				€ 1.400 1.459				<b>GreenPoint Mortgage Funding Trust</b>			
6,750 % fällig am 18.02.2020 (f)(h)				€ 800 820				2,331 % fällig am 25.10.2045			
7,000 % fällig am 19.02.2019 (f)(h)				€ 1.400 1.459				<b>GSMPS Mortgage Loan Trust</b>			
<b>Bank of America Corp.</b>				€ 800 820				2,441 % fällig am 25.03.2035			
0,372 % fällig am 25.04.2024				€ 4.500 4.481				<b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>			
<b>Caisse Centrale du Credit Immobilier de France S.A.</b>				€ 5.000 5.061				3,558 % fällig am 19.10.2035			
1,125 % fällig am 22.04.2019				€ 1.700 1.714				<b>Impac CMB Trust</b>			
<b>Cajamar Caja Rural SCC</b>				€ 1.700 1.714				2,731 % fällig am 25.03.2035			
0,875 % fällig am 18.06.2023				€ 50 43				<b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>			
<b>CIT Group, Inc.</b>				€ 400 428				2,271 % fällig am 25.02.2037 ^			
3,875 % fällig am 19.02.2019				€ 400 451				3,652 % fällig am 25.08.2037			
<b>Cooperative Rabobank UA</b>				€ 400 451				5,142 3.822			
5,500 % fällig am 29.06.2020 (f)(h)				€ 3.000 3.331				3,609 2.739			
6,625 % fällig am 29.06.2021 (f)(h)				€ 4.000 3.971				<b>Lehman XS Trust</b>			
6,875 % fällig am 19.03.2020 (h)				€ 4.000 3.971				2,341 % fällig am 25.08.2037			
<b>Deutsche Bank AG</b>				€ 4.000 3.971				<b>Mortgage Equity Conversion Asset Trust</b>			
1,250 % fällig am 08.09.2021				€ 4.400 3.713				2,840 % fällig am 25.05.2042			
<b>Deutsche Pfandbriefbank AG</b>				€ 5.000 5.049				<b>Reperforming Loan REMIC Trust</b>			
1,625 % fällig am 30.08.2019				€ 8.100 8.122				5,033 % fällig am 25.01.2034 ^			
<b>Dexia Credit Local S.A.</b>				€ 8.100 8.122				<b>Residential Accreted Loans, Inc. Trust</b>			
0,250 % fällig am 19.03.2020				€ 1.000 973				6,500 % fällig am 25.07.2036			
0,250 % fällig am 01.06.2023				€ 973 973				<b>SapphireOne Mortgages FCT</b>			
<b>Europäische Investitionsbank</b>				€ 973 973				0,177 % fällig am 25.02.2061			
1,000 % fällig am 13.07.2018				€ 9.126 9.150				<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>			
<b>Europäischer Stabilitätsmechanismus</b>				€ 11.360 11.419				2,491 % fällig am 25.06.2044			
0,050 % fällig am 17.12.2018				€ 15.030 15.144				3,605 % fällig am 25.02.2037			
1,250 % fällig am 15.10.2018				€ 200 202				29.234 2,51			
<b>Europäische Union</b>				€ 200 202				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
2,375 % fällig am 04.10.2018				€ 4.200 4.211				<b>Accreted Mortgage Loan Trust</b>			
<b>Fastighets AB Balder</b>				€ 1.600 1.605				2,577 % fällig am 25.09.2035			
1,125 % fällig am 14.03.2022				€ 4.000 4.013				<b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>			
<b>FMS Wertmanagement</b>				€ 5.000 5.019				2,241 % fällig am 25.07.2036			
0,000 % fällig am 16.01.2019 (c)				€ 5.000 5.019				<b>Adagio CLO Ltd.</b>			
0,000 % fällig am 18.02.2019 (c)				€ 5.000 5.019				0,660 % fällig am 15.10.2029			
0,000 % fällig am 26.02.2019 (c)				€ 5.000 5.019				<b>Atrium CDO Corp.</b>			
0,000 % fällig am 15.04.2019 (c)				€ 5.000 5.019				3,712 % fällig am 23.10.2024			
0,000 % fällig am 18.09.2020 (c)				€ 5.000 5.043				<b>Aurium CLO DAC</b>			
1,125 % fällig am 03.09.2018				€ 2.800 2.808				0,000 % fällig am 13.10.2029 (a)			
3,000 % fällig am 03.08.2018				€ 6.900 6.921				0,800 % fällig am 26.04.2029			
<b>General Motors Financial Co., Inc.</b>				€ 800 689				<b>Babson Euro CLO BV</b>			
3,187 % fällig am 09.04.2021				€ 5.000 4.999				0,492 % fällig am 25.10.2029			
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>				€ 4.500 3.903				0,771 % fällig am 15.04.2027			
0,129 % fällig am 16.12.2020				€ 100 88				<b>Barings Euro CLO BV</b>			
3,513 % fällig am 15.11.2021				€ 100 95				0,000 % fällig am 27.07.2030 (a)			
<b>International Lease Finance Corp.</b>				€ 100 88				<b>Bayview Opportunity Master Fund Trust</b>			
6,250 % fällig am 15.05.2019				€ 1.600 1.638				3,352 % fällig am 28.11.2032			
8,250 % fällig am 15.12.2020				€ 1.600 1.638				<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>			
<b>Intesa Sanpaolo SpA</b>				€ 1.600 1.638				3,141 % fällig am 25.08.2037			
7,000 % fällig am 19.01.2021 (f)(h)				€ 16.920 16.960				<b>Black Diamond CLO Designated Activity Co.</b>			
<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b>				€ 10.000 9.934				0,650 % fällig am 03.10.2029			
0,000 % fällig am 07.12.2018 (c)				€ 13.300 13.433				<b>Cairn CLO BV</b>			
0,500 % fällig am 15.09.2027				€ 29.690 29.836				0,572 % fällig am 30.01.2028			
0,875 % fällig am 18.03.2019				€ 40.919 41.925				0,650 % fällig am 20.10.2028			
1,125 % fällig am 16.10.2018				€ 2.100 2.129				<b>Cars Alliance Auto Loans France</b>			
3,875 % fällig am 21.01.2019				€ 4.000 4.142				0,030 % fällig am 21.10.2029			
<b>LeasePlan Corp. NV</b>				€ 5.000 4.995				<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b>			
1,000 % fällig am 24.05.2021				€ 100 83				4,246 % fällig am 25.10.2037			
<b>Lincoln Finance Ltd.</b>				€ 2.800 2.804				6,750 % fällig am 25.05.2036			
6,875 % fällig am 15.04.2021				€ 2.800 2.804				<b>Contego CLO BV</b>			
<b>Morgan Stanley</b>				€ 5.000 4.995				0,583 % fällig am 15.11.2026			
0,074 % fällig am 21.05.2021				€ 100 83				<b>Countrywide Asset-Backed Certificates</b>			
<b>Nasdaq, Inc.</b>				€ 100 83				2,311 % fällig am 25.09.2037 ^			
3,850 % fällig am 30.06.2026				€ 2.800 2.804				2,961 % fällig am 25.04.2034			
<b>Nykredit Realkredit A/S</b>				€ 2.800 2.804				3,666 % fällig am 25.01.2034			
0,249 % fällig am 02.06.2022				€ 30.000 4.177				<b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust</b>			
<b>Realkredit Danmark A/S</b>				€ 30.000 4.177				3,516 % fällig am 25.06.2034			
1,000 % fällig am 01.01.2022				€ 30.000 4.177				<b>Driver Espana Five FDT</b>			
								0,030 % fällig am 21.12.2028			
								<b>Driver Espana Four FT</b>			
								0,010 % fällig am 21.04.2028			
								912 914			
								0,08			

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset 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
<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>			
Dryden Senior Loan Fund	\$ 900	€ 771	0,07	Indonesia Government International Bond	€ 5.400	€ 5.973	0,51	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
3,248 % fällig am 15.10.2027				3,750 % fällig am 14.06.2028				2,830 % fällig am 13.07.2018	\$ 900	€ 770	0,07
Elm Park CLO DAC	€ 1.000	999	0,09	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	21.200	21.191	1,82	(c)(d)			
0,620 % fällig am 16.04.2029				0,100 % fällig am 15.04.2019	7.675	7.639	0,65	<b>FRANCE TREASURY BILLS</b>			
Euro-Galaxy CLO BV	100	100	0,01	0,650 % fällig am 01.11.2020				(0,695) % fällig am 07.11.2018	€ 50.000	50.110	4,30
1,140 % fällig am 10.11.2030				Province of Quebec	9.960	10.414	0,89	(c)(d)			
FCT Titrisocram	1.100	1.107	0,09	5,000 % fällig am 29.04.2019	3.330	3.339	0,29	(0,684) % fällig am 07.11.2018	4.380	4.390	0,38
0,080 % fällig am 25.07.2036				Bundesrepublik Deutschland	5.000	5.008	0,43	(c)(d)	43.500	43.530	3,73
First Franklin Mortgage Loan Trust	\$ 10.000	7.592	0,65	0,000 % fällig am 14.12.2018 (c)(i)				(0,583) % fällig am 22.08.2018			
2,561 % fällig am 25.11.2036				SNCF Réseau				(c)(d)			
Grosvenor Place CLO BV	€ 500	500	0,04	0,050 % fällig am 23.10.2018							
0,720 % fällig am 30.10.2029					110.395	9,47					
GSAA Home Equity Trust	\$ 1.933	1.220	0,10					<b>GREECE TREASURY BILLS</b>			
2,141 % fällig am 25.12.2046				<b>AKTIEN</b>				1,211 % fällig am 31.08.2018	7.500	7.492	0,64
5,985 % fällig am 25.06.2036		654	0,06	<b>INVESTMENTFONDS</b>				(c)(d)			
Harvest CLO DAC	€ 200	200	0,02	<b>PIMCO Funds: Global Investors</b>				1,674 % fällig am 06.07.2018	3.500	3.501	0,30
0,630 % fällig am 18.11.2029				Series plc - Income Fund	3.549.586	44.387	3,81	(c)(d)			
Jubilee CLO BV	700	701	0,06	(g)	6.904.677	69.599	5,97				
0,479 % fällig am 15.12.2029				<b>PIMCO Funds: Global Investors</b>							
0,511 % fällig am 12.07.2028	200	200	0,02	Series plc - Mortgage							
MASTR Asset-Backed Securities Trust	\$ 2.989	2.496	0,21	Opportunities Fund (g)		113.986	9,78				
2,871 % fällig am 25.02.2034								<b>ITALY TREASURY BILLS</b>			
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust	238	178	0,01	<b>STAMMAKTIVEN</b>				(0,476) % fällig am 13.07.2018	300	300	0,03
2,216 % fällig am 25.07.2036				<b>GESUNDHEITSWESEN</b>				(c)(d)			
2,241 % fällig am 25.07.2036	347	165	0,01	AbbVie, Inc.	63.060	5.004	0,43	(0,461) % fällig am 13.07.2018	7.440	7.441	0,64
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust	147	85	0,01	Amgen, Inc.	39.460	6.239	0,53	(c)(d)			
2,191 % fällig am 25.04.2037				Anthem, Inc.	15.830	3.228	0,28	(0,459) % fällig am 13.07.2018	2.780	2.780	0,24
NovaStar Mortgage Funding Trust	346	288	0,02	Biogen, Inc. (b)	12.290	3.055	0,26	(c)(d)	500	500	0,04
2,291 % fällig am 25.09.2037				Gilead Sciences, Inc.	88.840	5.390	0,46	(0,420) % fällig am 14.08.2018			
Option One Mortgage Loan Trust	314	244	0,02	Humana, Inc.	13.670	3.485	0,30	(c)(d)	2.570	2.571	0,22
2,231 % fällig am 25.03.2037				Vertex Pharmaceuticals, Inc. (b)	22.190	3.230	0,28	(0,391) % fällig am 31.08.2018	4.700	4.701	0,40
2,311 % fällig am 25.04.2037	769	522	0,04			29.631	2,54	(c)(d)			
2,311 % fällig am 25.05.2037	553	342	0,03	<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				(0,476) % fällig am 13.07.2018	4.670	4.671	0,40
2,871 % fällig am 25.11.2034	1.046	897	0,08	Accenture PLC 'A'	45.830	6.421	0,55	(c)(d)			
Orwell Park CLO Designated Activity Co.	€ 100	100	0,01	Apple, Inc.	80.040	12.690	1,09				
0,780 % fällig am 18.07.2029				Applied Materials, Inc.	135.090	5.344	0,46	Summe kurzfristige Instrumente		404.030	34,68
Red & Black Auto Lease Germany S.A.	767	769	0,07	Automatic Data Processing, Inc.	31.860	3.660	0,31	Börse/Geregelter Markt	€ 1.152.594		98,92
0,030 % fällig am 15.11.2027				Cisco Systems, Inc.	230.110	8.481	0,73				
SC Germany Auto UG	681	683	0,06	Cognizant Technology Solutions Corp. 'A'	45.090	3.051	0,26				
0,031 % fällig am 13.12.2026	2.700	2.714	0,23	Electronic Arts, Inc. (b)	76.420	9.230	0,79				
0,031 % fällig am 13.12.2027				HP, Inc.	458.810	8.917	0,77				
Soundview Home Loan Trust	\$ 132	110	0,01	International Business Machines Corp.	23.950	2.866	0,25				
2,241 % fällig am 25.03.2037				Lam Research Corp.	19.570	2.897	0,25				
2,261 % fällig am 25.07.2037	1.393	1.042	0,09	Microsoft Corp.	109.470	9.246	0,79				
2,261 % fällig am 25.08.2037	1.459	1.147	0,10	NVIDIA Corp.	15.260	3.096	0,27				
2,341 % fällig am 25.10.2036	200	163	0,01	Oracle Corp.	272.780	10.294	0,88				
2,991 % fällig am 25.10.2037	3.214	2.349	0,20	QUALCOMM, Inc.	56.700	2.725	0,23				
THL Credit Wind River CLO Ltd.	500	430	0,04			88.918	7,63				
3,798 % fällig am 15.01.2026				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
Tikehau CLO BV	€ 400	401	0,03	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (j)</b>							
0,600 % fällig am 04.08.2028						247.803	21,27				
Tymon Park CLO Ltd.	200	200	0,02	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>							
0,590 % fällig am 21.01.2029				Europäische Finanzstabilisierungsfazilität	€ 22.800	23.384	2,01				
VOLT LLC	\$ 1.207	1.028	0,09	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV	100	86	0,01				
3,125 % fällig am 25.09.2047		71	0,01	0,125 % fällig am 27.07.2018		23.470	2,02				
3,250 % fällig am 25.05.2047		60	0,01								
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust	224	188	0,02								
3,141 % fällig am 25.10.2034											
WhiteHorse Ltd.	117	100	0,01								
3,563 % fällig am 03.02.2025											
		48.770	4,19								
<b>STAATSEMISSIONEN</b>											
Autonomous Community of Madrid	€ 5.000	5.118	0,44								
2,875 % fällig am 06.04.2019											
China Development Bank	5.000	5.007	0,43								
0,125 % fällig am 03.11.2019											
Comunidad Autonoma de Aragon	10.385	10.479	0,90								
4,000 % fällig am 20.09.2018											
Cyprus Government International Bond	400	421	0,04								
2,750 % fällig am 27.06.2024											
3,750 % fällig am 26.07.2023	1.400	1.543	0,13								
3,875 % fällig am 06.05.2022	1.500	1.648	0,14								
4,250 % fällig am 04.11.2025	1.000	1.142	0,10								
France Government International Bond	31.000	31.473	2,70								
4,250 % fällig am 25.10.2018											

## 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
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09/2018	1.255	€ (3.464)	(0,30)
Euro STOXX 50 September Futures	Short	09/2018	2.827	1.456	0,13
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	314	(372)	(0,03)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	42	65	0,01
Mini MSCI Emerging Markets Index September Futures	Short	09/2018	873	343	0,03
Nikkei 225 Index September Futures	Long	09/2018	808	(1.008)	(0,09)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 131,000 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Short	08/2018	391	54	0,00
Topix Index September Futures	Long	09/2018	161	(490)	(0,04)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	2.386	497	0,04
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	1.051	10	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	149	32	0,00
				€ (2.877)	(0,25)

## OPTIONSKAUF

## OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOE S&P 500	€ 2.700,000	20.07.2018	100	€ 217	€ 215	0,02

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOE MSCI Emerging Markets	€ 1.035,000	20.07.2018	123	€ (125)	€ (88)	(0,01)
Put - CBOE S&P 500	2.650,000	20.07.2018	100	(128)	(122)	(0,01)
Put - EUREX EURO STOXX 50	3.250,000	20.07.2018	347	(73)	(48)	0,00
Put - EUREX EURO STOXX 50	3.325,000	20.07.2018	341	(80)	(88)	(0,01)
Put - EUREX EURO STOXX 50	3.375,000	20.07.2018	340	(89)	(134)	(0,01)
Put - EUREX EURO STOXX 50	3.425,000	20.07.2018	334	(72)	(202)	(0,02)
				€ (567)	€ (682)	(0,06)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

€ (3.344) (0,29)

## 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>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Daimler AG	1,000 %	20.12.2020	€ 1.100	€ 0	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 29 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2023	€ 60.900	€ 83	0,01

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,800 %	13.12.2022	CAD 191.400	€ (1.221)	(0,10)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.12.2023	€ 33.900	292	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.12.2028	41.900	315	0,03
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2022	¥2.110.000	(3)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	2.430.000	174	0,01
					€ (443)	(0,04)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

€ (360) (0,03)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

(2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

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

### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	19.09.2018	€ 57.600	€ (98)	€ (123)	(0,01)
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	46.300	(88)	(82)	(0,01)
						€ (186)	€ (205)	(0,02)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
HUS	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.03.2019	\$ 2.200	€ 1	€ (2)	€ (1)	0,00

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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 WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettover- mögens
SOG	Erhalt	Topix Bank	1	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	¥ 0	26.10.2018	€ 0	€ 0	€ 0	0,00

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07/2018	ARS 70.430	\$ 2.538	€ 83	€ 0	€ 83	0,01
	07/2018	BRL 2.240	592	9	0	9	0,00
	07/2018	€ 24.981	£ 22.109	19	0	19	0,00
	07/2018	951	¥ 121.800	0	(9)	(9)	0,00
	07/2018	18.112	\$ 21.247	91	(5)	86	0,01
	07/2018	£ 1.411	€ 1.603	7	0	7	0,00
	08/2018	22.127	24.981	0	(19)	(19)	0,00
	08/2018	\$ 591	BRL 2.240	0	(9)	(9)	0,00
BPS	07/2018	ARS 79.281	\$ 3.045	256	0	256	0,02
	07/2018	€ 1.185	1.394	9	0	9	0,00
	07/2018	\$ 12.902	ARS 332.967	0	(1.182)	(1.182)	(0,10)
BRC	07/2018	ARS 24.004	\$ 836	17	0	17	0,00
	07/2018	€ 173	200	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2018	ARS 5.019	175	4	0	4	0,00
	07/2018	DKK 30.511	€ 4.097	2	0	2	0,00
	07/2018	€ 34.916	\$ 40.362	0	(346)	(346)	(0,03)
DUB	08/2018	\$ 11.674	RUB 726.310	0	(133)	(133)	(0,01)
	07/2018	ARS 125.190	\$ 4.489	128	0	128	0,01
GLM	07/2018	12.514	437	11	0	11	0,00
	07/2018	AUD 18.341	€ 11.818	211	0	211	0,02
	07/2018	€ 15.988	¥ 2.050.700	0	(131)	(131)	(0,01)
	07/2018	\$ 23.166	\$ 26.936	0	(95)	(95)	(0,01)
	07/2018	¥ 553.600	€ 4.343	62	0	62	0,01
	07/2018	\$ 65.585	55.655	0	(518)	(518)	(0,04)
	09/2018	CNH 309	\$ 48	1	0	1	0,00
	07/2018	ARS 5.014	175	4	0	4	0,00
HUS	07/2018	\$ 602	BRL 2.240	0	(17)	(17)	0,00
	07/2018	33	€ 29	0	0	0	0,00
	08/2018	RUB 728.013	\$ 11.648	87	0	87	0,01
	09/2018	TWD 502.767	16.930	300	0	300	0,03
JPM	07/2018	ARS 2.386	84	2	0	2	0,00
	07/2018	€ 2.993	¥ 379.200	0	(61)	(61)	(0,01)
	07/2018	15.300	\$ 17.674	0	(163)	(163)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)		% des Nettovermogens
						€	€	
MSB	07/2018	\$ 56.985	€ 48.657	€ 0	€ (150)	€ (150)	(0,01)	
	07/2018	£ 10.235	11.704	130	0	130	0,01	
	09/2018	ARS 10.814	\$ 490	117	0	117	0,01	
RBC	07/2018	€ 1.127	¥ 143.900	0	(14)	(14)	0,00	
SCX	07/2018	813	\$ 950	1	0	1	0,00	
	07/2018	\$ 346.768	€ 299.337	2.333	0	2.333	0,20	
SOG	09/2018	KRW 23.522.301	\$ 21.884	599	0	599	0,05	
	07/2018	€ 4.095	DKK 30.511	1	0	1	0,00	
	07/2018	£ 10.300	€ 11.675	27	0	27	0,00	
SSB	07/2018	\$ 1.499	ARS 41.764	0	(69)	(69)	(0,01)	
	08/2018	13.619	RUB 862.355	49	0	49	0,00	
	09/2018	ARS 41.764	\$ 1.403	54	0	54	0,00	
	10/2018	DKK 30.511	€ 4.096	0	0	0	0,00	
	07/2018	€ 325.367	\$ 378.762	1	(961)	(960)	(0,08)	
UAG	07/2018	\$ 4.000	€ 3.456	30	0	30	0,00	
	08/2018	379.202	325.025	945	0	945	0,08	
	07/2018	CAD 3.290	2.171	29	0	29	0,00	
	07/2018	€ 995	CAD 1.548	13	0	13	0,00	
				€ 5.632	€ (3.883)	€ 1.749	0,15	

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die thesaurierenden Anteile der Institutional CHF (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)		% des Nettovermogens
						€	€	
CBK	07/2018	€ 430	CHF 493	€ 0	€ (5)	€ (5)	0,00	
HUS	07/2018	430	493	0	(5)	(5)	0,00	
RBC	07/2018	376	434	0	(1)	(1)	0,00	
SSB	07/2018	CHF 495	€ 428	1	0	1	0,00	
	07/2018	€ 56	CHF 65	0	0	0	0,00	
	08/2018	429	495	0	(1)	(1)	0,00	
				€ 1	€ (12)	€ (11)	0,00	

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)		% des Nettovermogens
						€	€	
BOA	07/2018	£ 611	€ 691	€ 0	€ 0	€ 0	0,00	
	08/2018	€ 681	£ 603	1	0	1	0,00	
HUS	07/2018	712	624	0	(7)	(7)	0,00	
JPM	07/2018	691	604	0	(8)	(8)	0,00	
UAG	07/2018	661	581	0	(4)	(4)	0,00	
				€ 1	€ (19)	€ (18)	0,00	

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional USD (Hedged) Class und Class E USD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)		% des Nettovermogens
						€	€	
BPS	07/2018	€ 14.801	\$ 17.167	€ 0	€ (97)	€ (97)	(0,01)	
CBK	07/2018	1	2	0	0	0	0,00	
GLM	07/2018	2.062	2.409	1	0	1	0,00	
HUS	07/2018	40	46	0	(1)	(1)	0,00	
IND	07/2018	2	3	0	0	0	0,00	
JPM	07/2018	98	115	1	0	1	0,00	
MSB	07/2018	12.776	14.906	0	(9)	(9)	0,00	
	07/2018	\$ 17.157	€ 14.855	159	0	159	0,01	
	08/2018	€ 14.855	\$ 17.195	0	(159)	(159)	(0,01)	
RYL	07/2018	\$ 388	€ 333	1	0	1	0,00	
SSB	07/2018	€ 14.881	\$ 17.316	0	(50)	(50)	0,00	
	07/2018	\$ 17.208	€ 14.782	44	0	44	0,00	
	08/2018	€ 14.782	\$ 17.246	0	(43)	(43)	0,00	
UAG	07/2018	38	44	0	0	0	0,00	
				€ 206	€ (359)	€ (153)	(0,01)	
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>€ 1.361</b>	<b>0,12</b>	
<b>Summe Anlagen</b>						<b>€ 1.150.251</b>	<b>98,72</b>	
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>€ 14.915</b>	<b>1,28</b>	
<b>Nettovermogen</b>						<b>€ 1.165.166</b>	<b>100,00</b>	

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

### 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) Wertpapier per Emissionstermin.

(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.

Barmittel in Höhe von EUR 25.803 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 578 und Barmittel in Höhe von EUR 16.874 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	(0,650) %	29.06.2018	02.07.2018	€ 30.600	Kingdom of Belgium Government International Bond 1,000 % fällig am 22.06.2031	€ (30.859)	€ 30.600	€ 30.599	2,63
IND	(0,540)	29.06.2018	02.07.2018	214.300	Bank Nederlandse Gemeenten 1,000 % fällig am 19.03.2019 Caisse d'Amortissement De La Dette Sociale 4,000 % fällig am 25.10.2019	(92.630)	214.300	214.294	18,39
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	\$ 3.389	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	(121.027)	2.903	2.903	0,25
						(2.964)	2.903	2.903	0,25
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>€ (247.480)</b>	<b>€ 247.803</b>	<b>€ 247.796</b>	<b>21,27</b>

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

#### Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	€	232.535	€	919.884	€	175	€ 1.152.594
Finanzderivate <sup>(3)</sup>		(2.189)		(154)		0	(2.343)
<b>Summen</b>	<b>€</b>	<b>230.346</b>	<b>€</b>	<b>919.730</b>	<b>€</b>	<b>175</b>	<b>€ 1.150.251</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	€	101.666	€	885.784	€	178	€ 987.628
Finanzderivate <sup>(3)</sup>		(38)		(708)		0	(746)
<b>Summen</b>	<b>€</b>	<b>101.628</b>	<b>€</b>	<b>885.076</b>	<b>€</b>	<b>178</b>	<b>€ 986.882</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ 168	€ (250)	€ (82)
BPS	(1.014)	578	(436)
BRC	16	0	16
CBK	(478)	590	112
CKL	(123)	0	(123)
DUB	46	(260)	(214)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
GLM	€ (458)	€ 560	€ 102
HUS	360	(360)	0
JPM	(379)	650	271
MSB	238	(330)	(92)
RBC	(15)	0	(15)
RYL	1	0	1
SCX	2.933	(5.270)	(2.337)
SOG	62	0	62
SSB	(34)	0	(34)
UAG	38	0	38

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	53,12	63,82
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	14,31	31,32
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	31,49	0,39
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,29)	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	(0,06)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,12	0,01

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Dynamic Multi-Asset Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 22.08.2018	€ 50.000	€ 50.072	PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)	303.610	€ 30.564
	<b>AKTIEN</b>			<b>PARI (000S)</b>	
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Mortgage Opportunities Fund (a)	3.031.746	30.560	France Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.05.2018	€ 22.340	22.357
	<b>PARI (000S)</b>		Italy Treasury Bills 0,000 % fällig am 31.01.2018	21.660	21.670
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 2,625 % fällig am 02.05.2019	€ 22.800	23.412	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.03.2019	20.500	21.240
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.05.2018	22.340	22.373		<b>AKTIEN</b>	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.03.2019	20.500	21.637	Alphabet, Inc. 'A'	9.290	7.512
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.04.2019	21.200	21.259		<b>PARI (000S)</b>	
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.03.2018	21.190	21.208	France Treasury Bills 0,000 % fällig am 22.08.2018	€ 6.500	6.507
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 21.600	17.457		<b>AKTIEN</b>	
	<b>AKTIEN</b>		Abbott Laboratories	121.770	6.357
PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)	168.560	17.086		<b>PARI (000S)</b>	
Apple, Inc.	80.040	11.181	Argentina Government International Bond 7,820 % fällig am 31.12.2033	€ 5.229	5.929
Oracle Corp.	272.780	10.955	France Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.02.2018	5.200	5.203
	<b>PARI (000S)</b>		Italy Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2018	\$ 4.680	4.682
Comunidad Autonoma de Aragon 4,000 % fällig am 20.09.2018	€ 10.385	10.531		<b>AKTIEN</b>	
	<b>AKTIEN</b>		PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund (a)	239.504	2.951
HP, Inc.	458.810	8.823		<b>PARI (000S)</b>	
Electronic Arts, Inc.	76.420	8.686	France Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.06.2018	2.370	2.373
Cisco Systems, Inc.	230.110	8.266		<b>AKTIEN</b>	
Alphabet, Inc. 'A'	9.290	8.220	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Mortgage Opportunities Fund (a)	229.931	€ 2.320
Microsoft Corp.	109.470	8.162		<b>PARI (000S)</b>	
	<b>PARI (000S)</b>		Accredited Mortgage Loan Trust 2,577 % fällig am 25.09.2035	\$ 2.800	2.115
Dexia Credit Local S.A. 0,250 % fällig am 01.06.2023	€ 8.100	8.076	France Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.02.2018	€ 1.670	1.672
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.06.2018	7.700	7.711	SME Grecale SRL 0,017 % fällig am 22.03.2056	1.043	1.042
Greece Treasury Bills 0,000 % fällig am 31.08.2018	7.500	7.455	Europäischer Stabilitätsmechanismus 1,250 % fällig am 15.10.2018	120	121
	<b>AKTIEN</b>				
Accenture PLC 'A'	\$ 45.830	6.109	(a) Der Dynamic Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.		
Applied Materials, Inc.	135.090	5.982	(b) Der Nennwert des Wertpapiers wurde inflationsbereinigt.		
AbbVie, Inc.	63.060	5.935			
Abbott Laboratories	121.770	5.874	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.		
Amgen, Inc.	39.460	5.847			
Gilead Sciences, Inc.	88.840	5.831			
	<b>PARI (000S)</b>				
Autonomous Community of Madrid 2,875 % fällig am 06.04.2019	€ 5.000	5.127			
Bayer Capital Corp. BV 0,227 % fällig am 26.06.2022	5.000	5.027			
Goldman Sachs Group, Inc. 0,129 % fällig am 16.12.2020	5.000	5.001			
Morgan Stanley 0,074 % fällig am 21.05.2021	5.000	4.997			

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Asia 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
<b>MALAYSIA</b>				<b>SINGAPUR</b>				<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
TNB Global Ventures Capital Bhd.				BOC Aviation Ltd.				Vedanta Resources PLC			
3,244 % fällig am 19.10.2026	\$ 200	\$ 185	0,52	3,875 % fällig am 27.04.2026	\$ 400	\$ 386	1,07	6,375 % fällig am 30.07.2022	\$ 400	\$ 382	1,06
<b>MAURITIUS</b>				Marble Pte. Ltd.				<b>USA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,300 % fällig am 20.06.2022				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Greenko Dutch BV				Medco Straits Services Pte. Ltd.				Hyundai Capital America			
4,875 % fällig am 24.07.2022	250	235	0,65	8,500 % fällig am 17.08.2022	200	200	0,56	2,750 % fällig am 27.09.2026	200	177	0,49
<b>MONGOLEI</b>				Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.				<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				4,250 % fällig am 19.06.2024 (c)				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Mongolia Government International Bond				United Overseas Bank Ltd.				China Cinda Finance 2017 Ltd.			
5,125 % fällig am 05.12.2022	200	188	0,53	3,500 % fällig am 16.09.2026 (c)	200	197	0,55	4,100 % fällig am 09.03.2024	400	392	1,09
10,875 % fällig am 06.04.2021	200	223	0,62	Summe Singapur		1.271	3,54	China Reinsurance Finance Corp. Ltd.			
Summe Mongolei		411	1,15	<b>SÜDKOREA</b>				3,375 % fällig am 09.03.2022	600	573	1,60
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Joyous Glory Group Ltd.			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				KEB Hana Bank				5,700 % fällig am 07.03.2020	200	203	0,57
Indo Energy Finance BV				4,250 % fällig am 14.10.2024 (c)				King Power Capital Ltd.			
6,375 % fällig am 24.01.2023	200	189	0,53	Korean Reinsurance Co.				5,625 % fällig am 03.11.2024	200	211	0,59
<b>PAKISTAN</b>				4,500 % fällig am 21.10.2044				NWD Finance BVI Ltd.			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Woori Bank				5,750 % fällig am 05.10.2021 (a)	200	183	0,51
Pakistan Government International Bond				5,250 % fällig am 16.05.2022 (a)(c)				RKI Overseas Finance Ltd.			
6,875 % fällig am 05.12.2027	200	174	0,49	Summe Südkorea		881	2,46	4,700 % fällig am 06.09.2021	200	186	0,52
<b>PHILIPPINEN</b>				<b>SRI LANKA</b>				Studio City Co. Ltd.			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,250 % fällig am 30.11.2021	400	414	1,15
BDO Unibank, Inc.				National Savings Bank				Wiseyear Holdings Ltd.			
2,950 % fällig am 06.03.2023	300	284	0,79	5,150 % fällig am 10.09.2019				5,875 % fällig am 06.04.2021	200	209	0,58
ICTSI Treasury BV				SriLankan Airlines Ltd.				Summe Jungferninseln (Britisch)		2.371	6,61
4,625 % fällig am 16.01.2023	200	201	0,56	5,300 % fällig am 27.06.2019				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
Philippine National Bank				Summe Sri Lanka		396	1,10	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (d)</b>			
4,250 % fällig am 27.04.2023	400	395	1,10	<b>THAILAND</b>						158	0,44
SM Investments Corp.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe kurzfristige Instrumente		158	0,44
4,875 % fällig am 10.06.2024	200	203	0,57	Krung Thai Bank PCL				<b>AKTIEN</b>			
Summe Philippinen		1.083	3,02	5,200 % fällig am 26.12.2024 (c)				<b>ZUR BÄRMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				RH International Singapore Corp. Pte Ltd.				PIMCO Funds Ireland p.l.c. -			
Philippines Government International Bond				4,500 % fällig am 27.03.2028				PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (b)	183.556	1.838	5,12
7,750 % fällig am 14.01.2031	600	791	2,21	Summe Thailand		509	1,42	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche			
9,500 % fällig am 02.02.2030	200	292	0,81	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Börse/Geregelter Markt		\$ 35.429	98,80
Summe Philippinen		2.166	6,04								

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-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	1	\$ (1)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09/2018	7	3	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2018	12	(3)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	22	14	0,04
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	1	(6)	(0,02)
				\$ 7	0,02
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 7	0,02

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (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>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Malaysian Government International Bond	1,000 %	20.06.2022	\$ 300	\$ 0	\$ 2	\$ 2	0,00
BRC	Indonesia Government International Bond	0,000	20.06.2023	300	(4)	(1)	(5)	(0,02)
	Malaysian Government International Bond	1,000	20.12.2021	500	(5)	9	4	0,01
	Philippines Government International Bond	1,000	20.06.2022	200	2	0	2	0,01
GST	Indonesia Government International Bond	0,000	20.06.2023	700	(9)	(2)	(11)	(0,03)
HUS	Indonesia Government International Bond	0,000	20.06.2023	500	(7)	(1)	(8)	(0,02)
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2024	400	(3)	(12)	(15)	(0,04)
					\$ (26)	\$ (5)	\$ (31)	(0,09)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	
BPS	07/2018	€ 310	\$ 363	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00	
HUS	09/2018	CNH 259	41	2	0	2	0,01	
SSB	07/2018	\$ 361	€ 310	1	0	1	0,00	
	08/2018	€ 310	\$ 362	0	(1)	(1)	0,00	
UAG	09/2018	HKD 200	26	0	0	0	0,00	
					\$ 4	\$ (1)	\$ 3	0,01
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ (28)</b>	<b>(0,08)</b>	
<b>Summe Anlagen</b>						<b>\$ 35.408</b>	<b>98,74</b>	
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>\$ 449</b>	<b>1,26</b>	
<b>Nettovermögen</b>						<b>\$ 35.857</b>	<b>100,00</b>	

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (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 USD 46 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

(d) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 158	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.01.2022	\$ (164)	\$ 158	\$ 158	0,44
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (164)</b>	<b>\$ 158</b>	<b>\$ 158</b>	<b>0,44</b>

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

Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 1.859	\$ 33.570	\$ 0	\$ 35.429
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	7	(28)	0	(21)
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.866</b>	<b>\$ 33.542</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 35.408</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Asia Bond Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	Wesentliche sonstige			Marktwert
	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.145	\$ 37.884	\$ 0	\$ 40.029
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(11)	23	0	12
<b>Summen</b>	<b>\$ 2.134</b>	<b>\$ 37.907</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 40.041</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BPS	\$ 3	\$ 0	\$ 3
BRC	1	0	1
GST	(11)	0	(11)
HUS	(21)	0	(21)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,40	95,00
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	3,31	1,83
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	8,09	3,33
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,02	(0,03)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,08)	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	0,00	(1,06)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Asia Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	1.020.120	\$ 10.214	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	1.048.727	\$ 10.500
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Horse Gallop Finance Ltd. 3,516 % fällig am 28.06.2021	\$ 400	400	China Evergrande Group 8,750 % fällig am 28.06.2025	\$ 423	425
RH International Singapore Corp. Pte Ltd. 4,500 % fällig am 27.03.2028	400	400	Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,835 % fällig am 13.12.2027	400	402
CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 4,625 % fällig am 14.03.2023	400	400	SK Telecom Co. Ltd. 3,750 % fällig am 16.04.2023	400	397
Export-Import Bank of India 3,875 % fällig am 01.02.2028	400	399	Hankook Tire Co Ltd. 3,500 % fällig am 30.01.2023	400	395
SK Telecom Co. Ltd. 3,750 % fällig am 16.04.2023	400	399	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 2,500 % fällig am 13.09.2022	400	388
Hankook Tire Co Ltd. 3,500 % fällig am 30.01.2023	400	399	Tewoo Group Finance Ltd. 4,500 % fällig am 16.12.2019	400	388
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 3,750 % fällig am 23.01.2023	400	398	CNOOC Finance Ltd. 3,000 % fällig am 09.05.2023	400	386
Philippine National Bank 4,250 % fällig am 27.04.2023	400	398	Postal Savings Bank of China Co. Ltd. 4,500 % fällig am 31.12.2099	300	293
Korea Resources Corp. 4,000 % fällig am 18.04.2023	400	398	Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % fällig am 31.12.2099	300	293
Poly Real Estate Finance Ltd. 3,950 % fällig am 05.02.2023	400	398	Far East Horizon Ltd. 4,350 % fällig am 31.12.2099	250	249
China Evergrande Group 7,500 % fällig am 28.06.2023	400	393	Bank of China Ltd. 3,500 % fällig am 20.04.2027	250	240
China Cinda Finance 2017 Ltd. 4,100 % fällig am 09.03.2024	400	391	China Resources Land Ltd. 6,000 % fällig am 27.02.2024	200	225
ICICI Bank Ltd. 3,250 % fällig am 09.09.2022	400	382	China Overseas Finance Cayman Ltd. 5,375 % fällig am 29.10.2023	200	216
Alibaba Group Holding Ltd. 4,200 % fällig am 06.12.2047	300	308	ICTSI Treasury BV 5,875 % fällig am 17.09.2025	200	216
Yanlord Land HK Co. Ltd. 6,750 % fällig am 23.04.2023	300	300	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,550 % fällig am 29.03.2026	200	211
Huarong Finance 2017 Co. Ltd. 4,000 % fällig am 07.11.2022	300	282	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 4,375 % fällig am 17.10.2023	200	210
Perusahaan Listrik Negara PT 4,125 % fällig am 15.05.2027	300	279	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,325 % fällig am 28.05.2025	200	208
Bank of China Ltd. 5,000 % fällig am 13.11.2024	200	206	Sri Lanka Government International Bond 6,250 % fällig am 04.10.2020	200	207
Country Garden Holdings Co. Ltd. 7,500 % fällig am 09.03.2020	200	206	China Clean Energy Development Ltd. 4,000 % fällig am 05.11.2025	200	206
Health and Happiness International Holdings Ltd. 7,250 % fällig am 21.06.2021	200	204			
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 3,900 % fällig am 17.05.2022	200	203			
ICTSI Treasury BV 4,625 % fällig am 16.01.2023	200	203			

(a) Der Emerging Asia Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapiervanlagen des Emerging Local Bond Fund

30. Juni 2018

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>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>CHILE STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNGARN STAATSEMISSIONEN</b>						
<b>ARGENTINIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Bonos de la Tesoreria de la Republica				Hungary Government International Bond						
Banco de Galicia y Buenos Aires S.A.				4,500 % fällig am 15.10.2023	CLP	135.835 \$	245	0,01	2,750 % fällig am 22.12.2026	HUF	77.000 \$	260	0,01	
25,980 % fällig am 26.04.2020	ARS	105.000	3,008	0,13	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos			3,000 % fällig am 26.06.2024		2.386.600	8,567	0,36		
Banco Santander Mexico S.A.				4,500 % fällig am 01.03.2021		12.180.000	19.112	0,81	5,500 % fällig am 24.06.2025		166.600	685	0,03	
25,500 % fällig am 17.07.2019		74.300	2,268	0,10	4,500 % fällig am 01.03.2026		3.955.000	6,058	0,26	6,000 % fällig am 24.11.2023		1.956.200	8,153	0,35
HSBC Bank Argentina S.A.				5,000 % fällig am 01.03.2035		3.195.000	4.901	0,21	7,500 % fällig am 12.11.2020		658.500	2,662	0,11	
25,250 % fällig am 27.09.2019		82.300	2,443	0,10	Bonos del Banco Central de Chile en Pesos			Summe Ungarn						
				6,000 % fällig am 01.03.2022		1.620.000	2,664	0,11			20.327	0,86		
				Bonos del Banco Central de Chile en UF										
		7.719	0,33	3,000 % fällig am 01.07.2018		108.624	167	0,01						
Summe Argentinien				47.197	2,00	Summe Chile		33.147	1,41					
<b>BRASIL IEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>CHINA STAATSEMISSIONEN</b>				<b>INDONESIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais				China Government International Bond				Jasa Marga Persero Tbk PT						
5,333 % fällig am 15.02.2028	\$	300	287	0,01	3,100 % fällig am 29.06.2022	CNY	500	74	0,00	7,500 % fällig am 11.12.2020	IDR	89.620.000	5,925	0,25
Caixa Economica Federal				KOLUMBIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Indonesia Government International Bond						
4,500 % fällig am 03.10.2018		2.600	2,606	0,11	Banco Davivienda S.A.				6,125 % fällig am 15.05.2028		1.281.000	79	0,01	
Centrais Electricas Brasileiras S.A.				7,500 % fällig am 24.10.2022	COP	19.100.000	6,637	0,28	8,750 % fällig am 15.05.2031		23.700.000	1,711	0,07	
6,875 % fällig am 30.07.2019		3.300	3,391	0,14	Empresas Publicas de Medellin ESP				8,750 % fällig am 15.02.2044		71.716.000	5,181	0,22	
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				7,625 % fällig am 10.09.2024		17.497.000	5,852	0,25	9,500 % fällig am 15.07.2031		11.674.000	894	0,04	
0,000 % fällig am 30.07.2018 (b)(d)		485	8	0,00	8,375 % fällig am 01.02.2021		13.366.000	4,681	0,20	9,500 % fällig am 15.05.2041		3.363.000	261	0,01
Petrobras Global Finance BV				8,375 % fällig am 08.11.2027		26.047.000	8,758	0,37	11,750 % fällig am 15.08.2023		2.200.000	184	0,01	
6,125 % fällig am 17.01.2022		2.443	2,491	0,11	Summe Kolumbien				Summe Indonesien					
8,375 % fällig am 23.05.2021		2.961	3,228	0,14			60.007	2,55			14.235	0,61		
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL				<b>TSCHECHISCHE REPUBLIK STAATSEMISSIONEN</b>				<b>IRLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
9,850 % fällig am 16.07.2032	BRL	108.600	26,251	1,11	Czech Republic Government International Bond				ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC					
Summe Brasilien		38.262	1,62	0,00 % fällig am 10.02.2020 (b)	CZK	56.200	2,496	0,11	2,626 % fällig am 28.04.2020	€	8.600	10,060	0,42	
				0,950 % fällig am 15.05.2030		353.440	13,510	0,57	AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.			3,500	3,520	0,15
				1,000 % fällig am 26.06.2026		158.300	6,579	0,28	Russian Railways via RZD Capital PLC			1.067.400	17,199	0,73
				3,750 % fällig am 12.09.2020		41.500	1,972	0,08	8,300 % fällig am 02.04.2019	RUB	1.067.400	17,199	0,73	
				4,600 % fällig am 18.08.2018		77.700	3,507	0,15	Summe Irland					
				Summe Tschechische Republik				28.064	1,19			40.124	1,70	
<b>CAYMAN INSELN FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK STAATSEMISSIONEN</b>				<b>INVESTMENT FONDS AKTIEN</b>						
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.				Dominican Republic International Bond				PIMCO Specialty Funds Ireland						
3,279 % fällig am 20.04.2027	\$	1.150	1,149	0,05	8,900 % fällig am 15.02.2023	DOP	174.150	3,569	0,15	p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (e)				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>FRANKREICH UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Japan						
Interoceanea Finance Ltd.				BNP Paribas S.A.				625,25 % fällig am 18.05.2033						
0,000 % fällig am 30.11.2018 (b)		204	199	0,01	6,240 % fällig am 06.02.2025	IDR	396.200.000	23,571	1,00			50,747	2,15	
KSA Sukuk Ltd.				<b>DEUTSCHLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>KASACHSTAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
2,894 % fällig am 20.04.2022		7.200	7,011	0,30	Deutsche Bank AG				Development Bank of Kazakhstan JSC					
Odebrecht Drilling Norbe Ltd.				1,875 % fällig am 28.02.2020	£	5.000	6,527	0,28	8,950 % fällig am 04.05.2023	KZT	2.084.000	6,099	0,26	
6,350 % fällig am 01.12.2021		243	230	0,01	3,312 % fällig am 13.07.2020	\$	6.400	6,362	0,27	KazMunayGas National Co. JSC				
Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar oder 7,350 % PIK)				4,250 % fällig am 14.10.2021		11.500	11,346	0,48	9,125 % fällig am 02.07.2018	\$	6.400	6,400	0,27	
7,350 % fällig am 01.12.2026 (a)		426	212	0,01	6,680 % fällig am 23.01.2025	IDR	689.400.000	43,579	1,85	Summe Kasachstan				
Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.				Summe Deutschland				67.814	2,88			12.499	0,53	
6,720 % fällig am 01.12.2022		509	462	0,02	<b>LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.					
QNB Finance Ltd.				Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.				5,338 % fällig am 25.09.2020						
2,750 % fällig am 31.10.2018		1.500	1,499	0,06	Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.				£					
3,705 % fällig am 12.02.2020		9.700	9,746	0,41	GQGO Constellation S.A. (9,000 % bar und 0,500 % PIK)				\$					
3,713 % fällig am 07.02.2020		9.400	9,470	0,40	9,500 % fällig am 09.11.2024 <sup>(a)</sup>				\$					
SPARC EM SPC Panama Metro Line SP				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				4,150 % fällig am 06.03.2019 (f)						
0,000 % fällig am 05.12.2022 (b)		8.700	7,815	0,33			14.800	14,801	0,63			20.984	0,89	
		36.644	1,55	Summe Luxemburg										
Summe Cayman Inseln				37.793	1,60									

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>MALAYSIA</b>				<b>PHILIPPINEN</b>				<b>SÜDKOREA</b>						
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
<b>Malaysia Government International Bond</b>				<b>Philippines Government International Bond</b>				<b>Export-Import Bank of Korea</b>						
3,418 % fällig am 15.08.2022	MYR	3.359	\$ 818	0,04	3,900 % fällig am 26.11.2022	PHP	333.000	\$ 5.900	0,25	6,360 % fällig am 14.02.2023	IDR	96.100.000	\$ 6.118	0,26
3,480 % fällig am 15.03.2023		20.484	4.970	0,21	4,950 % fällig am 15.01.2021		218.000	4.070	0,17	7,250 % fällig am 07.12.2024		95.500.000	6.406	0,27
3,502 % fällig am 31.05.2027		10.500	2.436	0,10						<b>Korea National Oil Corp.</b>				
3,743 % fällig am 26.08.2021		36.500	9.012	0,38	Summe Philippinen		9.970	0,42	4,250 % fällig am 08.10.2019	AUD	500	374	0,02	
3,795 % fällig am 30.09.2022		71.700	17.729	0,75	<b>POLEN</b>				Summe Südkorea		12.898	0,55		
3,800 % fällig am 17.08.2023		13.200	3.238	0,14	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>SPANIEN</b>					
3,892 % fällig am 15.03.2027		6.300	1.504	0,06	<b>Poland Government International Bond</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
3,990 % fällig am 15.10.2025		32.185	7.798	0,33	1,750 % fällig am 25.07.2021	PLN	69.300	18.410	0,78	<b>Autonomous Community of Catalonia</b>				
4,059 % fällig am 30.09.2024		18.020	4.440	0,19	2,000 % fällig am 25.04.2021		11.100	2.977	0,13	4,900 % fällig am 15.09.2021	€	2.050	2.602	0,11
4,070 % fällig am 30.09.2026		4.900	1.187	0,05	2,500 % fällig am 25.07.2026		139.500	35.690	1,52	<b>SRI LANKA</b>				
4,127 % fällig am 15.04.2032		11.000	2.557	0,11	2,500 % fällig am 25.07.2027		44.100	11.153	0,47	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
4,160 % fällig am 15.07.2021		28.973	7.266	0,31	3,250 % fällig am 25.07.2025		104.400	28.385	1,20	<b>Sri Lanka Government International Bond</b>				
4,181 % fällig am 15.07.2024		78.608	19.514	0,83	4,000 % fällig am 25.10.2023		119.200	34.132	1,45	5,125 % fällig am 11.04.2019	\$	6.800	6.804	0,29
4,232 % fällig am 30.06.2031		25.079	5.956	0,25	5,750 % fällig am 25.10.2021		55.560	16.623	0,71	6,000 % fällig am 14.01.2019		3.100	3.118	0,13
4,254 % fällig am 31.05.2035		11.590	2.650	0,11	5,750 % fällig am 23.09.2022		143.480	43.646	1,85	Summe Sri Lanka		9.922	0,42	
4,392 % fällig am 15.04.2026		16.670	4.151	0,18	Summe Polen		191.016	8,11	<b>ÜBERNATIONAL</b>					
4,444 % fällig am 22.05.2024		14.720	3.698	0,16	<b>KATAR</b>				<b>ÜBERNATIONAL</b>					
4,498 % fällig am 15.04.2030		20.840	5.107	0,22	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
4,709 % fällig am 15.09.2026		12.650	3.216	0,14	<b>Nakilat, Inc.</b>				<b>Corp. Andina de Fomento</b>					
4,736 % fällig am 15.03.2046		11.000	2.634	0,11	6,067 % fällig am 31.12.2033	\$	175	192	0,01	6,500 % fällig am 16.03.2023	IDR	125.900.000	8.235	0,35
4,837 % fällig am 15.07.2025 (f)		400	103	0,00	<b>RUMÄNIEN</b>				6,770 % fällig am 24.05.2028	COP	54.500.000	18.365	0,78	
4,935 % fällig am 30.09.2043		21.030	5.239	0,22	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung</b>					
Summe Malaysia		115.223	4,89	<b>Romania Government International Bond</b>				6,450 % fällig am 13.12.2022	IDR	275.920.000	18.378	0,78		
	<b>AKTIEN</b>			5,750 % fällig am 29.04.2020	RON	5.750	1.484	0,06	7,375 % fällig am 15.04.2019		19.910.000	1.377	0,06	
				5,800 % fällig am 26.07.2027		7.800	2.037	0,09	9,250 % fällig am 02.12.2020		95.290.000	6.868	0,29	
				5,850 % fällig am 26.04.2023		37.100	9.701	0,41	<b>Europäische Investitionsbank</b>					
				5,950 % fällig am 11.06.2021		35.700	9.296	0,40	4,950 % fällig am 01.03.2019		13.500.000	918	0,04	
				Summe Rumänien		22.518	0,96	6,950 % fällig am 06.02.2020		58.660.000	4.004	0,17		
				<b>RUSSLAND</b>				7,200 % fällig am 09.07.2019		101.860.000	7.032	0,30		
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Inter-American Development Bank</b>						
				<b>Russia Government International Bond</b>				8,775 % fällig am 14.03.2023		252.200.000	17.816	0,75		
				6,400 % fällig am 27.05.2020	RUB	377.300	5.958	0,25	9,500 % fällig am 15.04.2019		90.400.000	6.389	0,27	
				7,050 % fällig am 19.01.2028		471.000	7.267	0,31	Summe übernational		89.382	3,79		
				7,400 % fällig am 07.12.2022		650.600	10.426	0,44	<b>THAILAND</b>					
				7,500 % fällig am 18.08.2021		681.600	10.998	0,47	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
				7,600 % fällig am 14.04.2021		273.200	4.418	0,19	<b>Thailand Government International Bond</b>					
				7,600 % fällig am 20.07.2022		114.200	1.844	0,08	2,125 % fällig am 17.12.2026	THB	108.850	3.175	0,13	
				7,700 % fällig am 23.03.2033		1.474.700	23.623	1,00	3,650 % fällig am 20.06.2031		446.400	14.320	0,61	
				7,750 % fällig am 16.09.2026		357.100	5.776	0,25	3,775 % fällig am 25.06.2032		50.000	1.626	0,07	
				8,150 % fällig am 03.02.2027		982.800	16.281	0,69	3,850 % fällig am 12.12.2025		175.800	5.804	0,25	
				8,500 % fällig am 17.09.2031		1.795.200	30.664	1,30	4,875 % fällig am 22.06.2029		197.200	7.109	0,30	
				Summe Russland		117.255	4,98	Summe Thailand		32.034	1,36			
				<b>SÜDAFRIKA</b>				<b>TÜRKEI</b>						
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
				<b>Eskom Holdings SOC Ltd.</b>				<b>Türkiye Garanti Bankasi A/S</b>						
				0,000 % fällig am 18.08.2027 (b)	ZAR	100.100	2.232	0,09	3,606 % fällig am 11.02.2019	\$	14.500	14.395	0,61	
				0,000 % fällig am 31.12.2032 (b)		254.000	2.879	0,12	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
				<b>Transnet SOC Ltd.</b>				<b>Export Credit Bank of Turkey</b>						
				10,000 % fällig am 30.03.2029		40.000	2.740	0,12	5,875 % fällig am 24.04.2019		4.000	4.008	0,17	
				Summe Südafrika		7.851	0,33	<b>Turkey Government International Bond</b>						
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				8,000 % fällig am 12.03.2025	TRY	107.889	15.849	0,67		
				<b>South Africa Government International Bond</b>				8,800 % fällig am 27.09.2023		62.100	9.923	0,42		
				6,750 % fällig am 31.03.2021		5.100	362	0,02	9,000 % fällig am 24.07.2024		2.300	367	0,02	
				7,000 % fällig am 28.02.2031		498.946	30.264	1,28	9,500 % fällig am 12.01.2022		16.310	2.866	0,12	
				7,750 % fällig am 28.02.2023		22.100	1.583	0,07	10,600 % fällig am 11.02.2026		80.600	13.406	0,57	
				8,000 % fällig am 21.12.2018		300	22	0,00	10,700 % fällig am 17.08.2022		74.300	13.267	0,56	
				8,000 % fällig am 31.01.2030		856.200	57.075	2,42	11,000 % fällig am 02.03.2022		53.900	9.877	0,42	
				8,250 % fällig am 31.03.2032		601.180	40.023	1,70	11,000 % fällig am 24.02.2027		161.200	26.883	1,14	
				8,500 % fällig am 31.01.2037		262.400	17.382	0,74	12,200 % fällig am 18.01.2023		44.200	8.312	0,35	
				8,750 % fällig am 31.01.2044		115.100	7.684	0,33	13,000 % fällig am 13.11.2019		42.900	8.793	0,38	
				8,875 % fällig am 28.02.2035		390.800	26.980	1,14	Summe Türkei		113.551	4,82		
				9,000 % fällig am 31.01.2040		630.400	43.296	1,84	Summe Thailand		127.946	5,43		
				Summe Südafrika		232.522	9,87							



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			
(9,693)% fällig am 14.09.2018 (b)(c)	ARS	172.255	6.263	0,27	25,750 % fällig am 19.09.2018 (b)(c)	ARS	48.600	1.546	0,07	15,504 % fällig am 29.11.2018 (b)(c)	NGN	850.000	2.245	0,09
(9,596)% fällig am 14.09.2018 (b)(c)		59.055	2.147	0,09	25,800 % fällig am 19.09.2018 (b)(c)		135.811	4.319	0,18	15,542 % fällig am 11.10.2018 (b)(c)		150.000	403	0,02
(6,771)% fällig am 14.09.2018 (b)(c)		4.980	181	0,01	28,500 % fällig am 19.09.2018 (b)(c)		65.300	2.077	0,09	15,566 % fällig am 29.11.2018 (b)(c)		450.000	1.189	0,05
(5,317)% fällig am 14.09.2018 (b)(c)		6.980	254	0,01	28,600 % fällig am 19.09.2018 (b)(c)		26.656	848	0,04	15,683 % fällig am 11.10.2018 (b)(c)		400.000	1.075	0,05
(4,791)% fällig am 14.09.2018 (b)(c)		7.440	270	0,01	39,900 % fällig am 19.09.2018 (b)(c)		24.510	779	0,03	15,699 % fällig am 22.11.2018 (b)(c)		940.000	2.490	0,11
(4,578)% fällig am 14.09.2018 (b)(c)		3.680	134	0,01	40,000 % fällig am 19.09.2018 (b)(c)		149.000	4.738	0,20	18,882 % fällig am 19.07.2018 (b)(c)		826.700	2.277	0,10
(3,506)% fällig am 14.09.2018 (b)(c)		2.060	75	0,00				35.969	1,53			1.730.000	4.675	0,20
(3,361)% fällig am 14.09.2018 (b)(c)		5.820	212	0,01								1.590.500	4.337	0,18
(3,247)% fällig am 12.10.2018 (b)(c)		4.620	163	0,01	<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>								53.478	2,27
(3,154)% fällig am 14.09.2018 (b)(c)		2.810	102	0,00	11,659 % fällig am 09.10.2018 (b)(c)	EGP	16.900	902	0,04				276.792	11,75
(2,723)% fällig am 12.10.2018 (b)(c)		2.130	75	0,00	<b>GREECE TREASURY BILLS</b>									
(2,374)% fällig am 12.10.2018 (b)(c)		3.740	132	0,01	1,082 % fällig am 05.10.2018 (b)(c)	€	4.600	5.359	0,23					
(0,978)% fällig am 12.10.2018 (b)(c)		21.390	756	0,03	1,674 % fällig am 06.07.2018 (b)(c)		700	817	0,03					
(0,285)% fällig am 12.10.2018 (b)(c)		17.717	627	0,03	<b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>									
0,920 % fällig am 13.07.2018 (b)(c)	\$	790	789	0,03	13,820 % fällig am 06.12.2018 (b)(c)	NGN	8.241.000	21.706	0,92					
0,946 % fällig am 12.10.2018 (b)(c)	ARS	34.780	1.230	0,05	15,056 % fällig am 29.11.2018 (b)(c)		2.876.900	7.600	0,32					
0,996 % fällig am 10.08.2018 (b)(c)	\$	2.340	2.330	0,10	15,450 % fällig am 04.10.2018 (b)(c)		24.600	66	0,00					
1,195 % fällig am 24.08.2018 (b)(c)		2.410	2.396	0,10	15,501 % fällig am 29.11.2018 (b)(c)		2.050.000	5.415	0,23					
1,457 % fällig am 12.10.2018 (b)(c)	ARS	27.910	987	0,04										
1,855 % fällig am 14.09.2018 (b)(c)	\$	1.280	1.270	0,05										
2,171 % fällig am 27.07.2018 (b)(c)		350	349	0,02										
3,154 % fällig am 26.10.2018 (b)(c)		600	592	0,03										

Summe kurzfristige Instrumente

## AKTIEN

ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS			
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	22.969.259	229.991	9,76
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt	\$ 2.474.989	105,04	

## 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
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	1.069	\$ 187	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	118	76	0,00
				\$ 263	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 263	0,01

## 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
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,240 %	02.01.2019	BRL 305.100	\$ 200	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,730	04.01.2021	60.100	(60)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,970	02.01.2020	273.800	605	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,020	02.01.2023	98.600	(1.052)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,600	04.01.2027	48.900	606	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,750	02.01.2025	17.400	(211)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,780	02.01.2025	51.200	(543)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,135	01.07.2021	70.500	(264)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,300	02.01.2025	50.300	(512)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,860	02.01.2023	115.200	628	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,350	04.01.2021	52.600	641	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,380	02.01.2020	377.700	2.733	0,11
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,450	04.01.2027	35.500	94	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,800	04.01.2021	18.490	308	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,850	04.01.2021	78.220	1.422	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	16,395	04.01.2021	14.300	12	0,00
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	1,750	16.09.2020	PLN 5.300	13	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month PLN-WIBOR	2,000	19.09.2020	6.300	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month PLN-WIBOR	2,500	19.09.2023	288.600	309	0,01

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month PLN-WIBOR	2,500 %	16.03.2026	PLN 23.600	\$ (6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,620	20.12.2018	\$ 2.500	10	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,750	20.06.2020	141.200	(461)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	106.330	405	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	149.970	(5.235)	(0,22)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	145.580	(22)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	1.800	411	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	15.06.2046	1.000	139	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	16.12.2045	1.700	111	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	31.810	2.526	0,11
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,500	22.03.2020	ZAR 200	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	19.09.2023	142.300	(112)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,500	15.03.2019	609.200	134	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	15.03.2022	75.000	40	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	19.09.2028	137.400	389	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,750	16.03.2021	393.400	892	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	9,500	16.09.2026	53.400	72	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	2,250	19.12.2023	HUF 15.659.500	(394)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,000	22.02.2023	MXN 206.320	(828)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,500	22.02.2023	240.700	(1.017)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,840	14.09.2021	151.000	(401)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,000	22.02.2023	160.800	(56)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,870	07.08.2020	203.500	255	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,150	21.12.2018	86.200	3	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,380	04.11.2026	527.600	(506)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,650	24.02.2023	842.300	(560)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,830	15.12.2022	395.300	(91)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,856	15.12.2022	381.800	(22)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,875	16.12.2022	55.900	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,880	27.12.2022	505.000	(193)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,920	28.12.2023	979.300	(552)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,103	04.01.2038	6.300	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,135	14.12.2027	28.800	12	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,175	15.01.2029	346.800	153	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,320	07.01.2032	195.200	4	0,00
					\$ 34	0,00
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 34</b>	<b>0,00</b>

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

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

VERKAUFSOPTIONEN								
CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES								
Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf- verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
3RC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950 %	18.07.2018	\$ 15.500	\$ (27)	\$ (2)	0,00
3UB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	20.100	(33)	(3)	0,00
3ST	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	200.100	(185)	(42)	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	9.200	(9)	(4)	0,00
						\$ (254)	\$ (51)	0,00

## DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Put - OTC USD versus RUB	RUB 54,700	06.03.2019	\$ 14.700	\$ (206)	\$ (34)	0,00
HUS	Put - OTC USD versus RUB	54,700	06.03.2019	100	(1)	0	0,00
					\$ (207)	\$ (34)	0,00

## 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	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.06.2019	\$ 4.500	\$ (9)	\$ 36	\$ 27	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.09.2020	200	(8)	11	3	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	2.600	(6)	21	15	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2018	32.600	206	(86)	120	0,01
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	4.100	18	6	24	0,00
	Nigeria Government International Bond	1,000	20.08.2018	6.100	(63)	57	(6)	0,00
GST	Chile Government International Bond	1,000	20.09.2020	4.000	11	51	62	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2018	5.000	(57)	74	17	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	8.300	4	45	49	0,00

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
HUS	Argentine Republic Government International Bond	5,000 %	20.12.2018	\$ 2.400	\$ 25	\$ 5	\$ 30	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.03.2019	3.900	3	(5)	(2)	0,00
JPM	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	5.500	(24)	116	92	0,01
					\$ 100	\$ 331	\$ 431	0,02

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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
CBK	Variable Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR zzgl. 0,191 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.07.2019	TRY 192.700	\$ 41.530	\$ (447)	\$ 940	\$ 493	0,02
HUS	Variable Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR zzgl. 0,191 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.07.2019	189.900	40.707	(222)	917	695	0,03
	Variable Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR zzgl. 0,183 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.07.2020	55.713	11.943	(65)	235	170	0,01
						\$ (734)	\$ 2.092	\$ 1.358	0,06

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
AZD	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,220 %	23.11.2020	THB 39.800	\$ 0	\$ 16	\$ 16	0,00
BOA	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	ILS 65.700	0	23	23	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,285)	16.02.2020	100.800	1	2	3	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,963	16.02.2028	21.300	(2)	29	27	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	13.700	0	(10)	(10)	0,00
	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,310	29.08.2019	COP 13.850.000	0	50	50	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	(3,740)	25.09.2022	MYR 56.900	0	104	104	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,320	27.07.2020	THB 417.700	0	553	553	0,02
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,490	14.01.2021	450.000	0	755	755	0,03
BPS	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,960	21.06.2026	COP 20.919.500	0	(6)	(6)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,385	23.01.2021	THB 139.200	0	218	218	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,415	21.01.2021	104.710	0	166	166	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,480	14.01.2021	4.300	0	8	8	0,00
BRC	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,374)	20.06.2020	ILS 160.200	0	53	53	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	34.500	0	(67)	(67)	0,00
CBK	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,840	22.03.2021	COP 31.343.900	0	(80)	(80)	0,00
	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,780	07.06.2026	66.137.000	0	(265)	(265)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	(3,750)	26.09.2022	MYR 88.100	0	153	153	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,625	27.07.2025	THB 97.500	0	81	81	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,810	23.09.2025	128.180	0	147	147	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,410	15.01.2021	105.700	0	169	169	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,420	17.01.2021	328.450	0	530	530	0,02
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,520	13.01.2021	68.600	0	117	117	0,01
DUB	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,414)	20.06.2020	ILS 66.300	0	8	8	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	14.000	0	26	26	0,00
	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	(6,445)	01.07.2025	COP 10.000.000	0	(134)	(134)	(0,01)
	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,910	16.03.2021	21.500.400	0	(39)	(39)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,015	17.08.2020	THB 86.000	0	32	32	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,580	19.10.2025	76.700	0	47	47	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,390	23.01.2021	139.000	0	219	219	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,410	15.01.2021	105.700	0	170	170	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,410	21.01.2021	100.550	0	159	159	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,780	23.09.2025	20.740	0	23	23	0,00
FBF	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	ILS 132.300	10	37	47	0,00
GLM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,290)	16.02.2020	207.300	2	(1)	1	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,270)	21.03.2020	133.500	0	40	40	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,883	21.03.2028	28.100	0	(42)	(42)	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	43.600	(3)	68	65	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	28.300	0	(21)	(21)	0,00
	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	(6,430)	01.07.2025	COP 9.970.000	0	(131)	(131)	(0,01)
	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,170	25.01.2023	91.148.400	0	(418)	(418)	(0,02)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,455 %	02.06.2022	CLP 8.596.000	\$ 0	\$ (116)	\$ (116)	0,00
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,535	14.11.2022	3.595.100	0	(48)	(48)	0,00
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,095	01.06.2027	12.230.000	0	(174)	(174)	(0,01)
HUS	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	ILS 69.400	0	25	25	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	14.900	1	(12)	(11)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,040	17.08.2020	THB 320.000	0	125	125	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,110	26.01.2022	101.200	0	37	37	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,545	26.01.2027	534.700	0	265	265	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX Reuters	1,990	08.06.2023	1.647.500	0	(114)	(114)	0,00
JPM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,420)	20.06.2020	ILS 58.300	0	5	5	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	2,078	20.06.2028	12.600	0	16	16	0,00
	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,840	22.03.2021	COP 67.355.000	0	(172)	(172)	(0,01)
	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,230	28.05.2020	12.870.000	0	36	36	0,00
	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,250	23.04.2024	25.341.200	0	(190)	(190)	(0,01)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,320	29.07.2020	THB 131.800	0	175	175	0,01
MYC	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	(6,420)	02.07.2025	COP 6.640.000	0	(86)	(86)	0,00
	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,795	03.03.2020	13.765.000	0	7	7	0,00
						\$ 9	\$ 2.568	\$ 2.577	0,11

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettoerhöhung/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07/2018	¥	\$	3.067.900	\$ 27.788	\$ 91	0,00
	09/2018	\$	THB	144	4.710	(1)	0,00
BOA	07/2018	ARS	\$	145.750	5.613	561	0,02
	07/2018	COP		13.491.012	4.688	97	0,00
	07/2018	£		13	17	0	0,00
	07/2018	PLN		25.323	6.805	41	0,00
	07/2018	\$	COP	17.677	50.486.308	(499)	(0,02)
	07/2018		€	34	29	0	0,00
	07/2018		PLN	11.599	39.543	(1.037)	(0,04)
	07/2018		TRY	38.730	161.010	(3.747)	(0,16)
	08/2018	ARS	\$	466.094	21.143	5.701	0,24
	08/2018	BRL		5.314	1.372	(4)	0,00
	08/2018	€		2.059	2.434	22	0,00
	08/2018	HUF		2.264.203	8.661	611	0,03
	08/2018	ILS		1.448	402	5	0,00
	08/2018	MXN		352.057	17.901	143	0,01
	08/2018	\$	CZK	1.593	34.334	(49)	0,00
	08/2018		MXN	965	19.373	12	0,00
	08/2018		ZAR	8.506	108.813	(603)	(0,03)
	08/2018	ZAR	\$	36.188	2.653	25	0,00
	09/2018	ARS		135.811	6.169	1.788	0,08
	09/2018	IDR		111.665.760	7.886	175	0,01
	09/2018	\$	IDR	11	159.179	0	0,00
BPS	07/2018	ARS	\$	819.128	29.501	1.324	0,06
	07/2018	BRL		30.277	8.043	174	0,01
	07/2018	PEN		45.359	13.879	36	0,00
	07/2018	\$	ARS	23.769	652.462	(1.153)	(0,05)
	07/2018		BRL	5.109	19.559	(25)	0,00
	07/2018		CLP	31.582	19.970.801	(906)	(0,04)
	07/2018		€	75	65	1	0,00
	07/2018		¥	28.114	3.053.500	(547)	(0,02)
	07/2018		TRY	1.690	7.095	(153)	(0,01)
	08/2018	ARS	\$	100.710	4.678	1.334	0,06
	08/2018	CZK		36.678	1.657	7	0,00
	08/2018	RON		33.329	8.579	253	0,01
	08/2018	\$	CZK	5.000	111.148	(2)	0,00
	08/2018		HUF	22.672	5.880.354	(1.766)	(0,08)
	08/2018		MXN	26.664	540.172	582	0,02
	08/2018	ZAR	\$	31.901	2.499	182	0,01
	09/2018	\$	THB	87.070	2.779.560	(2.982)	(0,13)
BRC	07/2018	ARS	\$	100.058	3.819	384	0,02
	07/2018	COP		92.418.416	32.269	822	0,03
	07/2018	RUB		117.143	1.863	(4)	0,00
	08/2018	\$	RUB	1.854	117.143	4	0,00
	09/2018	ARS	\$	105.028	3.865	478	0,02
	09/2018	MYR		3.335	820	(3)	0,00
	09/2018	\$	MYR	241	962	(3)	0,00
CBK	07/2018	ARS	\$	12.048	441	27	0,00
	07/2018	CLP		455.836	706	6	0,00
	07/2018	COP		56.717.324	19.807	513	0,02
	07/2018	£		18.869	24.999	87	0,00
	07/2018	PLN		19.548	5.413	192	0,01
	07/2018	TRY		27.687	5.878	(120)	(0,01)
	07/2018	\$	ARS	990	25.837	(108)	0,00
	07/2018		COP	150.128	428.624.175	(4.282)	(0,18)
	07/2018		PLN	13.878	49.335	(700)	(0,03)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	07/2018	\$ 4.236	TRY 20.345	\$ 171	\$ 0	\$ 171	0,01
	08/2018	ARS 5.635	\$ 261	74	0	74	0,00
	08/2018	CZK 229.006	10.648	364	(14)	350	0,01
	08/2018	EGP 77.787	4.267	0	(22)	(22)	0,00
	08/2018	€ 492	577	1	0	1	0,00
	08/2018	MXN 885.767	44.969	542	(251)	291	0,01
	08/2018	RON 24.683	6.239	72	0	72	0,00
	08/2018	RUB 243.790	3.855	0	(12)	(12)	0,00
	08/2018	\$ 11.392	€ 9.666	0	(71)	(71)	0,00
	08/2018	278.122	MXN 5.474.557	165	(2.149)	(1.984)	(0,08)
	08/2018	27.999	RUB 1.769.402	67	0	67	0,00
	09/2018	ARS 75.491	\$ 3.615	1.181	0	1.181	0,05
	09/2018	\$ 1.919	ARS 52.344	0	(231)	(231)	(0,01)
	09/2018	13.216	IDR 187.548.256	0	(264)	(264)	(0,01)
	10/2018	418	ARS 12.550	0	(22)	(22)	0,00
	11/2018	NGN 94.750	\$ 250	0	(8)	(8)	0,00
	12/2018	1.443.510	3.870	0	(40)	(40)	0,00
	03/2019	\$ 4.083	RUB 239.060	0	(359)	(359)	(0,02)
DUB	07/2018	ARS 340.045	\$ 12.192	406	0	406	0,02
	07/2018	\$ 72	COP 202.104	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	318	PLN 1.075	0	(31)	(31)	0,00
	08/2018	73.018	TRY 334.476	0	(1.494)	(1.494)	(0,06)
FBF	09/2018	ARS 42.200	\$ 2.016	654	0	654	0,03
	07/2018	COP 8.837.620	3.058	51	0	51	0,00
	07/2018	\$ 5.893	BRL 22.016	0	(171)	(171)	(0,01)
	08/2018	CZK 13.882	\$ 644	20	0	20	0,00
	08/2018	MXN 128.957	6.434	0	(71)	(71)	0,00
	09/2018	IDR 38.171.829	2.651	15	0	15	0,00
	09/2018	\$ 12.854	INR 872.787	0	(244)	(244)	(0,01)
	10/2018	€ 3.400	\$ 4.236	238	0	238	0,01
GLM	03/2019	RUB 239.060	4.083	359	0	359	0,01
	07/2018	ARS 11.868	430	23	0	23	0,00
	07/2018	BRL 1.411.125	370.551	3.824	0	3.824	0,16
	07/2018	CLP 5.919.255	9.441	349	0	349	0,01
	07/2018	COP 63.752.785	21.892	199	0	199	0,01
	07/2018	MYR 2.817	709	11	0	11	0,00
	07/2018	PEN 21.991	6.709	2	(4)	(2)	0,00
	07/2018	TRY 4.564	992	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	\$ 183.912	BRL 695.486	0	(3.189)	(3.189)	(0,14)
	07/2018	5.191	COP 14.495.907	0	(259)	(259)	(0,01)
	07/2018	703	MYR 2.817	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	418	PLN 1.430	0	(36)	(36)	0,00
	07/2018	3.995	RUB 248.273	0	(38)	(38)	0,00
	08/2018	BRL 21.526	\$ 5.631	56	0	56	0,00
	08/2018	€ 25.629	30.940	923	0	923	0,04
	08/2018	HUF 547.575	1.975	28	0	28	0,00
	08/2018	RUB 522.878	8.274	10	(30)	(20)	0,00
	08/2018	\$ 188.092	BRL 723.157	0	(799)	(799)	(0,03)
	08/2018	84.443	CZK 1.792.691	0	(3.831)	(3.831)	(0,16)
	08/2018	243	EGP 4.502	5	0	5	0,00
	08/2018	1.024	HUF 266.975	0	(75)	(75)	0,00
	08/2018	687	MXN 13.702	4	0	4	0,00
	08/2018	4.322	NGN 1.590.500	47	0	47	0,00
	08/2018	9.544	RON 37.904	0	(75)	(75)	0,00
	08/2018	576	RUB 36.046	0	(5)	(5)	0,00
	08/2018	ZAR 71.233	\$ 5.184	30	(19)	11	0,00
	09/2018	EGP 80.951	4.371	0	(65)	(65)	0,00
	09/2018	IDR 268.850	19	0	0	0	0,00
	09/2018	MYR 25.547	6.379	71	0	71	0,00
	09/2018	\$ 2	MYR 7	0	0	0	0,00
	09/2018	278	THB 9.078	0	(3)	(3)	0,00
	09/2018	10.769	TWD 317.093	0	(314)	(314)	(0,01)
	10/2018	EGP 228.615	\$ 12.418	36	0	36	0,00
	10/2018	\$ 100	EGP 1.849	0	0	0	0,00
HUS	07/2018	ARS 159.548	\$ 7.524	2.081	0	2.081	0,09
	07/2018	CLP 459.248	720	15	0	15	0,00
	07/2018	RUB 131.130	2.051	0	(38)	(38)	0,00
	07/2018	TRY 64.308	13.458	0	(474)	(474)	(0,02)
	07/2018	\$ 5.105	ARS 141.983	0	(262)	(262)	(0,01)
	07/2018	3.580	COP 10.310.400	0	(72)	(72)	0,00
	07/2018	5.000	PEN 16.410	8	0	8	0,00
	07/2018	25.772	PLN 91.672	0	(1.286)	(1.286)	(0,05)
	08/2018	ARS 68.640	\$ 3.181	901	0	901	0,04
	08/2018	CZK 77.700	3.202	0	(293)	(293)	(0,01)
	08/2018	MXN 82.440	4.091	0	(68)	(68)	0,00
	08/2018	RON 35.307	8.883	63	0	63	0,00
	08/2018	\$ 1.030	EGP 18.973	14	0	14	0,00
	08/2018	310	MXN 6.220	4	0	4	0,00
	08/2018	47.946	RUB 2.996.683	0	(414)	(414)	(0,02)
	09/2018	CNH 1.110	\$ 174	7	0	7	0,00
	09/2018	CNY 60.819	9.494	352	0	352	0,01
	09/2018	IDR 353.920.271	24.646	205	0	205	0,01
	09/2018	TWD 996.626	33.560	698	0	698	0,03

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens	
	10/2018	€ 1.200	\$ 1.489	\$ 78	\$ 0	\$ 78	0,00	
IND	10/2018	NGN 798.575		2.125	0	(57)	0,00	
	10/2018	\$ 59	ARS 1.780		0	(3)	0,00	
	07/2018	1.684	MYR 6.688		0	(28)	0,00	
	07/2018	178	PLN 632		0	(9)	0,00	
	08/2018	8.974	MYR 35.678		0	(156)	(0,01)	
	08/2018	ZAR 216.855	\$ 17.098		1.349	0	0,06	
	09/2018	IDR 37.452.168	2.582		0	(4)	0,00	
	09/2018	THB 252.332	7.672		41	(3)	0,00	
	09/2018	\$ 7.760	MYR 31.049		0	(93)	0,00	
	09/2018	10.214	TWD 300.802		0	(296)	(0,01)	
JPM	07/2018	ARS 143.940	\$ 5.473		531	0	0,02	
	07/2018	BRL 35.190	9.316		169	0	0,01	
	07/2018	COP 4.011.071	1.438		73	0	0,00	
	07/2018	£ 25	33		0	0	0,00	
	07/2018	PEN 2.781	849		0	0	0,00	
	07/2018	PLN 12.489	3.313		0	(23)	0,00	
	07/2018	\$ 20.012	BRL 75.171		0	(476)	(0,02)	
	07/2018	2.452	CLP 1.553.170		0	(66)	0,00	
	07/2018	6.509	COP 17.926.663		0	(409)	(0,02)	
	07/2018	1.346	£ 1.011		0	(11)	0,00	
08/2018	AUD 507	\$ 383		9	0	0,00		
08/2018	CZK 465.021	21.939		1.028	0	1.028	0,04	
08/2018	NGN 932.100	2.405		0	(163)	(163)	(0,01)	
08/2018	RUB 77.074	1.217		0	(6)	(6)	0,00	
08/2018	\$ 62.196	CZK 1.318.586		0	(2.903)	(2.903)	(0,12)	
08/2018	243	EGP 4.498		5	0	5	0,00	
08/2018	447	MXN 9.030		8	0	8	0,00	
08/2018	15.703	ZAR 200.910		0	(1.111)	(1.111)	(0,05)	
08/2018	ZAR 620.952	\$ 48.657		3.560	0	3.560	0,15	
09/2018	ARS 148.422	5.501		718	0	718	0,03	
09/2018	IDR 18.653.250	1.275		0	(13)	(13)	0,00	
09/2018	NGN 1.730.000	4.453		0	(284)	(284)	(0,01)	
09/2018	\$ 11.485	EGP 211.786		71	0	71	0,00	
09/2018	9.210	KRW 9.911.802		0	(285)	(285)	(0,01)	
10/2018	EGP 101.214	\$ 5.384		0	(98)	(98)	0,00	
10/2018	NGN 3.953.773	10.499		0	(302)	(302)	(0,01)	
10/2018	\$ 1.272	EGP 23.431		0	(3)	(3)	0,00	
11/2018	NGN 4.546.648	\$ 12.076		0	(271)	(271)	(0,01)	
11/2018	\$ 8.753	NGN 3.286.752		166	0	166	0,01	
MSB	12/2018	NGN 1.318.914	\$ 3.492		0	(84)	(84)	0,00
	07/2018	ARS 106.589	3.777		141	0	141	0,01
	07/2018	IDR 123.466.512	8.814		198	0	198	0,01
	07/2018	\$ 180.788	BRL 664.360		0	(8.110)	(8.110)	(0,34)
	07/2018	42.806	PLN 145.469		0	(3.950)	(3.950)	(0,17)
	08/2018	EGP 18.686	\$ 1.025		0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	\$ 3.576	EGP 65.326		26	0	26	0,00
	09/2018	ARS 118.705	\$ 5.088		1.261	0	1.261	0,05
	09/2018	MYR 42.678	10.646		108	0	108	0,00
	09/2018	\$ 10.779	MYR 43.074		0	(140)	(140)	(0,01)
10/2018	NGN 281.438	\$ 750		0	(19)	(19)	0,00	
10/2018	\$ 10.094	MYR 40.351		0	(139)	(139)	(0,01)	
NGF	12/2018	NGN 1.770.581	\$ 4.697		0	(104)	(104)	0,00
	07/2018	ARS 49.711	1.748		52	0	52	0,00
	07/2018	PLN 9.396	2.632		122	0	122	0,01
RBC	07/2018	\$ 5.104	PLN 17.793		0	(351)	(351)	(0,02)
	08/2018	TRY 43.774	\$ 9.533		172	0	172	0,01
	07/2018	PLN 16.240	4.538		201	0	201	0,01
RYL	08/2018	CZK 179.230	8.382		322	0	322	0,01
	08/2018	RUB 310.143	4.897		0	(22)	(22)	0,00
	08/2018	\$ 2.778	CZK 58.233		0	(159)	(159)	(0,01)
SCX	08/2018	6.107	ZAR 76.557		0	(547)	(547)	(0,02)
	07/2018	€ 700	\$ 852		34	0	34	0,00
	07/2018	NGN 769.922	1.998		0	(129)	(129)	(0,01)
07/2018	TRY 80.505	19.371		1.880	0	1.880	0,08	
07/2018	\$ 2.114	NGN 769.922		14	0	14	0,00	
08/2018	NGN 1.590.500	\$ 4.109		0	(260)	(260)	(0,01)	
08/2018	\$ 243	EGP 4.503		5	0	5	0,00	
08/2018	7.099	€ 5.994		0	(78)	(78)	0,00	
08/2018	11.587	ZAR 146.612		0	(940)	(940)	(0,04)	
09/2018	IDR 235.745.723	\$ 16.540		260	0	260	0,01	
09/2018	KRW 9.918.135	9.227		297	0	297	0,01	
09/2018	\$ 102	THB 3.274		0	(3)	(3)	0,00	
10/2018	NGN 1.227.735	\$ 3.263		0	(88)	(88)	0,00	
11/2018	2.090.109	5.569		0	(115)	(115)	(0,01)	
07/2018	COP 7.034.061	2.406		13	0	13	0,00	
07/2018	TRY 80.505	19.374		1.882	0	1.882	0,08	
07/2018	\$ 11.773	COP 33.731.633		0	(295)	(295)	(0,01)	
08/2018	9.066	RON 36.129		0	(40)	(40)	0,00	
09/2018	IDR 38.010.588	\$ 2.654		29	0	29	0,00	
07/2018	\$ 23.613	£ 17.858		0	(36)	(36)	0,00	
07/2018	8.744	IDR 123.466.512		0	(128)	(128)	(0,01)	
08/2018	CZK 35.022	\$ 1.578		3	0	3	0,00	

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	08/2018	£ 17.858	\$ 23.646	\$ 37	\$ 0	\$ 37	0,00
	09/2018	IDR 123.466.512	8.614	88	0	88	0,00
	09/2018	MYR 30.112	7.515	80	0	80	0,00
	09/2018	PHP 1.673.942	31.518	367	0	367	0,02
	09/2018	\$ 352	MYR 1.407	0	(4)	(4)	0,00
	09/2018	69.890	THB 2.221.286	0	(2.691)	(2.691)	(0,11)
				\$ 45.422	\$ (61.322)	\$ (15.900)	(0,68)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (11.619)	(0,49)
Summe Anlagen						\$ 2.463.667	104,56
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (107.477)	(4,56)
Nettovermogen						\$ 2.356.190	100,00

## ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (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) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Beschrankt ubertragbare Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Falligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
JPMorgan Structured Products BV	0,000 %	30.08.2018	27.02.2018 - 28.02.2018	\$ 20.775	\$ 20.394	0,87
JPMorgan Structured Products BV	15,575	19.07.2018	23.01.2018	12.839	12.715	0,54
JPMorgan Structured Products BV	16,623	30.08.2018	30.01.2018	13.684	13.451	0,57
JPMorgan Structured Products BV	16,720	16.08.2018	13.02.2018	10.580	10.436	0,44
Malaysia Government International Bond	4,837	15.07.2025	25.07.2014	133	103	0,00
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.	4,150	06.03.2019	16.01.2018	14.867	14.801	0,63
				\$ 72.878	\$ 71.900	3,05

Barmittel in Hoh€ von USD 27.546 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfand€t.

Gemaß den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Hoh€ von USD 29.250 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfand€t.

(g) Pensionsgeschafte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Falligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschafte, zum Wert	Zu erhaltende Erlose aus Pensionsgeschaft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermogens
MBC	2,260 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 93.000	U.S. Treasury Notes 2,875 % fallig am 30.04.2025	\$ (95.964)	\$ 93.000	\$ 93.000	3,95
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	3.912	U.S. Treasury Notes 3,375 % fallig am 15.11.2019	(3.994)	3.912	3.912	0,16
Summe Pensionsgeschafte						\$ (99.958)	\$ 96.912	\$ 96.912	4,11

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

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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
ubertragbare Wertpapiere	\$ 239.336	\$ 2.212.029	\$ 23.624	\$ 2.474.989
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	263	(11.585)	0	(11.322)
Summen	\$ 239.599	\$ 2.200.444	\$ 23.624	\$ 2.463.667

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 71.383	\$ 2.834.517	\$ 8.274	\$ 2.914.174
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	434	9.678	0	10.112
<b>Summen</b>	<b>\$ 71.817</b>	<b>\$ 2.844.195</b>	<b>\$ 8.274</b>	<b>\$ 2.924.286</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 106	\$ 0	\$ 106
BOA	4.777	(3.990)	787
BPS	(3.255)	3.720	465
BRC	1.797	(1.260)	537
CBK	(3.867)	7.520	3.653
DUB	17	(2.640)	(2.623)
FBF	220	(330)	(110)
GLM	(3.930)	4.160	230
GST	86	0	86
HUS	2.679	(1.840)	839
IND	801	(730)	71
JPM	(212)	670	458
MSB	(10.731)	10.910	179
MYC	(79)	66	(13)
NGF	52	0	52
RBC	(57)	0	(57)
RYL	(205)	(160)	(365)
SCX	877	(1.010)	(133)
SOG	1.589	(1.740)	(151)
UAG	(2.284)	1.900	(384)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	65,71	67,99
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	17,01	26,47
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	22,32	2,40
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	0,44
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,49)	(0,12)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Local Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	91.306.263	\$ 914.115
	<b>PARI (000S)</b>	
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR 801.900	60.810
Nomura International Funding Pte Ltd. 6,625 % fällig am 18.05.2033	IDR 623.000.000	46.987
Turkey Government International Bond 12,200 % fällig am 18.01.2023	TRY 172.100	46.521
Letras del Banco Central de la Republica Argentina 1,000 % fällig am 16.05.2018	ARS 956.328	45.664
Letras del Banco Central de Argentina 0,000 % fällig am 18.04.2018	857.940	41.543
Letras del Banco Central de la Republica Argentina 1,000 % fällig am 21.06.2018	783.060	35.852
Lebac Interna 1,000 % fällig am 21.03.2018	663.700	33.491
Turkey Government International Bond 11,000 % fällig am 24.02.2027	TRY 135.200	33.390
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL 9,850 % fällig am 16.07.2032	BRL 108.600	31.978
Deutsche Bank AG 6,680 % fällig am 23.01.2025	IDR 416.100.000	30.990
BNP Paribas S.A. 6,240 % fällig am 06.02.2025	396.200.000	28.924
Argentina Government International Bond 0,000 % fällig am 15.08.2018	ARS 605.070	27.918
South Africa Government International Bond 8,250 % fällig am 31.03.2032	ZAR 351.000	27.547
Nigeria Treasury Bills 13,750 % fällig am 06.12.2018	NGN 9.803.600	24.741
Poland Government International Bond 4,000 % fällig am 25.10.2023	PLN 76.400	24.127
Deutsche Bank AG/London 6,680 % fällig am 23.01.2025	IDR 273.300.000	20.093
JP Morgan Structured Products BV 0,000 % fällig am 30.08.2018	EGO 376.000	19.730
Corp. Andina de Fomento 6,770 % fällig am 24.05.2028	COP 54.500.000	18.598
Turkey Government International Bond 11,000 % fällig am 02.03.2022	TRY 69.200	17.846

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	74.553.116	\$ 746.400
	<b>PARI (000S)</b>	
Poland Government International Bond 2,250 % fällig am 25.04.2022	PLN 168.200	47.145
Letras del Banco Central de Argentina 0,000 % fällig am 18.04.2018	ARS 947.440	46.675
Letras del Banco Central de la Republica Argentina 1,000 % fällig am 16.05.2018	987.450	45.023
Colombian TES 7,000 % fällig am 04.05.2022	COP 110.943.800	40.785
Colombian TES 7,500 % fällig am 26.08.2026	110.770.200	40.631
Poland Government International Bond 5,750 % fällig am 23.09.2022	PLN 115.400	36.746
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR 445.100	33.136
Colombian TES 10,000 % fällig am 24.07.2024	COP 76.187.700	32.570
Lebac Interna 1,000 % fällig am 21.03.2018	ARS 663.700	32.561
Turkey Government International Bond 11,000 % fällig am 02.03.2022	TRY 120.700	31.522
Letras del Banco Central de la Republica Argentina 1,000 % fällig am 21.06.2018	ARS 783.060	31.097
South Africa Government International Bond 8,250 % fällig am 31.03.2032	ZAR 407.400	30.341
Turkey Government International Bond 10,700 % fällig am 17.02.2021	TRY 125.000	29.009
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN 73.100	28.389
Turkey Government International Bond 12,200 % fällig am 18.01.2023	TRY 127.900	28.356
Turkey Government International Bond 9,400 % fällig am 08.07.2020	105.000	24.904
Deutsche Bank AG 8,750 % fällig am 19.05.2031	IDR 255.300.000	21.073
Malaysia Government International Bond 3,580 % fällig am 28.09.2018	MYR 81.118	20.414
Colombian TES 5,000 % fällig am 21.11.2018	COP 57.954.800	20.274

(a) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets 2018 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 UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGLTER MARKT</b>				<b>KASACHSTAN</b>				<b>SRI LANKA</b>			
<b>BRASILIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Daycoval S.A.				KazMunayGas National Co. JSC				National Savings Bank			
5,750 % fällig am 19.03.2019	\$ 1.350	\$ 1.361	2,05	9,125 % fällig am 02.07.2018	\$ 4.650	\$ 4.650	7,02	8,875 % fällig am 18.09.2018	\$ 1.200	\$ 1.205	1,82
Caixa Economica Federal	4.080	4.090	6,17	<b>KENIA</b>				<b>TÜRKEI</b>			
4,900 % fällig am 03.10.2018				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Summe Brasilien		5.451	8,22	Kenya Government International Bond	3.100	3.116	4,70	Coca-Cola Icecek A/S	900	902	1,36
<b>CAYMAN INSELN</b>				<b>LUXEMBURG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Alpha Star Holding Ltd.				Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.	2.600	3.069	4,63	4,750 % fällig am 01.10.2018	2.200	2.187	3,30
4,970 % fällig am 09.04.2019	2.800	2.806	4,23	4,625 % fällig am 15.10.2018				Türkiye Garanti Bankasi A/S	3.800	3.785	5,71
<b>CHILE</b>				<b>MEXIKO</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>PENSIONSGESCHÄFTE (e)</b>			
Celulosa Arauco y Constitución S.A.	600	625	0,94	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.	2.140	2.173	3,28	5,000 % fällig am 31.10.2018	2.000	1.992	3,00
7,250 % fällig am 29.07.2019				5,180 % fällig am 28.06.2019	\$ 2.140	2.173	3,28	Yapi ve Kredi Bankasi A/S	900	899	1,36
<b>HONGKONG</b>				<b>PERU</b>				<b>AKTIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
China Overseas Finance Cayman Ltd.	700	701	1,06	Petroles Mexicanos	600	600	0,91	Federal Home Loan Bank			
3,375 % fällig am 29.10.2018				3,500 % fällig am 18.07.2018	600	600	0,91	1,872 % fällig am 27.07.2018	500	499	0,76
Franshion Brilliant Ltd.	830	842	1,27	<b>NIGERIA</b>				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
5,750 % fällig am 19.03.2019				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Summe Hongkong		1.543	2,33	Nigeria Government International Bond	5.830	5.824	8,79	1,921 % fällig am 31.08.2018	500	499	0,75
<b>INDIEN</b>				<b>PANAMA</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
ONGC Videsh Ltd.				Global Bank Corp.	700	707	1,07	(a)(b)			
3,250 % fällig am 15.07.2019	700	699	1,05	5,125 % fällig am 30.10.2019	700	707	1,07	(a)(b)		998	1,51
Export-Import Bank of India				<b>PERU</b>				<b>Summe kurzfristige Instrumente</b>			
3,875 % fällig am 02.10.2019	1.300	1.309	1,98	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Gereglter Markt</b>			
Summe Indien		2.008	3,03	Corp. Financiera de Desarrollo S.A.	900	899	1,35			6.005	9,06
<b>IRLAND</b>				<b>Summe Peru</b>				<b>Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Gereglter Markt</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.	4.550	4.576	6,91								
8,700 % fällig am 07.08.2018											

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (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>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festsinnsatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Mexico Government International Bond	1,000 %	20.09.2018	\$ 200	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.09.2018	600	(14)	14	0	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.09.2018	200	(7)	6	(1)	0,00
BPS	Indonesia Government International Bond	1,000	20.09.2018	300	(4)	5	1	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.09.2018	200	1	(1)	0	0,00
BRC	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.09.2018	400	1	0	1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.09.2018	400	(12)	12	0	0,00
CBK	Turkey Government International Bond	1,000	20.09.2018	200	(3)	3	0	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.06.2019	300	4	(1)	3	0,01
GST	Mexico Government International Bond	1,000	20.09.2018	100	0	0	0	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.09.2018	700	(18)	19	1	0,00
HUS	South Africa Government International Bond	1,000	20.09.2018	900	(48)	49	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.09.2018	650	(3)	4	1	0,00
JPM	Qatar Government International Bond	1,000	20.06.2019	800	5	0	5	0,01
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.09.2018	450	0	1	1	0,00
NGF	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2018	200	(3)	3	0	0,00
					\$ (101)	\$ 114	\$ 13	0,02

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherheitennehmer 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 Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**DEVISENTERMINKONTRÄKTE**

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08/2018	€ 30	\$ 35	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	08/2018	\$ 63	€ 54	0	0	0	0,00
CBK	08/2018	€ 4.896	\$ 5.691	0	(43)	(43)	(0,07)
HUS	07/2018	\$ 23	€ 20	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (43)	\$ (43)	(0,07)

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE**

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class G Retail EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 13.229	€ 11.270	\$ 0	\$ (71)	\$ (71)	(0,11)
BPS	07/2018	\$ 13.093	€ 11.289	87	0	87	0,13
BRC	07/2018	€ 31	\$ 36	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	57	68	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 13.350	€ 11.568	157	0	157	0,24
GLM	07/2018	€ 375	\$ 438	0	0	0	0,00
JPM	07/2018	\$ 13.613	€ 11.541	0	(139)	(139)	(0,21)
MSB	07/2018	€ 18.543	\$ 21.417	0	(233)	(233)	(0,35)
	08/2018	\$ 21.464	€ 18.543	233	0	233	0,35
RYL	07/2018	€ 646	\$ 760	5	0	5	0,01
SCX	07/2018	138	161	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	18.557	21.602	0	(64)	(64)	(0,10)
	07/2018	\$ 13.112	€ 11.268	44	0	44	0,07
	08/2018	21.650	18.557	63	0	63	0,10
				\$ 590	\$ (507)	\$ 83	0,13

Zum 30. Juni 2018 standen für die Class R GBP (Hedged) 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	07/2018	\$ 311	£ 233	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	(0,01)
BRC	07/2018	£ 233	\$ 304	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	\$ 305	£ 233	3	0	3	0,00
CBK	07/2018	308	233	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2018	309	233	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07/2018	£ 233	\$ 308	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 308	£ 233	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 3	\$ (10)	\$ (7)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 46 0,07

Summe Anlagen

\$ 62.586 94,43

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 3.690 5,57

Nettovermögens

\$ 66.276 100,00

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):**

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

(a) Nullkuponwertpapier.

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

(c) Mit dem Fonds verbunden.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 270 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(e) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 507	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	\$ (520)	\$ 507	\$ 507	0,76
TDM	2,220	29.06.2018	02.07.2018	4.500	U.S. Treasury Bonds 3,750 % fällig am 15.11.2043	(4.596)	4.500	4.500	6,79
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (5.116)	\$ 5.007	\$ 5.007	7,55

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets 2018 Fund (Forts.)

## Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 6.618	\$ 55.922	\$ 0	\$ 62.540
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	46	0	46
<b>Summen</b>	<b>\$ 6.618</b>	<b>\$ 55.968</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 62.586</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 7.519	\$ 64.559	\$ 0	\$ 72.078
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	343	0	343
<b>Summen</b>	<b>\$ 7.519</b>	<b>\$ 64.902</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 72.421</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (75)	\$ 0	\$ (75)
BPS	88	0	88
BRC	1	(10)	(9)
CBK	117	0	117
GST	1	0	1
HUS	1	0	1
JPM	(132)	270	138
RYL	5	0	5
SCX	(2)	0	(2)
SSB	43	0	43
UAG	(1)	0	(1)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	75,32	90,65
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	1,51	4,63
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	17,53	3,13
Freiverkehrsfinanzderivate	0,07	0,47
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	0,00	0,75

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets 2018 Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>		
<b>Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.</b> 4,625 % fällig am 15.10.2018	€ 4.700	\$ 5.521
<b>Nigeria Government International Bond</b> 5,125 % fällig am 12.07.2018	\$ 2.800	2.816
<b>Türkiye Is Bankasi</b> 3,750 % fällig am 10.10.2018	2.300	2.304
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 25.05.2018	1.800	1.800
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 31.05.2018	1.800	1.800
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 29.05.2018	1.800	1.800
<b>AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.</b> 8,700 % fällig am 07.08.2018	1.700	1.726
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 16.02.2018	1.600	1.600
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 18.05.2018	1.600	1.593
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 06.01.2018	1.500	1.500
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 05.04.2018	1.400	1.396
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 02.05.2018	1.200	1.200
<b>KazMunayGas National Co. JSC</b> 9,125 % fällig am 02.07.2018	1.100	1.128
<b>AK Finansal Kiralama A/S</b> 0,000 % fällig am 17.04.2018	1.100	1.103
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 06.07.2018	1.100	1.098
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 15.06.2018	800	799
<b>Israel Electric Corp. Ltd.</b> 0,000 % fällig am 21.06.2018	700	706
<b>Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.</b> 0,000 % fällig am 04.11.2018	600	605
<b>Caixa Economica Federal</b> 4,500 % fällig am 03.10.2018	600	604
<b>Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social</b> 0,000 % fällig am 16.06.2018	600	603
<b>Petroleos Mexicanos</b> 3,500 % fällig am 18.07.2018	600	603
<b>Federal Home Loan Bank</b> 1,872 % fällig am 27.07.2018	500	499
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 04.06.2018	500	498
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 04.11.2018	500	498
<b>Federal Home Loan Bank</b> 1,921 % fällig am 31.08.2018	500	498

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
<b>Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.</b> 4,625 % fällig am 15.10.2018	€ 2.100	\$ 2.456
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 05.04.2018	\$ 1.400	1.399
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 16.02.2018	1.300	1.300
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 02.09.2018	1.200	1.199
<b>AKTIEN</b>		
<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	115.402	1.155
<b>PARI (000S)</b>		
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 01.09.2018	\$ 500	500
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 04.11.2018	500	500
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 18.05.2018	500	500
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 04.06.2018	500	499
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 31.01.2018	300	300
<b>Federal Home Loan Bank</b> 0,000 % fällig am 02.07.2018	300	300

(a) Der Emerging Markets 2018 Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund

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>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGLTER MARKT</b>				<b>Petrobras Global Finance BV</b>				<b>CNAC HK Finbridge Co. Ltd.</b>			
				6,125 % fällig am 17.01.2022	\$ 3.902	\$ 3.978	0,15	3.500 % fällig am 19.07.2022	\$ 4.700	\$ 4.541	0,17
				6,250 % fällig am 17.03.2024	2.000	1.991	0,08	<b>Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.</b>			
				6,850 % fällig am 05.06.2115	8.900	7.512	0,28	3,125 % fällig am 27.07.2021	2.400	2.338	0,09
				6,875 % fällig am 20.01.2040	2.350	2.134	0,08	4,200 % fällig am 27.07.2026	800	766	0,03
				7,250 % fällig am 17.03.2044	3.000	2.786	0,11	<b>Rongshi International Finance Ltd.</b>			
				7,375 % fällig am 17.01.2027	5.800	5.807	0,22	2,875 % fällig am 04.05.2022	4.500	4.349	0,16
				8,750 % fällig am 23.05.2026	3.200	3.470	0,13	3,625 % fällig am 04.05.2027	2.400	2.278	0,08
				<b>Samarco Mineracao S.A.</b>				<b>Sinopec Group Overseas Development Ltd.</b>			
				5,750 % fällig am 24.10.2023 ^	1.300	956	0,04	2,500 % fällig am 13.09.2022	500	476	0,02
						105.494	3,99	3,250 % fällig am 13.09.2027 (j)	12.500	11.585	0,44
								4,375 % fällig am 17.10.2023	8.200	8.410	0,32
								4,375 % fällig am 10.04.2024	2.800	2.860	0,11
								4,875 % fällig am 17.05.2042	5.200	5.451	0,20
								<b>State Grid Overseas Investment Ltd.</b>			
								4,125 % fällig am 07.05.2024	200	203	0,01
								<b>Three Gorges Finance Cayman Islands Ltd.</b>			
								3,150 % fällig am 02.06.2026	4.000	3.739	0,14
										47.195	1,78
								<b>STAAITSEMISSIONEN</b>			
								<b>Export-Import Bank of China</b>			
								3,625 % fällig am 31.07.2024	200	198	0,01
								4,000 % fällig am 28.11.2047	7.100	6.654	0,25
										6.852	0,26
								Summe China		54.047	2,04
								<b>KOLUMBIEN</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								<b>Ecopetrol S.A.</b>			
								5,875 % fällig am 28.05.2045	15.100	14.378	0,54
								7,375 % fällig am 18.09.2043	4.300	4.753	0,18
										19.131	0,72
								<b>STAAITSEMISSIONEN</b>			
								<b>Colombia Government International Bond</b>			
								2,625 % fällig am 15.03.2023	1.100	1.046	0,04
								3,875 % fällig am 15.02.2027	8.000	7.746	0,30
								5,000 % fällig am 15.06.2045	500	493	0,02
								5,625 % fällig am 26.02.2044	4.500	4.792	0,18
								6,125 % fällig am 18.01.2041	6.195	6.954	0,26
								7,375 % fällig am 18.09.2037	6.095	7.619	0,29
								8,125 % fällig am 21.05.2024	500	602	0,02
										29.252	1,11
								Summe Kolumbien		48.383	1,83
								<b>COSTA RICA</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								<b>Instituto Costarricense de Electricidad</b>			
								6,375 % fällig am 15.05.2043	2.200	1.837	0,07
								<b>STAAITSEMISSIONEN</b>			
								<b>Costa Rica Government International Bond</b>			
								5,625 % fällig am 30.04.2043	12.100	10.273	0,39
								7,000 % fällig am 04.04.2044	2.800	2.744	0,10
										13.017	0,49
								Summe Costa Rica		14.854	0,56
								<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>			
								<b>STAAITSEMISSIONEN</b>			
								<b>Dominican Republic International Bond</b>			
								5,500 % fällig am 27.01.2025	12.800	12.734	0,48
								5,950 % fällig am 25.01.2027	16.700	16.554	0,63
								6,500 % fällig am 15.02.2048	6.350	6.036	0,23
								6,850 % fällig am 27.01.2045	4.400	4.371	0,16
								6,875 % fällig am 29.01.2026	5.000	5.309	0,20
								Summe Dominikanische Republik		45.004	1,70
								<b>ECUADOR</b>			
								<b>STAAITSEMISSIONEN</b>			
								<b>Ecuador Government International Bond</b>			
								7,875 % fällig am 23.01.2028	16.400	13.800	0,52
								7,950 % fällig am 20.06.2024	2.750	2.438	0,09
								8,750 % fällig am 02.06.2023	7.700	7.241	0,28
								9,625 % fällig am 02.06.2027	860	802	0,03



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets 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		
<b>MALAYSIA</b>				<b>NAMIBIA</b>				<b>PETROLEOS DEL PERU S.A.</b>					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Staatsanleihen</b>					
Petronas Capital Ltd.				Namibia Government International Bond				4,750 % fällig am 19.06.2032	\$ 1.800	\$ 1.727	0,07		
4,500 % fällig am 18.03.2045	\$ 1.800	\$ 1.809	0,07	5,250 % fällig am 29.10.2025	\$ 1.800	\$ 1.667	0,06	5,625 % fällig am 19.06.2047	3.000	2.925	0,11		
5,250 % fällig am 12.08.2019	9.700	9.935	0,37					Union Andina de Cementos S.A.A.					
Summe Malaysia		11.744	0,44	<b>NIEDERLANDE</b>				5,875 % fällig am 30.10.2021	2.350	2.415	0,09		
				Penta CLO BV	€ 250	292	0,01					8.758	0,33
				0,790 % fällig am 04.08.2028				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
<b>MARSHALLINSELN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Fondo MIVIVIENDA S.A.</b>					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>CIMPOR Financial Operations BV</b>				3,500 % fällig am 31.01.2023					
Nakilat, Inc.				5,750 % fällig am 17.07.2024	\$ 9.450	7.608	0,29	Peru Government International Bond					
6,267 % fällig am 31.12.2033	82	90	0,00	Kazakhstan Temir Zholy Finance BV				5,625 % fällig am 18.11.2050	1.300	1.513	0,06		
				6,950 % fällig am 10.07.2042	5.960	6.470	0,24	6,550 % fällig am 14.03.2037	1.043	1.306	0,05		
<b>MEXIKO</b>				<b>MEXIKO</b>				8,750 % fällig am 21.11.2033					
				Metinvest BV				Summe Peru				25.892	0,98
<b>STAMMAKTIEEN</b>				<b>AKTIEN</b>				<b>PHILIPPINEN</b>					
Hipotecaria Su Casita S.A.	39.443	0	0,00	7,750 % fällig am 23.04.2023	9.000	8.465	0,32	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (b)	52.446	13	0,00	Syngenta Finance NV	400	398	0,02	<b>Power Sector Assets &amp; Liabilities Management Corp.</b>					
		13	0,00	4,441 % fällig am 24.04.2023				7,390 % fällig am 02.12.2024	4.300	5.085	0,19		
				Summe Niederlande		22.941	0,87	<b>POLEN</b>					
						23.233	0,88	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
								<b>Poland Government International Bond</b>					
								3,250 % fällig am 06.04.2026	19.400	18.761	0,71		
								<b>KATAR</b>					
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
								<b>Qatar Government International Bond</b>					
								5,103 % fällig am 23.04.2048	9.100	9.093	0,34		
								<b>RUMÄNIEN</b>					
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
								<b>Romania Government International Bond</b>					
								2,875 % fällig am 26.05.2028	€ 300	358	0,01		
								3,875 % fällig am 29.10.2035	300	358	0,02		
								Summe Rumänien		716	0,03		
								<b>RUSSLAND</b>					
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
								<b>VEON Holdings BV</b>					
								5,200 % fällig am 13.02.2019	\$ 400	403	0,02		
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
								<b>Russia Government International Bond</b>					
								5,625 % fällig am 04.04.2042	9.400	9.852	0,37		
								Summe Russland		10.255	0,39		
								<b>SAUDI-ARABIEN</b>					
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
								<b>Saudi Government International Bond</b>					
								2,875 % fällig am 04.03.2023	7.200	6.936	0,26		
								3,250 % fällig am 26.10.2026	3.200	3.005	0,12		
								4,500 % fällig am 17.04.2030	12.200	12.209	0,46		
								Summe Saudi-Arabien		22.150	0,84		
								<b>SENEGAL</b>					
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
								<b>Senegal Government International Bond</b>					
								4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 2.600	2.838	0,11		
								6,250 % fällig am 30.07.2024	\$ 300	295	0,01		
								6,250 % fällig am 23.05.2033	8.600	7.647	0,29		
								6,750 % fällig am 13.03.2048	800	687	0,03		
								8,750 % fällig am 13.05.2021	4.500	4.859	0,18		
								Summe Senegal		16.326	0,62		
								<b>SERBIEN</b>					
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
								<b>Serbia Government International Bond</b>					
								4,875 % fällig am 25.02.2020	22.941	23.331	0,88		
								5,875 % fällig am 03.12.2018	2.100	2.123	0,08		
								Summe Serbien		25.454	0,96		
								<b>MONGOLEI</b>					
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
								<b>Mongolia Government International Bond</b>					
								5,125 % fällig am 05.12.2022	6.365	5.976	0,23		
								5,625 % fällig am 01.05.2023	7.100	6.738	0,25		
								Summe Mongolei		12.714	0,48		
								<b>PERU</b>					
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
								<b>Peru LNG SRL</b>					
								5,375 % fällig am 22.03.2030	1.700	1.691	0,06		



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets 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
Bear Stearns ALT-A Trust				3,954 % fällig am 01.01.2036	\$ 27	\$ 29	0,00	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
3,781 % fällig am 25.05.2035	\$ 174	\$ 177	0,01	5,500 % fällig am 01.02.2038	3	3	0,00	Argentine Republic Government International Bond	\$ 2.900	\$ 2.219	0,08
Citigroup Mortgage Loan Trust	507	491	0,02					JPMorgan Structured Products BV			
3,712 % fällig am 25.09.2037 ^						86	0,00	16,623 % fällig am			
CitiMortgage Alternative Loan Trust	2.660	2.210	0,08	Summe USA		88.216	3,34	30.08.2018 (c)(d)(i)	EGP 68.100	3.694	0,14
2,421 % fällig am 25.10.2036										5.913	0,22
Countrywide Alternative Loan Trust	1.655	966	0,04	<b>URUGUAY</b>				<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
2,441 % fällig am 25.05.2036 ^				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				0,907 % fällig am			
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust	172	162	0,01	Uruguay Government International Bond				13.07.2018 (c)(d)	\$ 710	709	0,03
3,345 % fällig am 20.05.2036 ^				4,375 % fällig am 27.10.2027	925	939	0,04	0,989 % fällig am			
Deutsche ALT-A Securities, Inc.	1.775	1.471	0,06	4,975 % fällig am 20.04.2055	4.500	4.376	0,16	10.08.2018 (c)(d)	2.380	2.370	0,09
2,421 % fällig am 25.08.2037 ^				5,000 % fällig am 14.09.2018 (e)	15.927	513	0,02	1,177 % fällig am			
GSMP Mortgage Loan Trust	253	227	0,01	5,100 % fällig am 18.06.2050	14.100	13.913	0,53	24.08.2018 (c)(d)	2.200	2.188	0,08
2,441 % fällig am 25.01.2036				6,875 % fällig am 28.09.2025	2.879	3.282	0,12	1,855 % fällig am			
GSR Mortgage Loan Trust	83	82	0,00	7,875 % fällig am 15.01.2033	11.350	14.850	0,56	14.09.2018 (c)(d)	1.380	1.369	0,05
3,729 % fällig am 25.01.2036 ^				9,875 % fällig am 20.06.2022	UYU 43.315	1.372	0,05	2,171 % fällig am			
HarborView Mortgage Loan Trust	186	151	0,01	Summe Uruguay		39.245	1,48	27.07.2018 (c)(d)	220	219	0,01
3,558 % fällig am 19.10.2035								3,154 % fällig am			
Impac CMB Trust	242	236	0,01	<b>VENEZUELA</b>				26.10.2018 (c)(d)	700	691	0,03
2,731 % fällig am 25.03.2035				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						7.546	0,29
IndyMac Mortgage Loan Trust	694	667	0,03	Petroleos de Venezuela S.A.				<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>			
2,271 % fällig am 25.02.2037 ^	2.037	1.887	0,07	5,375 % fällig am 12.04.2027 ^	71.440	16.788	0,63	11,289 % fällig am			
2,271 % fällig am 25.02.2037	703	681	0,03	5,500 % fällig am 12.04.2027 ^	19.365	4.454	0,17	11.09.2018 (c)(d)	EGP 8.500	459	0,02
2,731 % fällig am 25.07.2045								23.10.2018 (c)(d)	16.000	848	0,03
JPMorgan Resecuritization Trust	991	915	0,03	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe kurzfristige Instrumente		20.940	0,79
2,500 % fällig am 25.03.2036				Venezuela Government International Bond							
Residential Accredit Loans, Inc. Trust	871	800	0,03	6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	10.900	2.916	0,11				
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^				7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	24.650	6.747	0,26				
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust	4	53	0,00	7,650 % fällig am 21.04.2025 ^	21.954	6.009	0,23	<b>GREECE TREASURY BILLS</b>			
3,638 % fällig am 25.09.2034	51			7,750 % fällig am 13.10.2019 ^	20.130	5.570	0,21	1,082 % fällig am			
3,899 % fällig am 25.09.2037				8,250 % fällig am 13.10.2024 ^	12.483	3.454	0,13	05.10.2018 (c)(d)	€ 4.800	5.592	0,21
Structured Asset Mortgage Investments Trust	2.084	1.960	0,07	9,000 % fällig am 07.05.2023 ^	9.878	2.716	0,10	Summe kurzfristige Instrumente		20.940	0,79
2,391 % fällig am 25.02.2037				9,250 % fällig am 15.09.2027 ^	13.410	3.845	0,15				
Suntrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust	2.119	2.007	0,08	9,250 % fällig am 07.05.2028 ^	11.868	3.272	0,12				
3,721 % fällig am 25.10.2037 ^								<b>AKTIEN</b>			
TBW Mortgage-Backed Trust	1.771	842	0,03	Summe Venezuela		55.771	2,11	<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
6,040 % fällig am 25.01.2037 ^								PIMCO Funds Ireland			
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	271	249	0,01	<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>				p.l.c. - PIMCO US			
2,461 % fällig am 25.05.2034	136	131	0,00	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Dollar Short-Term			
2,628 % fällig am 25.01.2046	358	346	0,01	Rosneft Finance S.A.				Floating NAV Fund (g)	23.304.888	233.352	8,83
3,475 % fällig am 25.02.2037 ^				7,250 % fällig am 02.02.2020	1.900	2.000	0,08	Summe Übertragbare Wertpapiere			
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust	42	38	0,00					und Geldmarktinstrumente –			
2,591 % fällig am 25.07.2037 ^	1.397	0,05						Amtl. Börse/Geregelter Markt	\$ 2.590.517	97,97	
3,604 % fällig am 25.10.2036											
	24.998	0,95		<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				PENSIONSGESCHÄFTE (k)		582	0,02				
Fannie Mae											
3,368 % fällig am 01.12.2035	31	32	0,00								
3,909 % fällig am 01.03.2036	21	22	0,00								

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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	701	\$ 131	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	713	(95)	0,00
				\$ 36	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 36	0,00

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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 15.100	\$ (58)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,730 %	04.01.2021	BRL 65.300	\$ (64)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,970	02.01.2020	292.000	644	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,450	04.01.2027	38.800	105	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.06.2027	\$ 55.700	(1.849)	(0,07)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	149.170	(5.104)	(0,19)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	1.200	76	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	15.06.2046	600	40	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	31.830	2.450	0,09
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	€ 13.600	(198)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	10.800	(253)	(0,01)
					\$ (4.153)	(0,16)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (4.211)</b>	<b>(0,16)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (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>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
BPS	Turkey Government International Bond	(1,000) %	20.12.2022	\$ 34.900	\$ 1.444	\$ 1.078	\$ 2.522	0,10
GST	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2022	11.700	492	354	846	0,03
					\$ 1.936	\$ 1.432	\$ 3.368	0,13

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.03.2019	\$ 11.700	\$ (536)	\$ 531	\$ (5)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2020	1.100	(67)	55	(12)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.09.2021	400	(17)	5	(12)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2019	4.100	45	(12)	33	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2018	3.500	(28)	40	12	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	3.600	(21)	42	21	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.09.2020	7.100	(385)	445	60	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.09.2020	6.800	(422)	477	55	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.03.2019	7.500	(42)	90	48	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.03.2019	9.000	(136)	189	53	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.09.2020	4.700	(198)	260	62	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.03.2019	800	(67)	69	2	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2022	500	(22)	7	(15)	0,00
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2019	800	(30)	29	(1)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2022	1.700	(29)	31	2	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.09.2020	12.000	(462)	558	96	0,01
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2021	19.900	(614)	636	22	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	3.200	(44)	2	(42)	0,00
BRC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2019	800	(32)	31	(1)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2019	3.200	35	(9)	26	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	8.000	(18)	65	47	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.09.2020	1.500	(85)	98	13	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2024	7.800	(1.076)	861	(215)	(0,01)
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2019	3.200	12	15	27	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	3.400	(220)	(142)	(362)	(0,01)
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2018	19.500	123	(52)	71	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.700	(335)	229	(106)	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	16.000	92	3	95	0,01
	Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.	1,000	20.03.2019	5.800	(286)	294	8	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2024	3.800	(519)	413	(106)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	400	(4)	(2)	(6)	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2019	7.500	48	15	63	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.03.2019	200	(17)	17	0	0,00
	Uruguay Government International Bond	1,000	20.06.2020	17.000	(163)	31	(132)	(0,01)
DUB	Brazil Government International Bond	1,000	20.03.2019	900	(41)	41	0	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.09.2020	3.600	(200)	230	30	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
	Mexico Government International Bond	1,000 %	20.12.2022	\$ 700	\$ (4)	\$ (2)	\$ (6)	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.03.2019	800	(5)	10	5	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2019	200	1	1	2	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	7.200	(55)	176	121	0,01
	Penerbangan Malaysia Bhd.	1,000	20.03.2020	4.100	(35)	77	42	0,00
FBF	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2018	400	(19)	19	0	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.09.2020	1.300	(70)	81	11	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2021	4.100	(263)	285	22	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2022	100	(2)	2	0	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2018	2.900	(21)	34	13	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.03.2019	1.300	(19)	27	8	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2022	10.000	122	(36)	86	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.600	(65)	(53)	(118)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2018	9.700	(325)	329	4	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2019	1.400	(62)	60	(2)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2020	2.400	(150)	123	(27)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.09.2020	4.300	12	55	67	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	6.100	(64)	34	(30)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2024	10.100	(1.381)	1.103	(278)	(0,01)
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	100	(1)	(1)	(2)	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2018	7.300	(50)	83	33	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.03.2019	8.000	(51)	103	52	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2019	17.500	110	38	148	0,01
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	1.400	(17)	(1)	(18)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2023	59.300	(646)	(458)	(1.104)	(0,04)
HUS	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.12.2018	2.500	26	5	31	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.03.2019	4.200	3	(5)	(2)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.09.2020	5.000	(283)	325	42	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2023	12.800	(169)	(37)	(206)	(0,01)
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	35.500	(313)	(220)	(533)	(0,02)
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2018	4.700	(27)	48	21	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.03.2019	400	(33)	34	1	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.03.2019	2.400	(136)	122	(14)	0,00
JPM	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2019	5.700	57	(10)	47	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.09.2020	12.100	(755)	852	97	0,01
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2018	5.000	(36)	58	22	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2019	1.400	7	5	12	0,00
	Penerbangan Malaysia Bhd.	1,000	20.09.2020	8.500	(102)	195	93	0,01
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.03.2019	1.300	(12)	18	6	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2021	7.500	(543)	590	47	0,00
NGF	Petroleos Mexicanos	1,000	20.03.2019	9.600	(186)	203	17	0,00
	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2018	5.800	(61)	41	(20)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	9.600	(620)	403	(217)	(0,01)
UAG	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	350	(25)	9	(16)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2021	1.200	(79)	85	6	0,00
					\$ (12.108)	\$ 10.402	\$ (1.706)	(0,06)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Rückertlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Rückertlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds 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	07/2018	€ 411	\$ 476	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	07/2018	16.212	COP 46.382.532	0	(430)	(430)	(0,02)
	07/2018	5.584	€ 4.771	0	(13)	(13)	0,00
BPS	08/2018	ARS 105.570	\$ 4.626	1.141	0	1.141	0,04
	07/2018	1.034	38	2	0	2	0,00
	07/2018	BRL 21.063	5.600	125	0	125	0,00
	07/2018	¥ 93.000	856	17	0	17	0,00
	07/2018	\$ 37	ARS 1.034	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	5.502	BRL 21.063	0	(27)	(27)	0,00
	07/2018	99.354	€ 85.392	346	0	346	0,01
	08/2018	€ 85.392	\$ 99.575	0	(341)	(341)	(0,01)
	08/2018	\$ 12.250	MXN 235.622	0	(366)	(366)	(0,01)
CBK	07/2018	COP 2.863.990	\$ 991	16	0	16	0,00
	07/2018	£ 19.264	25.522	89	0	89	0,00
	07/2018	TRY 19.430	4.133	0	(76)	(76)	0,00
	08/2018	\$ 142	MXN 2.870	2	0	2	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
DUB	08/2018	\$ 18.662	TRY 84.790	\$ 0	\$ (531)	\$ (531)	(0,02)
DUB	09/2018	141	EGP 2.593	1	0	1	0,00
FBF	07/2018	COP 2.890.000	\$ 1.000	17	0	17	0,00
	10/2018	€ 3.600	4.485	252	0	252	0,01
GLM	07/2018	\$ 4.504	€ 3.815	0	(49)	(49)	0,00
	09/2018	109	EGP 2.015	1	0	1	0,00
	09/2018	9.974	TWD 293.684	0	(290)	(290)	(0,01)
HUS	07/2018	AUD 6	\$ 4	0	0	0	0,00
	07/2018	£ 49	65	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 40	ARS 1.034	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	481	€ 415	3	0	3	0,00
	07/2018	3.522	£ 2.688	27	0	27	0,00
	08/2018	14.889	RUB 930.569	0	(128)	(128)	0,00
	09/2018	CNH 657	\$ 103	4	0	4	0,00
	09/2018	CNY 103.130	16.099	598	0	598	0,02
	09/2018	TWD 512.619	17.262	359	0	359	0,01
	10/2018	€ 1.200	1.489	78	0	78	0,00
IND	09/2018	\$ 32	MYR 128	0	0	0	0,00
	09/2018	7.440	TWD 219.108	0	(215)	(215)	(0,01)
JPM	07/2018	€ 1.937	€ 1.652	0	(8)	(8)	0,00
	07/2018	4	SGD 5	0	0	0	0,00
	08/2018	AUD 510	\$ 386	9	0	9	0,00
	08/2018	ZAR 76.723	6.012	440	0	440	0,02
	09/2018	\$ 3.438	EGP 62.930	0	(3)	(3)	0,00
	09/2018	6.338	KRW 6.820.956	0	(197)	(197)	(0,01)
MSB	09/2018	MYR 1.030	\$ 257	3	0	3	0,00
	09/2018	\$ 0	MYR 0	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	€ 8.300	\$ 10.097	404	0	404	0,02
	09/2018	KRW 6.825.501	6.350	204	0	204	0,01
SSB	07/2018	€ 95.630	110.726	0	(927)	(927)	(0,03)
TOR	07/2018	\$ 846	¥ 93.000	0	(7)	(7)	0,00
	08/2018	AUD 5	\$ 4	0	0	0	0,00
	08/2018	¥ 93.000	848	7	0	7	0,00
UAG	07/2018	\$ 10.399	€ 8.300	0	(707)	(707)	(0,03)
	07/2018	25.471	£ 19.264	0	(39)	(39)	0,00
	08/2018	£ 19.264	\$ 25.507	40	0	40	0,00
	09/2018	\$ 0	MYR 0	0	0	0	0,00
				\$ 4.185	\$ (4.364)	\$ (179)	(0,01)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Class M Retail AUD (Hedged) 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	07/2018	\$ 856	AUD 1.138	\$ 0	\$ (16)	\$ (16)	0,00
BOA	07/2018	AUD 1.150	\$ 849	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	\$ 849	AUD 1.150	1	0	1	0,00
GLM	07/2018	AUD 1.251	\$ 919	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	\$ 857	AUD 1.141	0	(15)	(15)	0,00
	08/2018	845	1.151	5	0	5	0,00
HUS	07/2018	AUD 32	\$ 24	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 55	AUD 75	0	0	0	0,00
JPM	07/2018	861	1.136	0	(22)	(22)	0,00
RBC	07/2018	4	5	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	AUD 41	\$ 31	1	0	1	0,00
SCX	07/2018	\$ 5	AUD 7	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	108	146	0	0	0	0,00
TOR	07/2018	17	22	0	0	0	0,00
				\$ 8	\$ (59)	\$ (51)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CHF (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 25.976	CHF 25.582	\$ 0	\$ (213)	\$ (213)	(0,01)
BRC	07/2018	51	50	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2018	25.951	25.632	0	(137)	(137)	(0,01)
GLM	07/2018	CHF 25.325	\$ 25.375	1	(131)	(130)	0,00
	07/2018	\$ 25.890	CHF 25.620	0	(88)	(88)	0,00
	08/2018	25.220	25.109	130	0	130	0,00
JPM	07/2018	CHF 25.121	\$ 25.353	54	0	54	0,00
	07/2018	\$ 9	CHF 9	0	0	0	0,00
	08/2018	25.417	25.121	0	(54)	(54)	0,00
SSB	07/2018	CHF 357	\$ 364	4	0	4	0,00
				\$ 189	\$ (624)	\$ (435)	(0,02)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 511.385	€ 435.650	\$ 0	\$ (2.742)	\$ (2.742)	(0,10)
BRC	07/2018	€ 99	\$ 116	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 4.057	€ 3.507	38	0	38	0,00
CBK	07/2018	€ 2.698	\$ 3.130	9	(29)	(20)	0,00
	07/2018	\$ 33	€ 28	0	0	0	0,00
GLM	07/2018	11.520	9.759	1	(127)	(126)	0,00
MSB	07/2018	€ 428.517	\$ 494.937	0	(5.378)	(5.378)	(0,20)
	07/2018	\$ 13.947	€ 11.881	0	(75)	(75)	0,00
	08/2018	496.028	428.517	5.374	0	5.374	0,20
RBC	07/2018	€ 751	\$ 870	0	(7)	(7)	0,00
	07/2018	\$ 147	€ 126	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	€ 20.066	\$ 23.481	53	0	53	0,00
	07/2018	\$ 3.767	€ 3.239	15	0	15	0,00
SCX	07/2018	€ 12.298	\$ 14.501	144	(1)	143	0,01
	07/2018	\$ 508.105	€ 438.561	3.965	(28)	3.937	0,15
SSB	07/2018	€ 429.148	\$ 499.571	0	(1.481)	(1.481)	(0,06)
	07/2018	\$ 508.055	€ 436.603	1.701	0	1.701	0,07
	08/2018	500.680	429.148	1.460	0	1.460	0,05
				\$ 12.761	\$ (9.868)	\$ 2.893	0,12

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class 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	07/2018	£ 69	\$ 91	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2018	\$ 46	£ 34	0	(1)	(1)	0,00
BOA	07/2018	132.515	99.245	0	(1.486)	(1.486)	(0,06)
BPS	07/2018	4.729	3.559	0	(30)	(30)	0,00
BRC	07/2018	£ 98.405	\$ 128.682	0	(1.237)	(1.237)	(0,05)
	07/2018	\$ 70	£ 52	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	128.672	98.262	1.234	0	1.234	0,05
CBK	07/2018	£ 1.178	\$ 1.579	24	0	24	0,00
	07/2018	\$ 131.661	£ 99.376	0	(459)	(459)	(0,02)
GLM	07/2018	£ 570	\$ 760	8	0	8	0,00
RYL	07/2018	\$ 45	£ 34	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	132.222	99.461	0	(909)	(909)	(0,03)
SSB	07/2018	£ 1.427	\$ 1.902	24	(5)	19	0,00
	07/2018	\$ 287	£ 215	0	(3)	(3)	0,00
UAG	07/2018	£ 98.440	\$ 130.163	197	0	197	0,01
	08/2018	\$ 130.347	£ 98.440	0	(205)	(205)	(0,01)
				\$ 1.487	\$ (4.336)	\$ (2.849)	(0,11)

Zum 30. Juni 2018 standen für die E SGD (Hedged) Class 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	09/2018	SGD 11	\$ 8	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	09/2018	\$ 3.999	SGD 5.310	0	(98)	(98)	(0,01)
CBK	07/2018	4	6	0	0	0	0,00
	09/2018	SGD 395	\$ 295	5	0	5	0,00
GLM	09/2018	6	4	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 11	SGD 14	0	0	0	0,00
HUS	09/2018	SGD 226	\$ 167	1	0	1	0,00
JPM	09/2018	40	30	1	0	1	0,00
NGF	09/2018	\$ 1.082	SGD 1.446	0	(20)	(20)	0,00
RYL	07/2018	132	177	0	(2)	(2)	0,00
SSB	09/2018	SGD 393	\$ 293	5	0	5	0,00
UAG	09/2018	\$ 3.318	SGD 4.425	0	(67)	(67)	0,00
				\$ 12	\$ (187)	\$ (175)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 866 0,04

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKTWERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Freddie Mac, TBA 5,000 % fällig am 12.07.2048	\$ 1.000	\$ (1.056)	(0,04)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (1.056)	(0,04)
Summe Anlagen		\$ 2.586.152	97,81
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 58.002	2,19
Nettovermögen		\$ 2.644.154	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) 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:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Afren PLC	15,000 %	25.04.2049	30.04.2015	\$ 10.148	\$ 1.156	0,04
JPMorgan Structured Products BV	16,623	30.08.2018	30.01.2018	3.757	3.694	0,14
				\$ 13.905	\$ 4.850	0,18

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 8.805 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 7.318 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 20.140 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 582	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	\$ (595)	\$ 582	\$ 582	0,02
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (595)</b>	<b>\$ 582</b>	<b>\$ 582</b>	<b>0,02</b>

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 242.701	\$ 2.322.576	\$ 25.240	\$ 2.590.517
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	36	(3.345)	0	(3.309)
Leerverkäufe	0	(1.056)	0	(1.056)
<b>Summen</b>	<b>\$ 242.737</b>	<b>\$ 2.318.175</b>	<b>\$ 25.240</b>	<b>\$ 2.586.152</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 191.265	\$ 3.036.052	\$ 40.147	\$ 3.267.464
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(316)	24.104	0	23.788
Leerverkäufe	0	(1.074)	0	(1.074)
<b>Summen</b>	<b>\$ 190.949</b>	<b>\$ 3.059.082</b>	<b>\$ 40.147</b>	<b>\$ 3.290.178</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 der Wertpapieranlagen.

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,250 %	13.04.2018	02.07.2018	\$ (8.519)	\$ (8.514)	(0,32)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (8.514)</b>	<b>(0,32)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (17)	\$ 0	\$ (17)
BOA	(3.543)	10.410	6.867
BPS	2.323	(2.110)	213
BRC	(466)	530	64
CBK	(1.165)	2.700	1.535
DUB	195	(360)	(165)
FBF	409	(330)	79
GLM	(559)	840	281
GST	(429)	300	(129)
HUS	279	(260)	19
IND	(215)	0	(215)
JPM	491	(310)	181
MSB	(76)	0	(76)
MYC	70	(63)	7
NGF	(257)	260	3
RBC	(7)	0	(7)
RYL	67	(250)	(183)
SCX	3.779	1.170	4.949
SSB	778	3.090	3.868
UAG	(791)	840	49

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	77,97	84,56
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	7,31	4,68
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	12,69	9,03
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,16)	(0,03)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,04	0,75
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,04)	(0,03)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,32)	(1,24)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	123.550.028	\$ 1.236.970
	<b>PARI (000S)</b>	
Argentina Government International Bond 5,875 % fällig am 11.01.2028	\$ 35.400	35.071
Pelabuhan Indonesia Persero PT 4,500 % fällig am 02.05.2023	33.900	33.524
Turkey Government International Bond 6,125 % fällig am 24.10.2028	29.700	29.530
Turkey Government International Bond 5,125 % fällig am 17.02.2028	28.000	27.835
Saudi Government International Bond 4,000 % fällig am 17.04.2025	26.300	26.056
Oman Government International Bond 5,625 % fällig am 17.01.2028	24.800	24.751
Argentina Government International Bond 6,875 % fällig am 11.01.2028	24.700	23.614
Ecuador Government International Bond 7,875 % fällig am 23.01.2028	23.300	23.493
Ministry of Finance and Economic Affairs 7,825 % fällig am 10.12.2019	21.833	21.833
Nigeria Government International Bond 7,143 % fällig am 23.02.2030	21.600	21.808
Türkiye Garanti Bankası A/Ş 3,606 % fällig am 11.02.2019	14.900	14.900
Qatar Government International Bond 3,875 % fällig am 23.04.2023	14.200	14.108
Ghana Government International Bond 7,875 % fällig am 07.08.2023	12.900	14.001
Argentina Government International Bond 8,280 % fällig am 31.12.2033	12.618	13.798
Saudi Government International Bond 4,500 % fällig am 17.04.2030	13.200	13.125
Israel Government International Bond 4,125 % fällig am 17.01.2048	13.000	12.936
Guatemala Government International Bond 5,750 % fällig am 06.06.2022	11.900	12.725
Israel Government International Bond 3,250 % fällig am 17.01.2028	11.600	11.518
Israel Electric Corp. Ltd. 4,250 % fällig am 14.08.2028	11.200	11.098

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	108.470.204	\$ 1.086.000
PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)	981.860	99.630
	<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2046	\$ 30.500	28.651
Saudi Government International Bond 4,000 % fällig am 17.04.2025	26.300	25.992
Argentina Government International Bond 5,875 % fällig am 11.01.2028	25.600	24.199
Turkey Government International Bond 6,000 % fällig am 25.03.2027	20.300	20.484
U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 30.04.2021	21.000	20.227
Argentina Government International Bond 7,500 % fällig am 22.04.2026	17.650	19.342
Argentina Government International Bond 6,875 % fällig am 26.01.2027	16.000	17.141
Qatar Government International Bond 3,875 % fällig am 23.04.2023	14.200	14.138
Ecuador Government International Bond 8,875 % fällig am 23.10.2027	12.500	13.602
Argentina Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.05.2018	13.400	13.301
Turkey Government International Bond 6,125 % fällig am 24.10.2028	11.900	11.924
Israel Government International Bond 3,250 % fällig am 17.01.2028	10.600	10.212
Saudi Government International Bond 2,875 % fällig am 04.03.2023	10.000	9.635
Jordan Government International Bond 5,750 % fällig am 31.01.2027	9.900	9.469
Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 7,288 % fällig am 16.08.2037	6.990	8.774
Banque Centrale de Tunisie International Bond 8,250 % fällig am 19.09.2027	8.100	8.744
Argentina Government International Bond 8,280 % fällig am 31.12.2033	7.010	7.718
Nigeria Government International Bond 7,875 % fällig am 16.02.2032	7.200	7.697

(a) Der Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER
Petra Diamonds U.S. Treasury PLC				Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.				4,000 % fällig am 06.03.2020
7,250 % fällig am 01.05.2022 \$	3.000	2.899	1,45	3,375 % fällig am 30.11.2018 CHF	1.000	1.019	0,51	ARS 40
Polysius Finance PLC				6,510 % fällig am 07.03.2022 \$	700	744	0,37	Ghana Government International Bond
4,700 % fällig am 29.01.2024	2.400	\$ 2.257	1,13	Genneia S.A.				7,875 % fällig am 07.08.2023 \$
Proven Honour Capital Ltd.				8,750 % fällig am 20.01.2022	500	\$ 484	0,24	Korea Resources Corp.
4,125 % fällig am 19.05.2025				Greenko Dutch BV				4,000 % fällig am 18.04.2023
4,125 % fällig am 06.05.2026	700	665	0,33	4,875 % fällig am 24.07.2022	300	282	0,14	Provincia de Buenos Aires
QGOG Constellation S.A. (9,000 % bar und 0,500 % PIK)	200	189	0,09	Israel Electric Corp. Ltd.				35,533 % fällig am 06.12.2019
09.11.2024 (a)	5.069	2.142	1,07	4,250 % fällig am 14.08.2028	800	772	0,39	ARS 50
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.				Minejesa Capital BV				Provincia de Neuquen
5,838 % fällig am 30.09.2027	1.000	1.070	0,54	4,625 % fällig am 10.08.2030	1.700	1.553	0,78	7,500 % fällig am 27.04.2025 \$
Rede D'or Finance SARL				Neerg Energy Ltd.				Ukraine Government International Bond
4,950 % fällig am 17.01.2028	1.200	1.072	0,54	6,000 % fällig am 13.02.2022	1.300	1.212	0,61	7,750 % fällig am 01.09.2021
Sable International Finance Ltd.				Novatek OAO via Novatek Finance DAC				1.100
6,875 % fällig am 01.08.2022	650	671	0,34	4,422 % fällig am 13.12.2022	400	397	0,20	1.088
Samarco Mineracao S.A.				Odebrecht Drilling Norbe Ltd.				5.964
4,125 % fällig am 01.11.2022	445	325	0,16	6,350 % fällig am 01.12.2021	730	690	0,35	2.99
5,375 % fällig am 28.09.2024	950	698	0,35	Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar oder 7,350 % PIK)				
5,750 % fällig am 24.10.2023	500	368	0,18	7,350 % fällig am 01.12.2025 (a)	894	445	0,22	<b>AKTIEN</b>
Sappi Papier Holding GmbH				Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.				<b>INVESTMENTFONDS</b>
7,500 % fällig am 15.06.2032	1.305	1.344	0,67	6,720 % fällig am 01.12.2022	2.496	2.265	1,14	PIMCO Specialty Funds Ireland
Semiconductor Manufacturing International Corp.				Peru LNG SRL				p.l.c. - PIMCO China Bond
4,125 % fällig am 07.10.2019	1.100	1.102	0,55	5,375 % fällig am 22.03.2030	1.900	1.890	0,95	Fund (f)
SEPLAT Petroleum Development Co. PLC				Petrobras Global Finance BV				25.272
9,250 % fällig am 01.04.2023	400	392	0,20	5,999 % fällig am 27.01.2028	2.235	2.027	1,02	288
SK Telecom Co. Ltd.				Rio Energy S.A.				730
3,750 % fällig am 16.04.2023	2.700	2.677	1,34	6,875 % fällig am 01.02.2025	2.200	1.837	0,92	<b>STAMMAKTIEN</b>
Stillwater Mining Co.				Rio Oil Finance Trust				<b>ENERGIE</b>
6,125 % fällig am 27.06.2022	1.900	1.704	0,86	9,750 % fällig am 06.01.2027	572	618	0,31	Frontera Energy Corp. (b)
Studio City Co. Ltd.				Rosneft Oil Co Via Rosneft International Finance DAC				50.258
5,875 % fällig am 30.11.2019	1.200	1.215	0,61	4,199 % fällig am 06.03.2022	600	586	0,29	730
Studio City Finance Ltd.				Sinopec Group Overseas Development Ltd.				<b>FINANZWERTE</b>
8,500 % fällig am 01.12.2020	900	907	0,46	3,900 % fällig am 17.05.2022	1.000	1.007	0,51	Hipotecaria Su Casita S.A.
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.				VEON Holdings BV				332.624
3,750 % fällig am 23.01.2023	1.000	973	0,49	4,950 % fällig am 16.06.2024	1.100	1.043	0,52	0
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				5,950 % fällig am 13.02.2023	700	707	0,35	730
2,800 % fällig am 21.07.2023	6.200	5.361	2,69	Yankuang Group Cayman Ltd.				0,00
Tianqi Finco Co. Ltd.				4,750 % fällig am 30.11.2020	700	671	0,34	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>
3,750 % fällig am 28.11.2022	200	185	0,09	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		24.663	12,37	PIMCO Fixed Income Source
Topaz Marine S.A.				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				ETFs plc - PIMCO US Dollar
9,125 % fällig am 26.07.2022	1.100	1.115	0,56	U.S. Treasury Notes				Short Maturity Source
Tullow Oil PLC				1,875 % fällig am 31.01.2022 (i)	10.500	10.216	5,12	UCITS ETF (f)
6,250 % fällig am 15.04.2022	1.450	1.408	0,71	2,000 % fällig am 31.12.2021 (i)	6.400	6.259	3,14	1.000
7,000 % fällig am 01.03.2025	1.200	1.137	0,57			16.475	8,26	101
Union Andina de Cementos S.A.A.				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				0,05
5,875 % fällig am 30.10.2021	500	514	0,26	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>
United Group BV				2,321 % fällig am 25.10.2035	1.304	1.283	0,65	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (j)</b>
4,375 % fällig am 01.07.2022 €	400	477	0,24	Citigroup Mortgage Loan Trust				127
Vedanta Resources PLC				2,311 % fällig am 25.09.2037 ^	117	98	0,05	0,06
6,375 % fällig am 30.07.2022 \$	1.000	955	0,48	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				<b>KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>
VTR Finance BV				2,281 % fällig am 25.04.2037	202	152	0,08	Letras del Banco Central de la Republica Argentina
6,875 % fällig am 15.01.2024	1.100	1.109	0,56	JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				29,600 % fällig am 15.08.2018
WTT Investment Ltd.				NovaStar Mortgage Funding Trust				ARS 1.292
5,500 % fällig am 21.11.2022	1.400	1.340	0,67	2,291 % fällig am 25.09.2037	296	288	0,14	33,500 % fällig am 18.07.2018
Wynn Macau Ltd.				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				10
4,875 % fällig am 01.10.2024	700	670	0,34	Citigroup Mortgage Loan Trust				0
Yancoal International Resources Development Co. Ltd.				6,750 % fällig am 25.05.2036	590	454	0,23	0
5,750 % fällig am 13.04.2020	300	296	0,15	Countrywide Asset-Backed Certificates				2
(e)				2,311 % fällig am 25.09.2037 ^	117	98	0,05	2
YPF S.A.				Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				0,00
8,500 % fällig am 23.03.2021	300	306	0,15	2,281 % fällig am 25.04.2037	202	152	0,08	6
8,500 % fällig am 28.07.2025	1.300	1.243	0,62	JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				0,01
				2,741 % fällig am 25.12.2035	1.100	1.047	0,52	1
		83.802	42,04	NovaStar Mortgage Funding Trust				1
				2,291 % fällig am 25.09.2037	296	288	0,14	30
								1
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				1
				Argentina Government International Bond				1
				7,820 % fällig am 31.12.2033 €	826	965	0,48	30
				22,844 % fällig am 04.10.2022				30
				34,188 % fällig am 03.04.2022				30
				40,000 % fällig am 21.06.2020	6.381	231	0,12	30
								30
								30
								90
								3
								15
								<b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>
								19,005 % fällig am 09.08.2018 (c)(d)
								NGN 67.900
								185
								0,09
								24,941 % fällig am 19.07.2018 (c)(d)
								60.900
								168
								0,09
								353
								0,18
								Summe kurzfristige Instrumente
								1.118
								0,56

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	14.166	\$ 142	0,07
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt		\$ 203.072	101,87

## 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 Nettvermögens
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	183	\$ 79	0,04
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 79	0,04

## 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 Nettvermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,650 %	02.01.2025	BRL 11.000	\$ (74)	(0,04)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	21.06.2022	\$ 24.900	(674)	(0,34)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.06.2047	6.100	410	0,21
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	4.740	(139)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	1.040	54	0,03
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (423)	(0,21)

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (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>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
BRC	Russia Government International Bond	(1,000) %	20.06.2022	\$ 2.300	\$ 51	\$ (33)	\$ 17	0,01

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
CBK	Nigeria Government International Bond	1,000 %	20.08.2018	\$ 650	\$ (7)	\$ 6	\$ (1)	0,00
JPM	JBS Investments GmbH	1,000	20.12.2018	1.700	(50)	24	(26)	(0,02)
Summe					\$ (57)	\$ 30	\$ (27)	(0,02)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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 Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme /(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	07/2018	ARS 19.253	\$ 701	\$ 35	\$ 0	\$ 35	0,02
	07/2018	€ 4.250	4.929	0	(34)	(34)	(0,02)
	07/2018	¥ 58.100	535	10	0	10	0,01
	07/2018	\$ 695	ARS 19.253	0	(34)	(34)	(0,02)
	08/2018	CHF 2.064	\$ 2.084	0	(2)	(2)	0,00
BRC	09/2018	ARS 9.481	341	37	0	37	0,02
DUB	07/2018	\$ 690	ARS 19.253	0	(23)	(23)	(0,01)
GLM	07/2018	£ 184	\$ 245	2	0	2	0,00
	08/2018	\$ 1.043	CHF 1.026	0	(6)	(6)	0,00
HUS	07/2018	410	€ 354	3	0	3	0,00
	09/2018	CNH 10.469	\$ 1.645	70	0	70	0,03
	09/2018	\$ 1.135	EGP 20.815	1	0	1	0,00
JPM	08/2018	NGN 67.900	\$ 175	0	(12)	(12)	(0,01)
	11/2018	\$ 1.191	NGN 447.221	23	0	23	0,01
SCX	07/2018	NGN 56.717	\$ 147	0	(9)	(9)	0,00
	11/2018	89.153	238	0	(4)	(4)	0,00
SSB	07/2018	\$ 4.947	€ 4.250	15	0	15	0,01
	08/2018	€ 4.250	\$ 4.958	0	(14)	(14)	(0,01)
TOR	07/2018	\$ 529	¥ 58.100	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	¥ 58.100	\$ 530	4	0	4	0,00
				\$ 200	\$ (142)	\$ 58	0,03

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Class E CHF (Hedged) die folgenden Devisenkontrakte 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	07/2018	CHF 111	\$ 112	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07/2018	\$ 7.725	CHF 7.608	0	(63)	(63)	(0,03)
BPS	07/2018	CHF 126	\$ 127	0	0	0	0,00
BRC	07/2018	90	92	1	0	1	0,00
CBK	07/2018	162	162	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 7.730	CHF 7.635	0	(41)	(41)	(0,02)
GLM	07/2018	CHF 7.478	\$ 7.493	0	(38)	(38)	(0,02)
	07/2018	\$ 7.714	CHF 7.634	0	(26)	(26)	(0,01)
	08/2018	7.351	7.318	38	0	38	0,02
JPM	07/2018	CHF 7.321	\$ 7.388	15	0	15	0,01
	08/2018	\$ 7.405	CHF 7.318	0	(16)	(16)	(0,01)
SSB	07/2018	CHF 74	\$ 76	1	0	1	0,00
				\$ 56	\$ (185)	\$ (129)	(0,06)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutionell EUR (Hegend) Class und Class E EUR (Hegend) 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	07/2018	\$ 44.419	€ 37.841	\$ 0	\$ (238)	\$ (238)	(0,12)
BPS	07/2018	43.744	37.715	290	0	290	0,15
BRC	07/2018	€ 384	\$ 445	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	\$ 12	€ 10	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	€ 294	\$ 344	2	(1)	1	0,00
	07/2018	\$ 102	€ 88	1	0	1	0,00
GLM	07/2018	€ 331	\$ 390	4	0	4	0,00
	07/2018	\$ 202	€ 173	0	0	0	0,00
MSB	07/2018	€ 36.626	\$ 42.303	0	(460)	(460)	(0,23)
	08/2018	\$ 42.396	€ 36.626	459	0	459	0,23
RBC	07/2018	€ 9	\$ 11	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	1.003	1.172	3	(2)	1	0,00
	07/2018	\$ 293	€ 250	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2018	€ 1.126	\$ 1.317	4	(2)	2	0,00
SSB	07/2018	36.626	42.636	0	(126)	(126)	(0,06)
	07/2018	\$ 44.034	€ 37.841	147	0	147	0,07
	08/2018	42.731	36.626	125	0	125	0,06
				\$ 1.035	\$ (834)	\$ 201	0,10

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 2.393	£ 1.792	\$ 0	\$ (27)	\$ (27)	(0,01)		
BRC	07/2018	£ 1.776	\$ 2.322	0	(22)	(22)	(0,01)		
	08/2018	\$ 2.326	£ 1.776	23	0	23	0,01		
CBK	07/2018	£ 2	\$ 3	0	0	0	0,00		
	07/2018	\$ 2.375	£ 1.792	0	(8)	(8)	(0,01)		
GLM	07/2018	£ 8	\$ 11	0	0	0	0,00		
SCX	07/2018	\$ 2.388	£ 1.796	0	(17)	(17)	(0,01)		
UAG	07/2018	£ 1.776	\$ 2.348	4	0	4	0,00		
	08/2018	\$ 2.352	£ 1.776	0	(4)	(4)	0,00		
						\$ 27	\$ (78)	\$ (51)	(0,03)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>							\$ 69	0,03	
<b>Summe Anlagen</b>							\$ 202.797	101,73	
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>							\$ (3.447)	(1,73)	
<b>Nettovermögen</b>							\$ 199.350	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) 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

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Afren PLC	15,000 %	25.04.2049	30.04.2015	\$ 10.148	\$ 1.156	0,58
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.	4,150	06.03.2019	16.01.2018	804	800	0,40
				\$ 10.952	\$ 1.956	0,98

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 7.793 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 599 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 1.100 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 127	U.S. Treasury Notes 1.500 % fällig am 31.01.2022	\$ (130)	\$ 127	\$ 127	0,06
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						\$ (130)	\$ 127	\$ 127	0,06

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 1.261	\$ 198.974	\$ 2.837	\$ 203.072
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	79	(354)	0	(275)
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.340</b>	<b>\$ 198.620</b>	<b>\$ 2.837</b>	<b>\$ 202.797</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 3.401	\$ 232.521	\$ 7.841	\$ 243.763
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	1.115	0	1.115
<b>Summen</b>	<b>\$ 3.401</b>	<b>\$ 233.636</b>	<b>\$ 7.841</b>	<b>\$ 244.878</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 der Wertpapieranlagen.

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
GRE	2,060 %	25.05.2018	09.07.2018	\$ (1.179)	\$ (1.182)	(0,59)
SCX	2,120	22.05.2018	22.08.2018	(5.932)	(5.946)	(2,98)
	2,130	24.05.2018	24.08.2018	(687)	(688)	(0,35)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (7.816)</b>	<b>(3,92)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (327)	\$ 810	\$ 483
BPS	265	0	265
BRC	51	0	51
CBK	(49)	0	(49)
DUB	(23)	0	(23)
GLM	(26)	0	(26)
HUS	74	0	74
JPM	(16)	0	(16)
MSB	(1)	0	(1)
SCX	(27)	0	(27)
SSB	148	290	438

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	82,69	79,98
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	15,41	11,11
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	3,77	13,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,21)	(0,11)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,03	0,59
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(3,92)	(6,70)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Local Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	7.383.584	\$ 73.923	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	7.670.804	\$ 76.800
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>U.S. Treasury Notes</b>			<b>U.S. Treasury Notes</b>		
2,000 % fällig am 15.11.2026	\$ 20.600	19.407	2,000 % fällig am 15.11.2026	\$ 29.100	27.375
<b>Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV</b>			<b>U.S. Treasury Notes</b>		
2,800 % fällig am 21.07.2023	7.800	6.657	1,875 % fällig am 31.01.2022	4.900	4.754
<b>Metinvest BV</b>			<b>Siam Commercial Bank PCL</b>		
7,750 % fällig am 23.04.2023	3.000	2.970	3,500 % fällig am 07.04.2019	3.200	3.215
<b>Rio Oil Finance Trust</b>			<b>State Bank of India</b>		
8,200 % fällig am 06.04.2028	2.900	2.900	3,275 % fällig am 06.04.2020	3.100	3.106
<b>Hankook Tire Co Ltd</b>			<b>Eastern Creation Investment Holdings Ltd.</b>		
3,500 % fällig am 30.01.2023	2.800	2.792	2,750 % fällig am 26.09.2020	3.100	3.031
<b>SK Telecom Co. Ltd.</b>			<b>Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV</b>		
3,750 % fällig am 16.04.2023	2.700	2.694	1,250 % fällig am 31.03.2023	€ 2.550	2.760
<b>Rede D'or Finance SARL</b>			<b>RH International Singapore Corp. Pte Ltd.</b>		
4,950 % fällig am 17.01.2028	2.600	2.600	4,500 % fällig am 27.03.2028	\$ 2.300	2.345
<b>Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.</b>			<b>BOC Aviation Ltd</b>		
3,750 % fällig am 23.01.2023	2.500	2.490	3,413 % fällig am 02.05.2021	2.300	2.314
<b>Vrio Finco 1 LLC</b>			<b>Indian Railway Finance Corp. Ltd.</b>		
6,250 % fällig am 04.04.2023	2.400	2.406	3,835 % fällig am 13.12.2027	2.300	2.308
<b>Polyus Finance PLC</b>			<b>Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV</b>		
4,700 % fällig am 29.01.2024	2.400	2.400	1,875 % fällig am 31.03.2027	€ 2.250	2.265
<b>Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV</b>			<b>Altice Luxembourg S.A.</b>		
1,250 % fällig am 31.03.2023	€ 2.100	2.314	7,625 % fällig am 15.02.2025	\$ 2.300	2.128
<b>QNB Finance Ltd.</b>			<b>Myriad International Holdings BV</b>		
3,705 % fällig am 12.02.2020	\$ 2.300	2.300	5,500 % fällig am 21.07.2025	1.900	2.043
<b>BOC Aviation Ltd</b>			<b>CGNPC International Ltd.</b>		
3,413 % fällig am 02.05.2021	2.300	2.300	1,625 % fällig am 11.12.2024	€ 1.700	2.005
<b>Horse Gallop Finance Ltd.</b>			<b>Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.</b>		
3,516 % fällig am 28.06.2021	2.300	2.300	4,250 % fällig am 19.06.2024	\$ 1.829	1.834
<b>RH International Singapore Corp. Pte Ltd.</b>			<b>Nexa Resources S.A.</b>		
4,500 % fällig am 27.03.2028	2.300	2.299	5,375 % fällig am 04.05.2027	1.700	1.799
<b>CNAC HK Finbridge Co. Ltd.</b>			<b>CBQ Finance Ltd.</b>		
4,625 % fällig am 14.03.2023	2.300	2.297	2,875 % fällig am 24.06.2019	1.800	1.786
<b>Philippine National Bank</b>			<b>Hankook Tire Co Ltd</b>		
4,250 % fällig am 27.04.2023	2.300	2.289	3,500 % fällig am 30.01.2023	1.700	1.678
<b>Frontera Energy Corp.</b>			<b>DP World Ltd.</b>		
9,700 % fällig am 25.06.2023	2.300	2.273	6,850 % fällig am 02.07.2037	1.330	1.658
<b>Dryrocks World LLC</b>			<b>Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.</b>		
0,000 % fällig am 20.11.2020	2.300	2.220	(6,720 % bar oder 7,720 % PIK)		
<b>Hidrovias International Finance SARL</b>			7,720 % fällig am 01.12.2026	5.430	1.582
5,950 % fällig am 24.01.2025	2.200	2.200			
<b>Rio Energy S.A.</b>					
6,875 % fällig am 01.02.2025	2.200	2.185			
<b>Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.</b>					
3,375 % fällig am 30.11.2018	CHF 2.000	2.110			

(a) Der Emerging Markets Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

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>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>CHINA</b>				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>					
<b>ARGENTINIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>PIMCO Fixed Income Source ETFs</b>					
Bank of China Ltd.				0,144 % fällig am 22.11.2020				plc - PIMCO US Dollar Short					
Banco de Galicia y Buenos Aires S.A.				2,250 % fällig am 14.06.2019				Maturity Source UCITS ETF (e)					
25,980 % fällig am 26.04.2020	ARS	2.000	57	0,10	CSCEC Finance Cayman Ltd.	200	234	0,41	28.400	2.881	5,07		
25,500 % fällig am 17.07.2019					0,275 % fällig am 23.05.2020	\$	197	0,35	<b>INVESTMENTFONDS</b>				
HSBC Bank Argentina S.A.					3,113 % fällig am 08.11.2020	\$	250	0,44	<b>PIMCO Specialty Funds Ireland</b>				
25,250 % fällig am 27.09.2019					<b>Sinopec Group Overseas Development Ltd.</b>				<b>p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (e)</b>				
					2,125 % fällig am 03.05.2019		250	0,43	Summe Irland				
		198	0,35		2,500 % fällig am 28.04.2020		200	0,35	3.458 6,08				
					Summe China		1.594	2,80	<b>PARI (000S)</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>KROATIEN</b>				<b>JAPAN</b>					
<b>Argentina Government International Bond</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
0,010 % fällig am 15.08.2018		5.620	185	0,32	Summe Kroatien				Summe Japan				
21,200 % fällig am 19.09.2018		2.916	98	0,17	350 365 0,64				3.025 % fällig am 19.10.2018				
22,844 % fällig am 04.10.2022		200	11	0,02	<b>CZECH REPUBLIC</b>				<b>Summe Mitsui Banking Corp.</b>				
34,188 % fällig am 03.04.2022		8.427	267	0,47	Czech Republic Government International Bond				4,600 % fällig am 18.08.2018				
34,194 % fällig am 11.03.2019		140	5	0,01	4,600 % fällig am 18.08.2018				CZK				
40,000 % fällig am 21.06.2020		10.374	375	0,66	Summe Tschechien				5.400 244 0,43				
Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER					<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>Summe Luxemburg</b>				
4,000 % fällig am 06.03.2020		160	5	0,01	Summe Deutschland				297 0,78				
Provincia de Buenos Aires					<b>GRIECHENLAND</b>				<b>MALAYSIA</b>				
35,190 % fällig am 31.05.2022		414	12	0,02	Greece Government International Bond				Summe Malaysia				
35,533 % fällig am 06.12.2019		200	6	0,01	4,750 % fällig am 17.04.2019				Summe Petronas Capital Ltd.				
			964	1,69	5,250 % fällig am 12.08.2019				152 156 0,27				
Summe Argentinien		1.162	2,04		<b>HONGKONG</b>				<b>MEXIKO</b>				
					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>GRIECHENLAND</b>				<b>INDIEN</b>					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
Commonwealth Bank of Australia				Republic of Greece Government International Bond				Oil India Ltd.					
2,735 % fällig am 18.09.2020	\$	200	201	0,35	4,750 % fällig am 17.04.2019	€	400	481	0,85	3,875 % fällig am 17.04.2019			
<b>BRASILIEN</b>				<b>HONGKONG</b>				<b>INDIEN</b>					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
Caixa Economica Federal				CNPC General Capital Ltd.				State Bank of India					
4,500 % fällig am 03.10.2018		300	301	0,53	2,750 % fällig am 14.05.2019	\$	200	199	0,35	3,275 % fällig am 06.04.2020			
Centrais Eletricas Brasileiras S.A.					2,750 % fällig am 26.09.2020		400	392	0,69	Summe Indien			
6,875 % fällig am 30.07.2019		100	103	0,18	Summe Hongkong		591	1,04	702 1,23				
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.					<b>INDONESIEN</b>				<b>NIEDERLANDE</b>				
0,000 % fällig am 30.07.2018 (b)(d)		23	0	0,00	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Petrobras Global Finance BV					Pertamina Persero PT				ABN AMRO Bank NV				
8,375 % fällig am 23.05.2021		263	287	0,51	5,250 % fällig am 23.05.2021		900	931	1,64	2,995 % fällig am 18.01.2019			
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL					Indonesia Government International Bond		700	740	1,30	ING Bank NV			
9,850 % fällig am 16.07.2032	BRL	2.100	507	0,89	11,625 % fällig am 04.03.2019		700	740	1,30	3,462 % fällig am 22.03.2019			
Summe Brasilien		1.198	2,11		Summe Indonesien		1.671	2,94	Petrobras Global Finance BV				
					<b>IRLAND</b>				8,375 % fällig am 10.12.2018				
<b>KANADA</b>				<b>IRLAND</b>				<b>PERU</b>					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
Enbridge, Inc.				ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC				Banco de Credito del Peru					
2,737 % fällig am 10.01.2020	\$	1.000	1.000	1,76	2,626 % fällig am 28.04.2020	€	100	117	0,20	4,850 % fällig am 30.10.2020			
3,041 % fällig am 15.06.2020		500	502	0,88	AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.	\$	100	101	0,18	Fondo MIVIVIENDA S.A.			
Summe Kanada		1.502	2,64		8,700 % fällig am 07.08.2018		100	101	0,18	7,000 % fällig am 14.02.2024			
					Summe Cayman Inseln		469	0,82	Summe Peru				
					<b>CAYMAN INSELN</b>				248 0,44				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>PERU</b>				<b>NIGERIA</b>					
Odebrecht Drilling Norbe Ltd.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
6,350 % fällig am 01.12.2021		24	23	0,04	Banco de Credito del Peru				Nigeria Government International Bond				
Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar oder 7,350 % PIK)		43	21	0,04	4,850 % fällig am 30.10.2020				5,125 % fällig am 12.07.2018				
7,350 % fällig am 01.12.2026 (a)					Summe Peru				200 200 0,35				
Park Aerospace Holdings Ltd.					<b>IRLAND</b>				<b>PERU</b>				
3,625 % fällig am 15.03.2021		100	97	0,17	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Pemex Finance Ltd.					ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC				Banco de Credito del Peru				
9,150 % fällig am 15.11.2018		125	126	0,22	2,626 % fällig am 28.04.2020	€	100	117	0,20	4,850 % fällig am 30.10.2020			
QNB Finance Ltd.					AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.	\$	100	101	0,18	Fondo MIVIVIENDA S.A.			
3,713 % fällig am 07.02.2020		200	202	0,35	8,700 % fällig am 07.08.2018		100	101	0,18	7,000 % fällig am 14.02.2024			
Summe Cayman Inseln		469	0,82		Summe Cayman Inseln		469	0,82	Summe Peru				
					<b>IRLAND</b>				248 0,44				
					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>PERU</b>				
					ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC				Banco de Credito del Peru				
					2,626 % fällig am 28.04.2020	€	100	117	0,20	4,850 % fällig am 30.10.2020			
					AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.	\$	100	101	0,18	Fondo MIVIVIENDA S.A.			
					8,700 % fällig am 07.08.2018		100	101	0,18	7,000 % fällig am 14.02.2024			
					Summe Cayman Inseln		469	0,82	Summe Peru				
					<b>IRLAND</b>				<b>PERU</b>				
					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
					ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC				Banco de Credito del Peru				
					2,626 % fällig am 28.04.2020	€	100	117	0,20	4,850 % fällig am 30.10.2020			
					AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.	\$	100	101	0,18	Fondo MIVIVIENDA S.A.			
					8,700 % fällig am 07.08.2018		100	101	0,18	7,000 % fällig am 14.02.2024			
					Summe Cayman Inseln		469	0,82	Summe Peru				
					<b>IRLAND</b>				<b>PERU</b>				
					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
					ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC				Banco de Credito del Peru				
					2,626 % fällig am 28.04.2020	€	100	117	0,20	4,850 % fällig am 30.10.2020			
					AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.	\$	100	101	0,18	Fondo MIVIVIENDA S.A.			
					8,700 % fällig am 07.08.2018		100	101	0,18	7,000 % fällig am 14.02.2024			
					Summe Cayman Inseln		469	0,82	Summe Peru				

**Aufstellung der Wertpapieranlagen des  
Emerging Markets Short-Term Local Currency 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	
<b>KATAR</b>								<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>PENSIONSGESCHÄFTE (g)</b>				
Nakilat, Inc. 6,067 % fällig am 31.12.2033	\$ 100	\$ 110	0,20	Soundview Home Loan Trust 2,171 % fällig am 25.06.2037	\$ 7	\$ 5	0,01					
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. 5,298 % fällig am 30.09.2020	274	280	0,49	2,261 % fällig am 25.07.2037	108	94	0,16					
				2,271 % fällig am 25.02.2037	852	364	0,64					
Summe Katar		390	0,69	Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust 2,151 % fällig am 25.10.2036	5	3	0,01					
										\$ 11,552	20,31	
<b>RUSSLAND</b>								<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								<b>Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER</b>				
Russia Government International Bond 11,000 % fällig am 24.07.2018	500	502	0,88					3,750 % fällig am 08.02.2019	ARS	2,000	74	0,13
								<b>Federal Home Loan Bank</b>				
<b>SINGAPUR</b>								<b>1,830 % fällig am 05.07.2018 (b)(c)</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>1,854 % fällig am 13.07.2018 (b)(c)</b>				
DBS Group Holdings Ltd. 2,811 % fällig am 08.06.2020	250	250	0,44	American Honda Finance Corp. 2,512 % fällig am 22.01.2019	350	350	0,62	<b>1,870 % fällig am 30.07.2018 (b)(c)</b>				
				AT&T, Inc. 5,800 % fällig am 15.02.2019	200	204	0,36	<b>1,916 % fällig am 17.08.2018 (b)(c)</b>				
<b>SRI LANKA</b>								<b>JPMorgan Structured Products BV</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								<b>16,623 % fällig am 30.08.2018</b>				
Sri Lanka Government International Bond 5,125 % fällig am 11.04.2019	200	200	0,35	Bank of America Corp. 4,600 % fällig am 21.10.2025	MXN 1.000	65	0,11	<b>(b)(c)(f)</b>				
				BAT Capital Corp. 2,945 % fällig am 14.08.2020	\$ 200	201	0,35	<b>Letras del Banco Central de la Republica Argentina</b>				
<b>TANSANIA</b>								<b>25,600 % fällig am 18.07.2018</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								<b>25,650 % fällig am 15.08.2018</b>				
Tanzania Government International Bond 8,241 % fällig am 09.03.2020	89	91	0,16	Caterpillar Financial Services Corp. 2,611 % fällig am 04.09.2020	300	301	0,53	<b>29,300 % fällig am 15.08.2018</b>				
				CVS Health Corp. 2,957 % fällig am 09.03.2020	400	402	0,71	<b>29,600 % fällig am 15.08.2018</b>				
<b>TÜRKEI</b>								<b>33,500 % fällig am 18.07.2018</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>40,700 % fällig am 18.07.2018</b>				
Türkiye Garanti Bankasi A/S 3,606 % fällig am 11.02.2019	300	298	0,52	Duke Energy Progress LLC 2,501 % fällig am 08.09.2020	200	200	0,35	<b>Nigeria Open Market Operation Bills</b>				
				JPMorgan Chase Bank N.A. 2,702 % fällig am 26.04.2021	600	600	1,05	<b>15,737 % fällig am 08.11.2018</b>				
<b>UKRAINE</b>								<b>EGP 8.600</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								<b>0,000 % fällig am 30.08.2018 (b)(f)</b>				
Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2019	100	100	0,18	Morgan Stanley 3,155 % fällig am 14.02.2020	250	251	0,44	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>				
7,750 % fällig am 01.09.2022	100	98	0,17	Nasdaq, Inc. 2,722 % fällig am 22.03.2019	350	350	0,62	<b>(12,971) % fällig am 14.09.2018 (b)(c)</b>				
Summe Ukraine		198	0,35	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,636 % fällig am 03.09.2019	1.000	1.002	1,76	<b>(12,877) % fällig am 14.09.2018 (b)(c)</b>				
				QVC, Inc. 3,125 % fällig am 01.04.2019	100	100	0,18	<b>(9,693) % fällig am 14.09.2018 (b)(c)</b>				
<b>USA</b>								<b>(6,771) % fällig am 14.09.2018 (b)(c)</b>				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>								<b>(5,317) % fällig am 14.09.2018 (b)(c)</b>				
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 3,091 % fällig am 25.10.2037	26	26	0,04	Sempra Energy 2,791 % fällig am 15.03.2021	600	601	1,06	<b>(4,791) % fällig am 14.09.2018 (b)(c)</b>				
Citigroup Mortgage Loan Trust 2,151 % fällig am 25.07.2045	11	9	0,02	Time Warner Cable LLC 8,750 % fällig am 14.02.2019	100	103	0,18	<b>(4,684) % fällig am 14.09.2018 (b)(c)</b>				
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 2,331 % fällig am 25.02.2037	100	97	0,17					<b>(3,506) % fällig am 14.09.2018 (b)(c)</b>				
2,841 % fällig am 25.11.2035	60	62	0,11					<b>(3,361) % fällig am 14.09.2018 (b)(c)</b>				
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 2,151 % fällig am 25.11.2036	2	2	0,00					<b>(3,154) % fällig am 14.09.2018 (b)(c)</b>				
Home Equity Asset Trust 2,691 % fällig am 25.11.2032	4	4	0,01					<b>(2,677) % fällig am 12.10.2018 (b)(c)</b>				
3,441 % fällig am 25.02.2033	197	196	0,34					<b>(2,374) % fällig am 12.10.2018 (b)(c)</b>				
HSI Asset Loan Obligation Trust 2,151 % fällig am 25.12.2036	3	1	0,00					<b>(0,978) % fällig am 12.10.2018 (b)(c)</b>				
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 2,151 % fällig am 25.05.2037	5	4	0,01					<b>0,934 % fällig am 13.07.2018 (b)(c)</b>				
2,856 % fällig am 25.01.2035	23	22	0,04					<b>0,946 % fällig am 12.10.2018 (b)(c)</b>				
2,886 % fällig am 25.03.2034	98	97	0,17					<b>1,006 % fällig am 10.08.2018 (b)(c)</b>				
Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust 3,441 % fällig am 25.02.2033	39	39	0,07					<b>1,178 % fällig am 24.08.2018 (b)(c)</b>				
New Century Home Equity Loan Trust 2,271 % fällig am 25.05.2036	25	24	0,04					<b>1,457 % fällig am 12.10.2018 (b)(c)</b>				
								<b>1,855 % fällig am 14.09.2018 (b)(c)</b>				
								<b>2,171 % fällig am 27.07.2018 (b)(c)</b>				
								<b>25,750 % fällig am 19.09.2018 (b)(c)</b>				
								<b>25,800 % fällig am 19.09.2018 (b)(c)</b>				
								<b>28,500 % fällig am 19.09.2018 (b)(c)</b>				
								<b>28,600 % fällig am 19.09.2018 (b)(c)</b>				
								<b>39,900 % fällig am 19.09.2018 (b)(c)</b>				
								<b>552</b>				
								<b>0,97</b>				
				<b>Summe USA</b>				<b>6,424 11,30</b>				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
<b>GREECE TREASURY BILLS</b>				15,450 % fällig am 04.10.2018 (b)(c)	NGN	50.000	\$ 135	0,24	<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
1,082 % fällig am 05.10.2018 (b)(c)	€	100	\$ 116	0,20								
				15,501 % fällig am 29.11.2018 (b)(c)		32.900	87	0,15	PIMCO Funds Ireland p.l.c. -			
				15,504 % fällig am 29.11.2018 (b)(c)		40.000	106	0,19	PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	241.798	\$ 2.421	4,26
<b>MEXICO TREASURY BILLS</b>				15,699 % fällig am 22.11.2018 (b)(c)		30.000	79	0,14	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente –			
7,736 % fällig am 16.08.2018 (b)(c)	MXN	57.000	2.870	5,05		24.600	66	0,12	Amtliche Börse/Geregelter Markt		\$ 56.563	99,46
7,858 % fällig am 16.08.2018 (b)(c)		57.500	2.895	5,09		22.600	62	0,11				
			5.765	10,14		13.200	36	0,06				
				24,941 % fällig am 19.07.2018 (b)(c)		11.700	32	0,06				
<b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>												
15,056 % fällig am 29.11.2018 (b)(c)	NGN	41.000	108	0,19				1.158	2,04			
15,195 % fällig am 06.12.2018 (b)(c)		64.300	169	0,30	Summe kurzfristige Instrumente			27.482	48,32			
15,410 % fällig am 04.10.2018 (b)(c)		74.800	202	0,35								
15,432 % fällig am 06.12.2018 (b)(c)		28.800	76	0,13								

## 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
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	3	\$ 2	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 2	0,00

## 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-Year BRL-CDI	8,730 %	04.01.2021	BRL 1.400	\$ (1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,970	02.01.2020	6.300	14	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,600	04.01.2027	2.700	51	0,09
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,450	04.01.2027	800	2	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	\$ 1.920	(66)	(0,11)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	200	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	100	23	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	400	30	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,240	01.02.2021	MXN 6.900	26	0,05
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 80	0,14

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

## VERKAUFSOPTIONEN

## DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Put - OTC USD versus RUB	RUB 54,700	06.03.2019	\$ 600	\$ (9)	\$ (1)	0,00

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	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.06.2018	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	100	0	1	1	0,00
	Egypt Government International Bond	1,000	20.06.2018	0	0	0	0	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2018	300	2	(1)	1	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	200	1	0	1	0,00
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	100	0	1	1	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender		Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
		Festzinssatz	Fälligkeitsdatum					
HUS	Argentine Republic Government International Bond	0,000 %	20.12.2018	\$ 100	£ 1	\$ 0	£ 1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.03.2019	100	0	0	0	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	200	(1)	2	1	0,00
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	100	0	1	1	0,00
NGF	Egypt Government International Bond	1,000	20.06.2018	0	0	0	0	0,00
UAG	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	100	0	1	1	0,01
					\$ 3	\$ 5	\$ 8	0,01

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	07/2018	ARS 3.689	140	13	0	13	0,02
	07/2018	BRL 5.454	1.442	25	0	25	0,04
	07/2018	PLN 475	138	11	0	11	0,02
	07/2018	\$ 6	€ 5	0	0	0	0,00
	08/2018	ARS 7.709	\$ 349	94	0	94	0,17
	08/2018	MXN 9.241	458	0	(8)	(8)	(0,01)
	08/2018	RUB 3.738	59	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 1.438	BRL 5.454	0	(26)	(26)	(0,05)
	08/2018	2.974	CZK 62.377	0	(169)	(169)	(0,30)
	08/2018	855	ILS 3.062	0	(16)	(16)	(0,03)
	08/2018	303	ZAR 3.882	0	(21)	(21)	(0,04)
	09/2018	ARS 2.197	\$ 100	29	0	29	0,05
	09/2018	\$ 4.630	SGD 6.148	0	(113)	(113)	(0,20)
BPS	07/2018	ARS 5.454	\$ 197	10	0	10	0,02
	07/2018	BRL 377	100	2	0	2	0,00
	07/2018	€ 1.155	1.339	0	(9)	(9)	(0,02)
	07/2018	\$ 194	ARS 5.312	0	(9)	(9)	(0,02)
	07/2018	98	BRL 376	0	0	0	0,00
	07/2018	606	¥ 65.800	0	(12)	(12)	(0,02)
	07/2018	246	PEN 805	0	0	0	0,00
	08/2018	ARS 2.210	\$ 103	29	0	29	0,05
	08/2018	CHF 104	105	0	0	0	0,00
	08/2018	HUF 40.579	156	12	0	12	0,02
	08/2018	\$ 148	RON 576	0	(4)	(4)	(0,01)
	09/2018	55	IDR 768.055	0	(2)	(2)	0,00
BRC	07/2018	ARS 4.166	\$ 159	16	0	16	0,03
CBK	07/2018	COP344.077	120	3	0	3	0,01
	07/2018	\$ 19	ARS 508	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	179	COP 515.699	0	(4)	(4)	(0,01)
	07/2018	1.087	RUB 68.721	8	0	8	0,02
	08/2018	EGP 2.516	\$ 138	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	MXN 743	37	0	0	0	0,00
	08/2018	RON 858	216	2	0	2	0,00
	08/2018	RUB 6.387	101	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 2.964	MXN 59.026	14	0	14	0,02
	08/2018	3.110	TRY 13.763	0	(160)	(160)	(0,28)
	09/2018	ARS 1.147	\$ 55	18	0	18	0,03
	09/2018	\$ 22	ARS 603	0	(3)	(3)	0,00
	03/2019	166	RUB 9.719	0	(15)	(15)	(0,03)
DUB	07/2018	ARS 8.176	\$ 292	10	0	10	0,02
	09/2018	600	29	9	0	9	0,02
FBF	07/2018	BRL 300	78	0	0	0	0,00
	07/2018	COP251.430	87	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 625	COP1.800.080	0	(13)	(13)	(0,02)
	08/2018	CZK 389	\$ 18	1	0	1	0,00
	09/2018	\$ 291	INR 19.759	0	(6)	(6)	(0,01)
	10/2018	€ 100	\$ 125	7	0	7	0,01
	03/2019	RUB 9.719	166	15	0	15	0,03
GLM	07/2018	BRL 691	184	4	0	4	0,01
	07/2018	CLP514.298	796	7	0	7	0,01
	07/2018	COP 37.274	13	0	0	0	0,00
	07/2018	£ 105	140	1	0	1	0,00
	07/2018	MYR 64	16	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 179	BRL 691	0	0	0	0,00
	07/2018	79	RUB 4.891	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	MXN 57.000	\$ 2.948	68	0	68	0,12
	08/2018	RUB 1.560	25	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 21	EGP 389	0	0	0	0,00
	08/2018	61	NGN 22.600	1	0	1	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09/2018	EGP 1.408	\$ 76	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	09/2018	\$ 711	CLP 461.447	0	(2)	(2)	0,00
HUS	07/2018	ARS 3.139	\$ 148	41	0	41	0,07
	07/2018	BRL 1.383	365	5	0	5	0,01
	07/2018	RUB 73.612	1.168	0	(5)	(5)	(0,01)
	07/2018	\$ 125	ARS 3.479	0	(6)	(6)	(0,01)
	07/2018	185	BRL 691	0	(6)	(6)	(0,01)
	07/2018	94	COP 270.720	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	ARS 1.140	\$ 53	15	0	15	0,03
	08/2018	CZK 1.300	54	0	(5)	(5)	(0,01)
	08/2018	\$ 20	EGP 368	0	0	0	0,00
	08/2018	4.348	RUB 272.735	5	(27)	(22)	(0,04)
	09/2018	CNY 224	\$ 35	1	0	1	0,00
IND	09/2018	\$ 5.443	CNY 34.944	0	(190)	(190)	(0,33)
	07/2018	1.529	MYR 6.074	0	(25)	(25)	(0,04)
	08/2018	ZAR 3.272	\$ 258	20	0	20	0,04
	09/2018	THB 544	17	1	0	1	0,00
JPM	09/2018	\$ 106	MYR 422	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	818	CLP 514.298	0	(28)	(28)	(0,05)
	07/2018	244	€ 208	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	CZK 4.100	\$ 173	0	(11)	(11)	(0,02)
	08/2018	NGN 13.200	34	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	\$ 33	EGP 611	1	0	1	0,00
	08/2018	1.143	ZAR 14.586	0	(84)	(84)	(0,15)
	09/2018	ARS 3.350	\$ 124	16	0	16	0,03
	09/2018	INR 1.790	26	0	0	0	0,00
	09/2018	NGN 24.600	63	0	(4)	(4)	(0,01)
	09/2018	THB 3.394	106	3	0	3	0,01
	09/2018	\$ 70	EGP 1.295	0	0	0	0,00
	09/2018	252	KRW 271.202	0	(8)	(8)	(0,01)
	10/2018	NGN 117.390	\$ 312	0	(9)	(9)	(0,02)
	11/2018	114.442	304	0	(7)	(7)	(0,01)
	11/2018	\$ 377	NGN 141.135	6	0	6	0,01
MSB	12/2018	NGN 82.614	\$ 219	0	(5)	(5)	(0,01)
	07/2018	\$ 1.754	BRL 6.447	0	(79)	(79)	(0,14)
	07/2018	3.854	PLN 13.097	0	(356)	(356)	(0,62)
	08/2018	EGP 365	\$ 20	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 63	EGP 1.158	1	0	1	0,00
	09/2018	ARS 1.000	\$ 48	16	0	16	0,03
	09/2018	\$ 242	MYR 965	0	(3)	(3)	(0,01)
	10/2018	13	50	0	0	0	0,00
	12/2018	NGN 60.622	\$ 161	0	(4)	(4)	(0,01)
NGF	07/2018	ARS 1.605	56	2	0	2	0,00
	09/2018	\$ 2.450	TWD 72.598	0	(57)	(57)	(0,10)
RBC	08/2018	TRY 676	\$ 147	3	0	3	0,01
RYL	07/2018	PLN 76	21	1	0	1	0,00
SCX	07/2018	NGN 10.896	28	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	\$ 30	NGN 10.896	0	0	0	0,00
	08/2018	NGN 22.600	\$ 58	0	(4)	(4)	(0,01)
	08/2018	\$ 21	EGP 389	1	0	1	0,00
	08/2018	255	ZAR 3.230	0	(21)	(21)	(0,04)
	09/2018	IDR 963.749	\$ 68	1	0	1	0,00
	09/2018	TWD 444	15	1	0	1	0,00
	09/2018	\$ 4.643	INR 315.444	0	(85)	(85)	(0,15)
	09/2018	5.762	KRW 6.193.874	0	(185)	(185)	(0,33)
SOG	09/2018	334	TWD 9.903	0	(8)	(8)	(0,01)
SSB	07/2018	1.102	€ 947	3	0	3	0,01
	08/2018	€ 947	\$ 1.105	0	(3)	(3)	(0,01)
	09/2018	SGD 41	30	1	0	1	0,00
	09/2018	\$ 741	IDR10.401.356	0	(23)	(23)	(0,04)
	09/2018	763	MYR 3.055	0	(9)	(9)	(0,01)
TOR	08/2018	MXN 57.500	\$ 2.851	0	(55)	(55)	(0,10)
UAG	08/2018	\$ 2.887	MXN 56.490	0	(38)	(38)	(0,07)
	09/2018	HKD 160	\$ 20	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 1.220	IDR17.378.036	0	(20)	(20)	(0,03)
	09/2018	20	MYR 78	0	0	0	0,00
	09/2018	287	PHP 15.266	0	(4)	(4)	(0,01)
	09/2018	2.896	THB 92.044	0	(112)	(112)	(0,20)
	04/2019	€ 400	\$ 504	26	0	26	0,05
				\$ 582	\$ (2.091)	\$ (1.509)	(2,65)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (1.502)	(2,64)
Summe Anlagen						\$ 55.143	96,96
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 1.730	3,04
Nettovermögen						\$ 56.873	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

## 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) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(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) Beschränkt übertragbare Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
JPMorgan Structured Products BV	0,000 %	30.08.2018	27.02.2018 - 28.02.2018	\$ 475	\$ 466	0,82
JPMorgan Structured Products BV	16,623	30.08.2018	30.01.2018	684	672	1,18
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.	4,150	06.03.2019	16.01.2018	201	200	0,35
				\$ 1.360	\$ 1.338	2,35

Barmittel in Höhe von USD 104 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 1.100 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(g) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
MBC	2,260 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 10.900	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 30.04.2025	\$ (11.247)	\$ 10.900	\$ 10.901	19,17
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	652	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.01.2022	(667)	652	652	1,14
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (11.914)</b>	<b>\$ 11.552</b>	<b>\$ 11.553</b>	<b>20,31</b>

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

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 5.661	\$ 50.902	\$ 0	\$ 56.563
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2	(1.422)	0	(1.420)
<b>Summen</b>	<b>\$ 5.663</b>	<b>\$ 49.480</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 55.143</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 4.283	\$ 39.185	\$ 174	\$ 43.642
Einlagen bei Kreditinstituten	0	300	0	300
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2	870	0	872
<b>Summen</b>	<b>\$ 4.285</b>	<b>\$ 40.355</b>	<b>\$ 174</b>	<b>\$ 44.814</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 2	\$ 0	\$ 2
BOA	(181)	0	(181)
BPS	17	0	17

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BRC	\$ 18	\$ 0	\$ 18
CBK	(140)	320	180
DUB	19	(10)	9
FBF	5	0	5
GLM	77	(20)	57
GST	1	0	1
HUS	(172)	0	(172)
IND	(5)	0	(5)
JPM	(132)	0	(132)
MSB	(425)	260	(165)
NGF	(55)	0	(55)
RBC	3	0	3
RYL	1	0	1
SCX	(294)	260	(34)
SOG	(8)	10	2
SSB	(31)	0	(31)
TOR	(55)	0	(55)
UAG	(147)	260	113

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	37,54	49,01
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	34,29	31,16
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	27,63	17,07
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,14	(0,09)
Freiverkehrsfinanzderivate	(2,64)	2,03
Einlagenzertifikate	0,00	0,67

**Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des  
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund**

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
Mexico Treasury Bills 0,000 % fällig am 16.08.2018	MXN	114.500	\$ 5.750	U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2046	\$	1.500
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 05.04.2018		\$ 4.100	4.095	Malaysia Treasury Bill 0,000 % fällig am 18.01.2019	MYR	4.700
Mexico Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.05.2018	MXN	69.300	3.537	Letras del Banco Central de Argentina 1,000 % fällig am 16.05.2018	ARS	16.517
Mexico Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.10.2018		59.000	3.240	Letras del Banco Central de Argentina 0,010 % fällig am 18.04.2018		15.290
Japan Treasury Bill 0,000 % fällig am 05.07.2018	JPY	330.000	3.071	Letras del Banco Central de la Republica Argentina 1,000 % fällig am 21.06.2018		14.908
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 18.05.2018	\$	3.000	3.000	Malaysia Treasury Bill 0,000 % fällig am 07.09.2018	MYR	1.900
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 17.05.2018		2.800	2.800	Lebac Interna 0,010 % fällig am 21.03.2018	ARS	9.600
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 25.06.2018		2.800	2.800	Malaysia Islamic Treasury Bill 0,000 % fällig am 19.09.2018	MYR	1.500
Federal Home Loan Bank 1,870 % fällig am 30.07.2018		2.800	2.795	Egypt Treasury Bills 11,659 % fällig am 09.10.2018	EGP	6.500
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 22.06.2018		2.600	2.600			
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 21.06.2018		2.300	2.300	<b>AKTIEN</b>		
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 30.04.2018		2.000	1.997	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		29.962
						300
<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>		191.554	1.918			
				Malaysia Islamic Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.11.2018	MYR	1.100
Federal Home Loan Bank 1,830 % fällig am 05.07.2018	\$	1.600	1.596	Spectra Energy Partners LP 3,018 % fällig am 05.06.2020	\$	250
Federal Home Loan Bank 1,854 % fällig am 13.07.2018		1.400	1.396			
Federal Home Loan Bank 1,916 % fällig am 17.08.2018		1.300	1.294	<b>AKTIEN</b>		
Malaysia Treasury Bill 0,000 % fällig am 18.01.2019	MYR	4.700	1.159	PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)		2.400
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 15.06.2018	\$	1.100	1.099			243
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,636 % fällig am 03.09.2019		1.000	999	Egypt Treasury Bills 0,000 % fällig am 25.09.2018	EGP	4.500
Letras del Banco Central de Argentina 1,000 % fällig am 16.05.2018	ARS	16.517	790	Argentina Government International Bond 40,000 % fällig am 21.06.2020	ARS	3.743
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 19.06.2018	\$	700	697	Sempra Energy 2,791 % fällig am 15.03.2021	\$	200
Letras del Banco Central de Argentina 0,000 % fällig am 18.04.2018		13.990	678	Dominican Republic International Bond 8,900 % fällig am 15.02.2023	DOP	8.200
Letras del Banco Central de la Republica Argentina 1,000 % fällig am 21.06.2018		14.908	666	Malaysia Treasury Bill 0,000 % fällig am 10.08.2018	MYR	600
JPMorgan Structured Products BV 16,623 % fällig am 30.08.2018	EGP	12.400	642	Nigeria Treasury Bills 13,750 % fällig am 06.12.2018	NGN	56.600
				Letras del Banco Central de la Republica Argentina 33,500 % fällig am 18.07.2018	ARS	3.987
				Egypt Treasury Bills 11,533 % fällig am 23.10.2018	EGP	2.675
				Malaysia Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.11.2018	MYR	500
				AT&T, Inc. 2,998 % fällig am 15.01.2020	\$	100
				Malaysia Government Investment Issue 3,872 % fällig am 30.08.2018	MYR	400

(a) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro 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
Bayer Capital Corp. BV 0,227 % fällig am 26.06.2022	€ 2.900	€ 2.912	0,20	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 2,375 % fällig am 24.06.2022	\$ 200	€ 164	0,01	Sprint Capital Corp. 6,900 % fällig am 01.05.2019	\$ 200	€ 175	0,01
Becton Dickinson and Co. 3,250 % fällig am 12.11.2020	\$ 100	85	0,01	Reynolds American, Inc. 6,875 % fällig am 01.05.2020	500	455	0,03	Sprint Communications, Inc. 7,000 % fällig am 15.08.2020	400	356	0,02
BMW U.S. Capital LLC 3,100 % fällig am 12.04.2021	300	255	0,02	Rockwell Collins, Inc. 2,800 % fällig am 15.03.2022	500	418	0,03	9,000 % fällig am 15.11.2018	1.300	1.137	0,08
Charter Communications Operating LLC 4,464 % fällig am 23.07.2022	300	260	0,02	Ryder System, Inc. 2,650 % fällig am 02.03.2020	100	85	0,01	Telstra Corp. Ltd. 4,800 % fällig am 12.10.2021	200	177	0,01
CNH Industrial Capital LLC 4,375 % fällig am 06.11.2020	100	87	0,01	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625 % fällig am 01.02.2021	300	269	0,02			5.678	0,38
4,875 % fällig am 01.04.2021	600	529	0,03	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 1,900 % fällig am 23.09.2019	2.300	1.940	0,13	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		455.133	30,74
CSC Holdings LLC 7,625 % fällig am 15.07.2018	100	86	0,01	Solvay Finance America LLC 3,400 % fällig am 03.12.2020	200	172	0,01				
CVS Health Corp. 2,957 % fällig am 09.03.2020	1.600	1.376	0,09	Southern Co. 2,350 % fällig am 01.07.2021	3.626	3.010	0,20	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
3,047 % fällig am 09.03.2021	1.000	861	0,06	Sunoco Logistics Partners Operations LP 5,500 % fällig am 15.02.2020	100	88	0,01	<b>Fannie Mae</b>			
Daimler Finance North America LLC 2,200 % fällig am 30.10.2021	150	123	0,01	Syngenta Finance NV 3,698 % fällig am 24.04.2020	400	342	0,02	2,151 % fällig am 25.07.2037	17	14	0,00
3,350 % fällig am 04.05.2021	300	256	0,02	Telefonica Emisiones S.A.U. 5,134 % fällig am 27.04.2020	1.200	1.026	0,07	2,491 % fällig am 25.06.2036	104	89	0,01
Daimler International Finance BV 0,274 % fällig am 13.11.2019	€ 1.800	1.812	0,12	Tesco PLC 6,125 % fällig am 24.02.2022	€ 149	192	0,01	2,541 % fällig am 25.01.2044	574	495	0,03
Danone S.A. 1,691 % fällig am 30.10.2019	\$ 200	168	0,01	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 3,650 % fällig am 10.11.2021	\$ 300	246	0,01	4,500 % fällig am 01.10.2029 - 01.08.2041	2.539	2.282	0,16
Dell International LLC 4,420 % fällig am 15.06.2021	300	261	0,02	Teva Pharmaceutical Finance LLC 2,250 % fällig am 18.03.2020	600	496	0,03	<b>Fannie Mae, TBA</b>	20.400	16.915	1,14
Delta Air Lines, Inc. 2,600 % fällig am 04.12.2020	500	419	0,03	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 3,250 % fällig am 15.04.2022	€ 3.500	3.560	0,24	3,500 % fällig am 17.07.2033 - 13.08.2048	72.000	61.347	4,14
2,600 % fällig am 15.03.2022	500	424	0,03	Time Warner Cable LLC 4,000 % fällig am 01.09.2021	\$ 500	429	0,03	<b>Freddie Mac</b>			
Deutsche Telekom International Finance BV 1,950 % fällig am 19.09.2021	700	572	0,04	United Technologies Corp. 0,000 % fällig am 18.05.2020	€ 6.750	6.767	0,46	1,398 % fällig am 15.01.2038 (a)	1.739	63	0,01
2,225 % fällig am 17.01.2020	700	591	0,04	Virgin Media Secured Finance PLC 4,875 % fällig am 15.01.2027	€ 2.000	2.206	0,15	2,257 % fällig am 15.01.2038	1.739	1.489	0,10
DISH DBS Corp. 7,875 % fällig am 01.09.2019	300	267	0,02	Volkswagen Group of America Finance LLC 2,450 % fällig am 20.11.2019	\$ 1.680	1.423	0,09	3,500 % fällig am 01.10.2047	10.102	8.615	0,58
EMC Corp. 2,650 % fällig am 01.06.2020	600	499	0,03	Volkswagen International Finance NV 0,026 % fällig am 30.03.2019	€ 3.100	3.103	0,21	3,623 % fällig am 01.09.2037	3.283	2.967	0,20
EMD Finance LLC 2,400 % fällig am 19.03.2020	100	85	0,01	Vulcan Materials Co. 2,950 % fällig am 01.03.2021	\$ 200	172	0,01	<b>Ginnie Mae</b>	1.530	1.312	0,09
Energy Transfer Partners LP 4,150 % fällig am 01.10.2020	300	260	0,02	Wind Tre SpA 3,125 % fällig am 20.01.2025	€ 3.600	2.930	0,20	2,367 % fällig am 20.08.2066		95.588	6,46
ERAC USA Finance LLC 2,350 % fällig am 15.10.2019	600	508	0,03	ZF North America Capital, Inc. 4,500 % fällig am 29.04.2022	\$ 400	349	0,02	<b>US-SCHATZobligationen</b>			
Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc. 4,125 % fällig am 15.10.2020	100	87	0,01	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 1,414 % fällig am 13.12.2022	€ 3.100	3.175	0,21	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (g)</b>			
Holcim U.S. Finance S.A. & Cie SCS 6,000 % fällig am 30.12.2019	300	266	0,02	3,150 % fällig am 01.04.2022	\$ 3.100	2.609	0,17	1,750 % fällig am 15.01.2028	35.993	33.702	2,28
Hyundai Capital America 2,400 % fällig am 30.10.2018	1.400	1.197	0,08	3,550 % fällig am 01.04.2025	200	163	0,01	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (d)	€ 3.800	3.876	0,26	<b>VERSÖRGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>Adjustable Rate Mortgage Trust</b>			
Imperial Brands Finance PLC 2,950 % fällig am 21.07.2020	\$ 700	594	0,04	<b>BP Capital Markets PLC</b> 2,518 % fällig am 16.01.2020	1.100	934	0,06	3,369 % fällig am 25.01.2036 ^	35	29	0,00
IQVIA, Inc. 2,875 % fällig am 15.09.2025	€ 2.100	1.967	0,13	<b>Chugoku Electric Power Co., Inc.</b> 2,701 % fällig am 16.03.2020	200	170	0,01	<b>Aggregator of Loans Backed by Assets PLC</b> 1,748 % fällig am 24.04.2049	€ 2.567	2.925	0,20
3,250 % fällig am 15.03.2025	800	779	0,05	<b>Duke Energy Corp.</b> 3,050 % fällig am 15.08.2022	300	253	0,02	<b>Alba PLC</b> 0,801 % fällig am 25.11.2042	479	521	0,03
Komatsu Finance America, Inc. 2,118 % fällig am 11.09.2020	\$ 200	167	0,01	<b>E.ON International Finance BV</b> 6,000 % fällig am 30.10.2019	€ 500	600	0,04	<b>American Home Mortgage Investment Trust</b> 3,998 % fällig am 25.09.2045	\$ 38	33	0,00
Kraft Heinz Foods Co. 2,800 % fällig am 02.07.2020	400	340	0,02	<b>Electricite de France S.A.</b> 4,600 % fällig am 27.01.2020	\$ 400	350	0,02	<b>Auburn Securities PLC</b> 1,625 % fällig am 18.08.2047	€ 1.286	1.455	0,10
MGM Resorts International 6,750 % fällig am 01.10.2020	500	450	0,03	<b>Ohio Power Co.</b> 5,375 % fällig am 01.10.2021	500	456	0,03	<b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b> 3,520 % fällig am 25.10.2035	\$ 116	101	0,01
Mylan NV 3,150 % fällig am 15.06.2021	500	424	0,03	<b>Petrobras Global Finance BV</b> 5,999 % fällig am 27.01.2028	224	174	0,01	3,814 % fällig am 25.07.2036	597	377	0,03
Newcrest Finance Pty. Ltd. 4,450 % fällig am 15.11.2021	100	87	0,01	<b>Plains All American Pipeline LP</b> 5,750 % fällig am 15.01.2020	100	88	0,01	4,004 % fällig am 25.07.2033	15	13	0,00
Penske Truck Leasing Co. LP 3,200 % fällig am 15.07.2020	300	256	0,02					4,430 % fällig am 25.08.2035 ^	447	368	0,02
Pernod Ricard S.A. 4,450 % fällig am 15.01.2022	200	176	0,01					<b>Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust</b> 3,104 % fällig am 26.12.2046 ^	141	111	0,01
5,750 % fällig am 07.04.2021	600	545	0,04					<b>Bluestep Mortgage Securities DAC</b> 0,392 % fällig am 10.08.2066	€ 2.442	2.456	0,17
Philip Morris International, Inc. 2,500 % fällig am 02.11.2022	300	247	0,02					1,136 % fällig am 10.05.2063	SEK 9.980	964	0,06
Pioneer Natural Resources Co. 7,500 % fällig am 15.01.2020	100	91	0,01					<b>Business Mortgage Finance PLC</b> 0,053 % fällig am 15.08.2040	€ 809	804	0,05
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. 6,750 % fällig am 30.09.2019	1.200	1.068	0,07					1,020 % fällig am 15.02.2039	€ 34	38	0,00



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro 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>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>			
SLM Student Loan Trust	€ 800	€ 783	0,05	Japan Bank for International Cooperation	\$ 2.600	€ 2.151	0,15	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
0,072 % fällig am 25.10.2039				2,000 % fällig am 04.11.2021				PIMCO Specialty			
Sorrento Park CLO DAC				Japan Finance Organization for Municipalities				Funds Ireland p.l.c. -			
0,624 % fällig am 16.11.2027	3.300	3.300	0,22	2,125 % fällig am 13.04.2021	5.200	4.328	0,29	PIMCO China			
Sunrise SPV SRL				Lithuania Government International Bond				Bond Fund (i)	54.626	€ 533	0,04
0,029 % fällig am 27.11.2041	1.300	1.303	0,09	6,125 % fällig am 09.03.2021	7.300	6.697	0,45	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
Venture CLO Ltd.				Mexico Government International Bond				PIMCO Fixed Income			
3,718 % fällig am 15.01.2027	\$ 6.500	5.568	0,38	2,750 % fällig am 22.04.2023	€ 100	108	0,01	Source ETFs plc -			
		151.624	10,24	Niederlande Financierings Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV	0,125 % fällig am 04.11.2020	2.329	0,16	PIMCO Euro Short			
				Poland Government International Bond				Maturity Source			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				4,000 % fällig am 25.10.2023	PLN 200	49	0,00	UCITS ETF (i)	1.492.990	150.338	10,15
Auckland Council				Province of Ontario							
1,000 % fällig am 19.01.2027	€ 1.300	1.321	0,09	2,500 % fällig am 10.09.2021	\$ 5.000	4.214	0,28				
Autonomous Community of Catalonia				S.A. de Gestion de Stocks de Securite							
4,220 % fällig am 26.04.2035	1.000	1.062	0,07	1,750 % fällig am 22.10.2019	€ 1.000	1.027	0,07	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
4,900 % fällig am 15.09.2021	1.000	1.087	0,07	Saudi Government International Bond				<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
4,950 % fällig am 11.02.2020	15.920	16.850	1,14	3,250 % fällig am 26.10.2026	\$ 1.200	965	0,06	Syngenta Finance NV			
Autonomous Community of Valencia				Slovenia Government International Bond				0,000 % fällig am			
4,900 % fällig am 17.03.2020	600	647	0,04	1,000 % fällig am 06.03.2028	€ 12.200	12.236	0,83	30.07.2018	€ 7.200	7.203	0,49
Belgium Government International Bond				4,125 % fällig am 18.02.2019	\$ 17.300	14.937	1,01	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (k)</b>			
2,150 % fällig am 22.06.2066	4.500	4.900	0,33	5,250 % fällig am 18.02.2024	19.251	17.951	1,21			18.931	1,28
Bpifrance Financement S.A.				Spain Government International Bond				<b>ITALY TREASURY BILLS</b>			
1,000 % fällig am 25.10.2019	22.300	22.707	1,53	0,750 % fällig am 30.07.2021	€ 2.600	2.665	0,18	(0,306)% fällig am			
Cyprus Government International Bond				1,300 % fällig am 31.10.2026	6.400	6.510	0,44	28.09.2018 (e)(f)	9.070	9.073	0,61
2,750 % fällig am 27.06.2024	8.477	8.920	0,60	1,450 % fällig am 31.10.2027	40.300	41.018	2,77	<b>SPAIN TREASURY BILLS</b>			
3,750 % fällig am 26.07.2023	2.200	2.425	0,16	1,500 % fällig am 30.04.2027	17.800	18.263	1,23	(0,459)% fällig am			
3,875 % fällig am 06.05.2022	4.200	4.614	0,31	1,950 % fällig am 30.04.2026	28.300	30.302	2,05	12.10.2018 (e)(f)	22.300	22.329	1,51
4,250 % fällig am 04.11.2025	900	1.028	0,07	2,150 % fällig am 31.10.2025	18.400	20.024	1,35	Summe kurzfristige Instrumente		57.536	3,89
Development Bank of Japan, Inc.				3,450 % fällig am 30.07.2066	6.000	7.064	0,48	Summe Übertragbare Wertpapiere			
1,625 % fällig am 01.09.2021	\$ 4.500	3.678	0,25	3,800 % fällig am 30.04.2024	250	296	0,02	und Geldmarktinstrumente -			
France Government International Bond				4,000 % fällig am 30.04.2020	40.200	43.312	2,93	Ämliche Börse/Geregelter Markt		€ 1.520.112	102,67
1,750 % fällig am 25.05.2066	€ 4.500	4.544	0,31	Tokyo Metropolitan Government							
2,000 % fällig am 25.05.2048	7.100	7.885	0,53	2,000 % fällig am 17.05.2021	\$ 2.600	2.152	0,15				
2,500 % fällig am 25.10.2020	8.400	8.995	0,61			474.595	32,05				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro											
0,050 % fällig am 15.10.2019	119.275	118.604	8,01								
1,500 % fällig am 01.08.2019	26.400	26.730	1,81								

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
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 160,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	109	€ (253)	(0,02)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 162,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	113	(40)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 166,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	101	(6)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 99,500 EUR auf Euribor 3-Year Mid Curve December 2018 Futures	Short	12/2018	3.086	(640)	(0,04)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 99,875 EUR auf Euribor 2-Year Mid Curve September 2018 Futures	Short	09/2018	275	(16)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09/2018	3.360	1.300	0,09
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09/2018	676	1.795	0,12
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	354	524	0,04
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	601	2.744	0,19
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	890	2.169	0,15
Euro-Schatz September Futures	Long	09/2018	153	14	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	66	(118)	(0,01)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 125,000 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Long	08/2018	554	0	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 131,250 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Short	08/2018	270	47	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 131,500 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Short	08/2018	275	53	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 155,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	202	(6)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 98,500 EUR auf Euribor 3-Year Mid Curve December 2018 Futures	Short	12/2018	3.086	93	0,01
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 98,750 EUR auf Euribor 3-Year Mid Curve December 2018 Futures	Long	12/2018	3.086	(234)	(0,02)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 99,125 EUR auf Euribor 2-Year Mid Curve December 2018 Futures	Long	12/2018	1.066	(201)	(0,01)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 99,250 EUR auf Euribor 2-Year Mid Curve December 2018 Futures	Short	09/2018	1.494	111	0,01
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 99,375 EUR auf Euribor 2-Year Mid Curve September 2018 Futures	Long	09/2018	354	(49)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 99,500 EUR auf Euribor 2-Year Mid Curve September 2018 Futures	Long	09/2018	1.494	(235)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2018	193	(75)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	112	(541)	(0,04)
				€ 6.436	0,44

**VERKAUFSOPTIONEN****OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CME 90-Day Eurodollar December 2018 Futures	\$ 96,875	14.12.2018	1.027	€ (216)	€ (286)	(0,02)
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>					<b>€ 6.150</b>	<b>0,42</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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.12.2022	\$ 2.300	€ (3)	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.06.2021	€ 2.200	8	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.06.2023	8.000	34	0,00
				<b>€ 39</b>	<b>0,00</b>

**ZINSSWAPS**

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,000 %	20.06.2023	\$ 67.500	€ 322	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,250	20.06.2028	22.900	(18)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,500	20.06.2048	8.900	48	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,000	19.12.2023	ZAR 500.400	62	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,500	19.09.2023	€ 35.700	497	0,03
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		1,750	15.03.2028	72.350	971	0,07
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR		1,500	19.12.2048	£ 15.800	535	0,04
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		2,000	15.03.2028	57.600	(473)	(0,03)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR		1,500	21.12.2045	¥ 183.500	(422)	(0,03)
						<b>€ 1.522</b>	<b>0,11</b>
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>€ 1.561</b>	<b>0,11</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

**FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* 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	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,500 %	07.11.2019	\$ 4.700	€ 365	€ 494	0,03
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,750	07.11.2019	5.000	411	373	0,02
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,725	07.11.2019	7.500	666	580	0,04
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,750	07.11.2019	7.500	624	559	0,04
							<b>€ 2.066</b>	<b>€ 2.006</b>	<b>0,13</b>

**VERKAUFSOPTIONEN****CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES**

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800 %	19.09.2018	€ 72.200	€ (145)	€ (233)	(0,02)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

## DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,315	14.06.2019	£ 5.452	€ (149)	€ (143)	(0,01)
	Call - OTC GBP versus USD	1,440	14.06.2019	5.442	(68)	(52)	0,00
GLM	Call - OTC USD versus BRL	BRL 3,892	02.07.2018	\$ 5.000	(438)	(5)	0,00
	Put - OTC USD versus BRL	3,892	02.07.2018	5.000	(438)	(52)	0,00
SOG	Call - OTC USD versus TRY	TRY 5,150	20.05.2019	8.800	(530)	(518)	(0,04)
	Put - OTC USD versus TRY	5,150	20.05.2019	8.800	(503)	(393)	(0,03)
					€ (2.126)	€ (1.163)	(0,08)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,250 %	07.11.2019	\$ 23.900	€ (375)	€ (760)	(0,05)
			Zahlung	2,500	07.11.2019	24.800	(408)	(600)	(0,04)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,500	07.11.2019	74.600	(1.283)	(1.805)	(0,12)
							€ (2.066)	€ (3.165)	(0,21)

## ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	10-Year EUR-EURIBOR - 2-Year EUR-EURIBOR	1,250 %	16.11.2018	10.000	€ (5)	€ (2)	0,00
DUB	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	10-Year EUR-EURIBOR - 2-Year EUR-EURIBOR	1,250	16.11.2018	43.000	(21)	(6)	0,00
GST	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	10-Year EUR-EURIBOR - 2-Year EUR-EURIBOR	1,250	05.11.2018	100.000	(35)	(13)	0,00
						€ (61)	€ (21)	0,00

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

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	\$ 8.100	20.09.2018	€ 0	€ (13)	€ (13)	0,00
JPM	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	39.400	20.09.2018	31	67	98	0,01
MYC	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	8.300	20.12.2018	1	2	3	0,00
MYI	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	6.000	20.09.2018	5	20	25	0,00
							€ 37	€ 76	€ 113	0,01

## DEVIENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	08/2018	AUD 168	€ 105	€ 0	€ (1)	€ (1)	0,00
BOA	07/2018	BRL 20.923	\$ 5.534	82	0	82	0,01
	07/2018	DKK 31.800	€ 4.280	12	0	12	0,00
	07/2018	\$ 15.048	€ 12.819	0	(69)	(69)	0,00
	08/2018	CAD 180	€ 117	0	0	0	0,00
	08/2018	€ 865	€ 761	0	(5)	(5)	0,00
	08/2018	£ 4.231	€ 4.815	36	0	36	0,00
	08/2018	SEK 641.273	€ 61.763	364	0	364	0,03
	08/2018	\$ 5.518	BRL 20.923	0	(85)	(85)	(0,01)
	08/2018	536	RUB 33.492	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	ZAR 5.965	\$ 453	17	0	17	0,00
BPS	07/2018	€ 4.855	€ 5.720	44	0	44	0,00
	07/2018	TRY 10.002	€ 2.077	0	(77)	(77)	(0,01)
	07/2018	\$ 1.832	€ 1.377	0	(12)	(12)	0,00
	08/2018	2.580	BRL 9.814	0	(33)	(33)	0,00
	08/2018	ZAR 6.612	\$ 526	39	0	39	0,00
	09/2018	\$ 18	IDR 255.947	0	0	0	0,00
BRC	07/2018	10.968	€ 9.368	10	(36)	(26)	0,00
CBK	07/2018	DKK 218.637	€ 29.359	15	0	15	0,00
	07/2018	€ 836	DKK 6.230	0	0	0	0,00
	07/2018	£ 1.237	\$ 1.666	28	0	28	0,00
	07/2018	PLN 435	€ 128	10	0	10	0,00
	07/2018	\$ 4.442	€ 3.372	9	0	9	0,00
	08/2018	MXN 66.840	\$ 3.204	0	(142)	(142)	(0,01)
	08/2018	\$ 8.221	MXN 160.474	0	(110)	(110)	(0,01)
	08/2018	11.845	RUB 736.910	0	(135)	(135)	(0,01)
	09/2018	CNY 86.711	\$ 13.169	114	0	114	0,01
	06/2019	£ 1.917	€ 2.569	0	(4)	(4)	0,00
DUB	07/2018	BRL 14.782	€ 3.800	0	(36)	(36)	0,00
	07/2018	\$ 3.837	BRL 14.782	4	0	4	0,00
	08/2018	BRL 14.669	\$ 3.800	1	0	1	0,00
	04/2019	SEK 6.993	€ 679	10	0	10	0,00
FBF	07/2018	\$ 8.702	COP 25.047.084	0	(153)	(153)	(0,01)
	04/2019	€ 597	SEK 6.123	0	(11)	(11)	0,00
GLM	07/2018	BRL 7.896	\$ 2.126	63	0	63	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07/2018	DKK 35.575	€ 4.774	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	07/2018	€ 4.774	DKK 35.575	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 1.769	BRL 6.560	0	(55)	(55)	0,00
	07/2018	2.410	€ 2.070	5	0	5	0,00
HUS	07/2018	DKK 1.883	254	1	0	1	0,00
	07/2018	TRY 14.194	\$ 3.071	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	\$ 1.595	RUB 99.706	0	(12)	(12)	0,00
	09/2018	12.771	CNY 81.992	0	(379)	(379)	(0,03)
JPM	07/2018	COP 230.485	\$ 9.246	565	0	565	0,04
	07/2018	\$ 13.026	€ 11.118	0	(38)	(38)	0,00
	08/2018	ZAR 11.181	\$ 857	39	0	39	0,00
MSB	07/2018	\$ 6.057	BRL 22.259	0	(233)	(233)	(0,02)
	07/2018	2.604	€ 2.248	18	0	18	0,00
RYL	07/2018	€ 215	\$ 250	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	79	£ 70	0	0	0	0,00
	08/2018	6.963	NOK 66.745	41	0	41	0,00
	08/2018	\$ 161	ZAR 2.005	0	(13)	(13)	0,00
SCX	07/2018	384.414	€ 331.835	2.586	0	2.586	0,18
	08/2018	CHF 7.430	6.217	0	(195)	(195)	(0,01)
	08/2018	€ 1.295	£ 1.140	0	(8)	(8)	0,00
	08/2018	£ 53.385	€ 60.793	501	0	501	0,03
	08/2018	¥ 307.800	2.346	0	(34)	(34)	0,00
	08/2018	\$ 7.712	TRY 34.444	0	(282)	(282)	(0,02)
SOG	07/2018	€ 4.288	DKK 31.847	0	(14)	(14)	0,00
	05/2019	\$ 528	TRY 2.724	0	(7)	(7)	0,00
SSB	07/2018	€ 364.389	\$ 424.185	0	(1.077)	(1.077)	(0,07)
	08/2018	\$ 425.126	€ 364.389	1.060	0	1.060	0,07
	09/2018	247	IDR 3.466.150	0	(7)	(7)	0,00
UAG	07/2018	€ 28.645	DKK 213.185	0	(32)	(32)	0,00
	07/2018	\$ 4.422	COP 12.633.654	0	(105)	(105)	(0,01)
	08/2018	150	ZAR 2.026	0	(2)	(2)	0,00
				€ 5.674	€ (3.411)	€ 2.263	0,15

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class 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	07/2018	€ 1.874	CHF 2.167	€ 0	€ (5)	€ (5)	0,00
BPS	07/2018	2.092	2.402	0	(19)	(19)	0,00
JPM	07/2018	2.092	2.402	0	(20)	(20)	0,00
RYL	07/2018	CHF 2.416	€ 2.092	8	0	8	0,00
	08/2018	€ 2.093	CHF 2.416	0	(8)	(8)	0,00
SSB	07/2018	197	227	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 8	€ (53)	€ (45)	0,00
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						€ (245)	(0,02)
<b>Summe Anlagen</b>						€ 1.527.578	103,18
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						€ (47.008)	(3,18)
<b>Nettovermögen</b>						€ 1.480.570	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.

- Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.
- Reines Kapitalwertpapier.
- Wertpapier per Emissionstermin.
- Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- Mit dem Fonds verbunden.
- Bedingt wandelbares Wertpapier.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

Barmittel in Höhe von EUR 27.065 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von EUR 3.840 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettvermögens
BPS	(0,650) %	29.06.2018	02.07.2018	€ 18.600	Kingdom of Belgium Government International Bond 1,000 % fällig am 22.06.2031	€ (18.757)	€ 18.600	€ 18.599	1,26
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	\$ 387	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	(339)	331	331	0,02
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>€ (19.096)</b>	<b>€ 18.931</b>	<b>€ 18.930</b>	<b>1,28</b>

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

## Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	€ 533	€ 1.519.579	€ 0	€ 1.520.112
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	6.150	1.316	0	7.466
<b>Summen</b>	<b>€ 6.683</b>	<b>€ 1.520.895</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 1.527.578</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	€ 124.115	€ 1.167.174	€ 116	€ 1.291.405
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(6.341)	(246)	(2)	(6.589)
Leerverkäufe	0	(4.410)	0	(4.410)
<b>Summen</b>	<b>€ 117.774</b>	<b>€ 1.162.518</b>	<b>€ 114</b>	<b>€ 1.280.406</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	€ (1)	€ 0	€ (1)
BOA	343	0	343
BPS	(60)	0	(60)
BRC	(26)	0	(26)
CBK	(410)	820	410
CKL	(233)	0	(233)
DUB	(520)	380	(140)
FBF	(164)	0	(164)
GLM	(44)	130	86
GST	(26)	0	(26)
HUS	(394)	320	(74)
JPM	644	(707)	(63)
MSB	(215)	290	75
MYC	(663)	410	(253)
MYI	25	0	25
RYL	27	(70)	(43)
SCX	2.568	0	2.568
SOG	(932)	970	38
SSB	(25)	0	(25)
UAG	(139)	170	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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,53	85,21
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	14,92	13,76
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	3,22	3,13
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,42	(0,50)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,11	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,02)	(0,03)
Leerverkaufte Wertpapiere	0,00	(0,35)



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund

30. Juni 2018

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>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE</b>				<b>AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>							
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
<b>Avolon Holdings Ltd.</b>											
3,898 % - 3,838 % fällig am 30.09.2020	\$	99	0,01	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	€	8.100	1,18	London Stock Exchange Group PLC	€	100	0,01
4,088 % fällig am 15.01.2025		199	0,02	Deutsche Bank AG	£	800	0,13	1,750 % fällig am 19.09.2024	€	200	0,03
Charter Communications Operating LLC				1,875 % fällig am 28.02.2020				Merlin Properties Socimi S.A.			
4,100 % fällig am 30.04.2025		3.454	0,42	4,250 % fällig am 14.10.2021	\$	6.100	0,74	1,750 % fällig am 26.05.2025		2.800	0,40
Dell, Inc.				1,875 % fällig am 15.09.2021				2,225 % fällig am 25.04.2023		1.200	0,18
4,100 % fällig am 07.09.2023		1.185	0,15	2,375 % fällig am 20.09.2022		300	0,04	Metropolitan Life Global Funding		5.700	0,85
Hilton Worldwide Finance LLC				Digital Euro Finco LLC	€	2.600	0,40	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$	1.600	0,19
3,841 % fällig am 25.10.2023		3.552	0,44	2,625 % fällig am 15.04.2024		6.500	0,94	2,190 % fällig am 13.09.2021		3.400	0,50
Ineos U.S. Finance LLC	€	3.483	0,50	DNB Boligkredit A/S		6.540	0,94	1,000 % fällig am 02.12.2022	€	3.400	0,50
2,500 % fällig am 31.03.2024				0,625 % fällig am 19.06.2025				1,342 % fällig am 23.10.2026		6.300	0,89
Numericable Group S.A.				Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust	\$	693	0,09	2,625 % fällig am 17.11.2021	\$	3.900	0,47
3,000 % fällig am 31.07.2025		990	0,14	Equinix, Inc.	€	1.900	0,27	3,292 % fällig am 22.07.2022		200	0,02
3,000 % fällig am 31.01.2026		3.483	0,49	2,875 % fällig am 15.03.2024		300	0,04	3,875 % fällig am 29.04.2024		1.400	0,17
		15.097	2,17	2,875 % fällig am 01.02.2026		4.000	0,57	National Australia Bank Ltd.	€	6.700	0,96
				Fairfax Financial Holdings Ltd.				0,350 % fällig am 07.09.2022	€	6.700	0,96
				2,750 % fällig am 29.03.2028				Nationwide Building Society		1.300	0,18
				Fastighets AB Balder				1,500 % fällig am 08.03.2026		300	0,05
				1,125 % fällig am 14.03.2022		1.900	0,28	6,750 % fällig am 22.07.2020		900	0,13
				FCE Bank PLC				Natwest Markets PLC			
				0,869 % fällig am 13.09.2021		2.100	0,30	0,079 % fällig am 02.03.2020			
				1,875 % fällig am 24.06.2021		1.400	0,21	Nordea Hypotek AB			
				Ford Motor Credit Co. LLC	\$	2.600	0,32	2,250 % fällig am 19.06.2019	SEK	37.000	0,52
				4,625 % fällig am 30.10.2020				Nordea Kredit Realkreditaktieselskab		126	0,00
				AIB Group PLC	€	1.500	0,21	2,500 % fällig am 01.10.2047	DKK		
				1,500 % fällig am 29.03.2023				Nykredit Realkredit A/S		1.955	0,27
				Akellus Residential Property AB				2,500 % fällig am 01.10.2037		27	0,00
				1,500 % fällig am 23.01.2022		2.300	0,34	2,500 % fällig am 01.10.2047			
				3,375 % fällig am 23.09.2020		2.100	0,32	Prologis International Funding S.A.		2.700	0,40
				Altarea S.C.A.				1,876 % fällig am 17.04.2025	€		
				2,250 % fällig am 05.07.2024		200	0,03	QNB Finance Ltd.	\$	4.400	0,54
				Altareit S.C.A.				3,713 % fällig am 07.02.2020		3.500	0,43
				2,875 % fällig am 02.07.2025 (a)		2.900	0,41	RCI Banque S.A.	€	4.800	0,70
				American International Group, Inc.				1,625 % fällig am 11.04.2025			
				1,500 % fällig am 08.06.2023		3.200	0,47	Realkredit Danmark A/S		1.477	0,21
				American Tower Corp.				2,500 % fällig am 01.10.2037	DKK	87	0,00
				1,375 % fällig am 04.04.2025		900	0,13	2,500 % fällig am 01.07.2047			
				1,950 % fällig am 22.05.2026		500	0,07	Reliance Standard Life Global Funding		300	0,04
				3,500 % fällig am 31.01.2023		400	0,05	2,500 % fällig am 24.04.2019	\$		
				5,050 % fällig am 01.09.2020		300	0,04	Royal Bank of Scotland Group PLC	€	4.700	0,70
				Aroundtown S.A.	€	6.400	0,92	2,000 % fällig am 08.03.2023		1.700	0,26
				1,500 % fällig am 15.07.2024		100	0,01	2,500 % fällig am 22.03.2023		500	0,06
				1,625 % fällig am 31.01.2028		2.500	0,38	4,800 % fällig am 05.04.2026	\$		
				2,125 % fällig am 13.03.2023				Sampo Oyj	€	2.400	0,35
				Atrium European Real Estate Ltd.				Santander UK Group Holdings PLC		4.400	0,63
				3,625 % fällig am 17.10.2022		400	0,06	0,454 % fällig am 18.05.2023		2.500	0,36
				4,000 % fällig am 20.04.2020		4.300	0,66	0,526 % fällig am 27.03.2024		10.400	1,24
				Bank of America Corp.				2,875 % fällig am 05.08.2021	\$		
				2,625 % fällig am 19.04.2021		5.200	0,63	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.	€	1.500	0,22
				4,100 % fällig am 24.07.2023		1.100	0,14	3,080 % fällig am 07.03.2019			
				Bank of Nova Scotia				Scentre Group Trust		200	0,03
				1,875 % fällig am 26.04.2021		1.800	0,21	1,375 % fällig am 22.03.2023			
				Barclays Bank PLC				SELP Finance SARL		5.000	0,72
				10,000 % fällig am 21.05.2021	£	1.400	0,27	1,250 % fällig am 25.10.2023			
				Barclays PLC				Skandinaviska Enskilda Banken AB	SEK	36.000	0,51
				2,375 % fällig am 06.10.2023		3.000	0,48	3,000 % fällig am 19.06.2019			
				3,125 % fällig am 17.01.2024		6.600	1,07	Stadshypotek AB		36.000	0,51
				Bevco Lux SARL	€	1.700	0,24	2,500 % fällig am 18.09.2019			
				1,750 % fällig am 09.02.2023				Sveriges Sakerställda Obligationer AB		35.000	0,51
				BNP Paribas Cardif S.A.				Swedbank Hypotek AB		36.000	0,52
				1,000 % fällig am 29.11.2024		1.000	0,14	3,750 % fällig am 19.06.2019			
				BNP Paribas S.A.				TLG Immobilien AG	€	800	0,11
				1,000 % fällig am 27.06.2024		9.629	1,38	Toronto-Dominion Bank	\$	2.800	0,34
				1,125 % fällig am 22.11.2023		1.600	0,23	2,250 % fällig am 15.03.2021			
				BPCE S.A.	\$	10.500	1,25	UBS AG			
				3,000 % fällig am 22.05.2022				0,171 % fällig am 10.01.2020	€	3.500	0,51
				Cooperative Rabobank UA				2,450 % fällig am 01.12.2020	\$	1.200	0,14
				2,500 % fällig am 19.01.2021		4.750	0,57	2,780 % fällig am 01.12.2020		2.400	0,30
				3,875 % fällig am 08.02.2022		750	0,09	4,750 % fällig am 12.02.2026 (e)	€	1.900	0,29
				6,875 % fällig am 19.03.2020 (e)	€	5.400	0,86	7,625 % fällig am 17.08.2022 (e)	\$	3.000	0,41
				CPI Property Group S.A.							
				2,125 % fällig am 04.10.2024		2.000	0,28				
				Credit Suisse Group AG							
				1,250 % fällig am 17.07.2025		2.200	0,31				





# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09/2018	525	€ 63	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09/2018	159	(140)	(0,02)
				€ 1.988	0,28
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>€ 1.988</b>	<b>0,28</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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000 %	20.12.2022	\$ 1.000	€ 0	0,00
BT Group	1,000	20.06.2023	€ 2.000	1	0,00
Carrefour	1,000	20.06.2023	5.000	(4)	0,00
Daimler AG	1,000	20.12.2020	900	0	0,00
Electricite De France SA	1,000	20.12.2022	1.400	(13)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2022	\$ 900	(15)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2021	300	(3)	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2022	€ 1.900	11	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	400	(4)	0,00
Schaeffler Finance BV	5,000	20.06.2022	1.400	(66)	(0,01)
Schaeffler Finance BV	5,000	20.06.2023	1.500	(39)	(0,01)
Shell International Finance BV	1,000	20.12.2026	400	20	0,00
Telefonica Emisiones S.A.U.	1,000	20.12.2022	7.300	(88)	(0,01)
Telefonica Emisiones S.A.U.	1,000	20.06.2023	2.100	(34)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	1.800	1	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2023	3.600	(72)	(0,01)
				€ (305)	(0,04)

## 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-30 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 50.600	€ (29)	(0,01)

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000 %	20.06.2023	\$ 7.200	€ (1)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	30.600	(80)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027	8.200	113	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	11.600	(141)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	7.400	434	0,06
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	£ 12.200	(104)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	6.000	(25)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	2.200	19	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	¥ 1.580.000	(61)	(0,01)
					€ 154	0,02
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>€ (180)</b>	<b>(0,03)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

## VERKAUFSOPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	15.08.2018	€ 12.400	€ (23)	€ (15)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	1,000	15.08.2018	3.300	(5)	(2)	0,00
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	3.400	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.08.2018	3.400	(5)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	3.500	(6)	(11)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	10.600	(21)	(23)	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.08.2018	3.300	(5)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	9.900	(23)	(32)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	13.500	(23)	(29)	(0,01)
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	10.500	(20)	(19)	0,00
GST	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	3.400	(9)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	6.900	(14)	(12)	0,00
						€ (161)	€ (160)	(0,02)

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	Mexico Government International Bond	0,000 %	20.06.2023	\$ 500	€ (5)	€ (1)	€ (6)	0,00	
BPS	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	€ 200	2	(2)	0	0,00	
BRC	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	400	3	(3)	0	0,00	
CBK	Heathrow Funding Ltd.	1,000	20.06.2021	1.000	3	12	15	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	\$ 700	(6)	(3)	(9)	0,00	
GST	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	€ 2.300	11	(8)	3	0,00	
	Heathrow Funding Ltd.	1,000	20.06.2021	800	4	8	12	0,00	
	Intesa Sanpaolo	1,000	20.06.2022	1.000	(51)	(30)	(81)	(0,01)	
HUS	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 2.400	(16)	(63)	(79)	(0,01)	
JPM	Heathrow Funding Ltd.	1,000	20.06.2021	€ 500	2	5	7	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2022	\$ 900	(39)	32	(7)	0,00	
	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC	1,000	20.06.2022	€ 1.400	10	23	33	0,00	
						€ (82)	€ (30)	€ (112)	(0,02)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	€ 1.900	20.09.2018	€ 0	€ (3)	€ (3)	0,00
JPM	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	6.800	20.09.2018	5	11	16	0,00
MYC	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	1.900	20.12.2018	0	1	1	0,00
MYI	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	5.600	20.09.2018	5	19	24	0,01
							€ 10	€ 28	€ 38	0,01

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
AZD	08/2018	€	1.577	£	1.385	€ 0	€ (13)	0,00	
BOA	08/2018	£	2.268	€	2.573	12	0	0,00	
	08/2018	\$	500	RUB	31.290	0	(3)	0,00	
BPS	07/2018		175.643	€	151.434	998	0	998	0,14
	08/2018	ARS	60.270	\$	2.800	682	0	682	0,10
	08/2018	\$	100	RUB	6.257	0	(1)	(1)	0,00
	02/2019	€	8.340	\$	9.956	33	0	33	0,00
CBK	07/2018	\$	342	ARS	8.914	0	(32)	(32)	(0,01)
	07/2018		1.856	RUB	117.399	12	0	12	0,00
	08/2018		1.933	MXN	37.725	0	(26)	(26)	0,00
	08/2018		2.017	TRY	8.926	0	(89)	(89)	(0,01)
GLM	07/2018	€	3.894	\$	4.567	17	0	17	0,00
	08/2018	CHF	100	€	86	0	0	0	0,00
	08/2018	£	5.359		6.069	17	0	17	0,00
	08/2018	RUB	258.215	\$	4.107	10	0	10	0,00
	08/2018	\$	931	RUB	58.266	0	(6)	(6)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens		
HUS	07/2018	ARS 55.043	\$ 2.601	€ 619	€ 0	€ 619	0,09		
	07/2018	RUB 117.399	\$ 1.863	0	(7)	(7)	0,00		
	07/2018	\$ 296	ARS 7.732	0	(28)	(28)	0,00		
	08/2018	€ 908	£ 800	0	(4)	(4)	0,00		
	08/2018	\$ 1.854	RUB 117.399	7	0	7	0,00		
JPM	07/2018	€ 1.009	\$ 1.171	0	(6)	(6)	0,00		
	07/2018	\$ 4.582	€ 3.911	0	(14)	(14)	0,00		
MSB	07/2018	ARS 218	\$ 8	0	0	0	0,00		
	08/2018	\$ 700	RUB 43.792	0	(5)	(5)	0,00		
NGF	07/2018	ARS 102	\$ 4	0	0	0	0,00		
	09/2018	TWD 123.062	\$ 4.051	0	(6)	(6)	0,00		
RYL	08/2018	€ 8.597	£ 7.556	0	(64)	(64)	(0,01)		
	08/2018	SEK 230.105	€ 22.599	568	0	568	0,08		
SCX	08/2018	CHF 1.300	€ 1.088	0	(34)	(34)	(0,01)		
	08/2018	€ 407	SEK 4.160	0	(8)	(8)	0,00		
	08/2018	£ 34.580	€ 39.378	324	0	324	0,05		
	08/2018	¥ 36.300	€ 277	0	(4)	(4)	0,00		
SOG	07/2018	DKK 2.085	€ 280	0	0	0	0,00		
SSB	07/2018	€ 150.442	\$ 175.129	0	(445)	(445)	(0,06)		
	08/2018	\$ 175.518	€ 150.442	438	0	438	0,06		
UAG	02/2019	€ 590	\$ 708	5	0	5	0,00		
	02/2019	\$ 3.232	€ 2.550	0	(165)	(165)	(0,02)		
						€ 3.742	€ (960)	€ 2.782	0,40
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>								<b>€ 2.548</b>	<b>0,37</b>
<b>Summe Anlagen</b>								<b>€ 722.686</b>	<b>103,81</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>								<b>€ (26.549)</b>	<b>(3,81)</b>
<b>Nettovermogen</b>								<b>€ 696.137</b>	<b>100,00</b>

## ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (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) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Hohle von EUR 14.682 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Hohle von EUR 260 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

(f) Pensionsgeschafte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Falligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschafte, zum Wert	Zu erhaltende Erlose aus Pensionsgeschaft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermogens
BPS	(0,650) %	29.06.2018	02.07.2018	€ 8.000	Kingdom of Belgium Government International Bond 1,000 %				
					fallig am 22.06.2031	€ (8.068)	€ 8.000	€ 8.000	1,15
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	\$ 220	U.S. Treasury Notes 3,375 %	(196)	188	188	0,03
					fallig am 15.11.2019				
<b>Summe Pensionsgeschafte</b>						<b>€ (8.264)</b>	<b>€ 8.188</b>	<b>€ 8.188</b>	<b>1,18</b>

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	€ 718.330	€ 0	€ 718.330
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.988	2.368	0	4.356
<b>Summen</b>	<b>€ 1.988</b>	<b>€ 720.698</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 722.686</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	€ 74.943	€ 674.474	€ 0	€ 749.417
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.889)	2.259	(2)	368
<b>Summen</b>	<b>€ 73.054</b>	<b>€ 676.733</b>	<b>€ (2)</b>	<b>€ 749.785</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	€ (13)	€ 0	€ (13)
BOA	3	0	3
BPS	1.695	(660)	1.035
BRC	(41)	0	(41)
CBK	(129)	260	131
CKL	(64)	0	(64)
DUB	(19)	0	(19)
GLM	38	0	38
GST	(88)	0	(88)
HUS	508	(330)	178
JPM	29	0	29
MSB	(5)	0	(5)
MYC	1	0	1
MYI	24	0	24
NGF	(6)	0	(6)
RYL	504	(480)	24
SCX	278	(270)	8
SSB	(7)	0	(7)
UAG	(160)	0	(160)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	93,45	89,93
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	6,39	5,10
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	3,35	1,72
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,28	(0,24)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	0,21
Freiverkehrsfinanzderivate	0,37	0,08

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Credit Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)	984.000	€ 99.362	PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)	1.462.000	€ 147.874
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>BNP Paribas S.A.</b>			<b>Spain Treasury Bills</b>		
1,000 % fällig am 27.06.2024	€ 8.000	7.951	0,000 % fällig am 15.06.2018	€ 15.500	15.530
<b>Barclays PLC</b>			<b>Italy Treasury Bills</b>		
3,125 % fällig am 17.01.2024	£ 5.900	6.749	0,000 % fällig am 30.04.2018	10.930	10.945
<b>DNB Boligkreditt A/S</b>			<b>Italy Treasury Bills</b>		
0,625 % fällig am 19.06.2025	€ 6.500	6.462	0,000 % fällig am 31.01.2018	10.050	10.052
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>			<b>Spain Treasury Bills</b>		
2,000 % fällig am 22.03.2028	5.700	5.666	0,000 % fällig am 19.01.2018	9.800	9.801
<b>Mylan Inc.</b>			<b>Spain Government International Bond</b>		
2,125 % fällig am 23.05.2025	5.000	4.988	1,450 % fällig am 31.10.2027	7.300	7.325
<b>Teva Pharmaceutical Finance BV</b>			<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>		
2,875 % fällig am 15.04.2019	4.400	4.539	2,050 % fällig am 01.08.2027	7.100	7.161
<b>Italy Treasury Bills</b>			<b>Mylan Inc</b>		
0,000 % fällig am 29.03.2018	4.420	4.424	2,125 % fällig am 23.05.2025	5.000	5.093
<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>			<b>Italy Treasury Bills</b>		
0,454 % fällig am 18.05.2023	4.400	4.420	0,000 % fällig am 29.03.2018	4.830	4.834
<b>Citigroup Inc.</b>			<b>Thermo Fisher Scientific, Inc.</b>		
0,177 % fällig am 21.03.2023	4.400	4.400	2,150 % fällig am 21.07.2022	4.500	4.791
<b>Letras del Banco Central de la Republica Argentina</b>			<b>Citigroup Inc</b>		
1,000 % fällig am 16.05.2018	ARS 109.990	4.263	0,177 % fällig am 21.03.2023	4.400	4.405
<b>Fairfax Financial Holdings Ltd.</b>			<b>Letras del Banco Central de la Republica Argentina</b>		
2,750 % fällig am 29.03.2028	4.000	4.010	1,000 % fällig am 16.05.2018	ARS 109.990	4.377
<b>Ubisoft Entertainment S.A.</b>			<b>Verizon Communications, Inc.</b>		
1,289 % fällig am 30.01.2023	3.900	3.919	3,376 % fällig am 15.02.2025	\$ 5.278	4.326
<b>Agence Francaise de Developpement</b>			<b>FMS Wertmanagement</b>		
2,750 % fällig am 22.03.2021	4.800	3.857	0,000 % fällig am 15.04.2019	€ 4.000	4.026
<b>UBS AG</b>			<b>Hammerson PLC</b>		
0,171 % fällig am 10.01.2020	3.500	3.528	2,000 % fällig am 01.07.2022	3.300	3.474
<b>QNB Finance Ltd.</b>			<b>Italy Treasury Bills</b>		
3,705 % fällig am 12.02.2020	4.400	3.528	0,000 % fällig am 14.03.2018	3.360	3.362
<b>Elm Park CLO DAC</b>			<b>Alteara S.C.A.</b>		
0,620 % fällig am 16.04.2029	3.500	3.500	2,250 % fällig am 05.07.2024	3.300	3.335
<b>Agence France Locale</b>			<b>Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT</b>		
1,125 % fällig am 20.06.2028	3.500	3.490	0,000 % fällig am 14.02.2019	2.910	2.909
<b>Italy Treasury Bills</b>			<b>Discovery Communications LLC</b>		
0,000 % fällig am 14.03.2018	€ 3.360	3.362	2,500 % fällig am 20.09.2024	2.500	2.784
<b>Barings Euro CLO BV</b>			<b>Italy Treasury Bills</b>		
0,000 % fällig am 27.07.2030	3.200	3.200	0,000 % fällig am 31.05.2018	2.430	2.434

(a) Der Euro Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income 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			
Skandinaviska Enskilda Banken AB 3,000 % fällig am 19.06.2019 SEK	46.000	€ 4.552	0,32	Dell International LLC 4,420 % fällig am 15.06.2021	900	€ 783	0,06	4,875 % fällig am 21.02.2028	€	12.500	12.984	0,92		
Stadshypotek AB 2,500 % fällig am 18.09.2019	47.000	4.660	0,33	5,450 % fällig am 15.06.2023	2.000	1.795	0,13	Peugeot S.A. 2,000 % fällig am 20.03.2025	6.800	6.633	0,47			
Sveriges Sakerstallda Obligationer AB 4,000 % fällig am 18.09.2019	45.000	4.548	0,32	6,020 % fällig am 15.06.2026	2.300	2.072	0,15	Philip Morris International, Inc. 2,750 % fällig am 19.03.2025	7.350	8.133	0,58			
Swedbank Hypotek AB 3,750 % fällig am 19.06.2019	46.000	4.587	0,33	Discovery Communications LLC 2,500 % fällig am 20.09.2024	€	4.100	4,534	0,32	ProSiebenSat.1 Media SE 2,625 % fällig am 15.04.2021	9.700	10.160	0,72		
Toronto-Dominion Bank 2,250 % fällig am 15.03.2021	4.400	3.687	0,26	EI Group PLC 6,875 % fällig am 15.02.2021	1.300	1.601	0,11	RAC Bond Co. PLC 4,565 % fällig am 06.05.2046	€	1.600	1.888	0,13		
UBS AG 0,171 % fällig am 10.01.2020	€	4.900	0,35	Energy Transfer Partners LP 5,000 % fällig am 01.10.2022	€	1.800	1,597	0,11	4,870 % fällig am 06.05.2046	4.200	4.949	0,35		
4,750 % fällig am 12.02.2026 (g)	1.000	1.077	0,08	Eurofins Scientific SE 2,125 % fällig am 25.07.2024	€	4.600	4,537	0,32	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. 5,838 % fällig am 30.09.2027	\$	250	229	0,02	
5,125 % fällig am 15.05.2024 (g)	€	6.200	0,38	Faurecia S.A. 3,375 % fällig am 30.01.2023	2.100	2.234	0,16	Roadster Finance Designated Activity Co. 1,625 % fällig am 09.12.2024	€	200	196	0,01		
7,625 % fällig am 17.08.2022 (g)	3.450	3.269	0,23	Fidelity National Information Services, Inc. 4,500 % fällig am 15.10.2022	€	6.800	6,883	0,49	Rockies Express Pipeline LLC 2,375 % fällig am 08.12.2027	400	391	0,03		
UBS Group Funding Switzerland AG 4,125 % fällig am 24.09.2025	650	553	0,04	Fromageries Bel SA 1,500 % fällig am 18.04.2024	€	1.600	1,627	0,12	6,000 % fällig am 15.01.2019	\$	500	435	0,03	
Unicredit SpA 3,750 % fällig am 12.04.2022	900	736	0,05	G4S International Finance PLC 1,875 % fällig am 24.05.2025	3.500	3.530	0,25	6,850 % fällig am 15.07.2018	€	5.100	4.373	0,31		
VEREIT Operating Partnership LP 4,125 % fällig am 01.06.2021	100	87	0,01	General Electric Co. 1,250 % fällig am 26.05.2023	1.400	1.436	0,10	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625 % fällig am 01.03.2025	1.200	1.095	0,08			
Vesteda Finance BV 2,500 % fällig am 27.10.2022	€	600	0,05	Goldcorp, Inc. 3,700 % fällig am 15.03.2023	\$	100	84	0,01	5,750 % fällig am 15.05.2024	1.000	915	0,06		
VIVAT NV 2,375 % fällig am 17.05.2024	5.700	5.926	0,42	Greene King Finance PLC 5,106 % fällig am 15.03.2034	€	1.078	1,417	0,10	5,875 % fällig am 30.06.2026	4.200	3.864	0,27		
Volkswagen Bank GmbH 0,099 % fällig am 15.06.2021	6.600	6.562	0,47	Greif Nevada Holdings, Inc. SCS 7,375 % fällig am 15.07.2021	€	3.400	4,017	0,29	Schaeffler Finance BV 3,250 % fällig am 15.05.2025	€	10.000	10.573	0,75	
1,250 % fällig am 10.06.2024	3.300	3.269	0,23	HeidelbergCement AG 2,250 % fällig am 30.03.2023	400	427	0,03	SCHMOLZ + BICKENBACH Luxembourg Finance S.A. 5,625 % fällig am 15.07.2022	300	305	0,02			
Volkswagen Financial Services AG 0,375 % fällig am 12.04.2021	4.600	4.596	0,33	IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	5.900	6.018	0,43	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875 % fällig am 15.01.2026	5.400	5.382	0,38			
0,875 % fällig am 12.04.2023	4.000	3.964	0,28	IMCD NV 2,500 % fällig am 26.03.2025	6.630	6.541	0,46	Societa Esercizi Aeroportuali SpA Sea 3,125 % fällig am 17.04.2021	1.000	1.068	0,08			
Volkswagen Leasing GmbH 0,122 % fällig am 06.07.2021	2.300	2.288	0,16	INEOS Finance PLC 2,125 % fällig am 15.11.2025	700	667	0,05	SoftBank Group Corp. 4,000 % fällig am 20.04.2023	5.900	6.094	0,43			
Vonovia Finance BV 5,000 % fällig am 02.10.2023	\$	100	0,01	Ingenico Group S.A. 1,625 % fällig am 13.09.2024	1.500	1.481	0,11	Spirit Issuer PLC 6,582 % fällig am 28.12.2027	€	828	960	0,07		
Wells Fargo & Co. 1,625 % fällig am 02.06.2025	€	11.800	12,148	ITV PLC 2,125 % fällig am 21.09.2022	1.400	1.471	0,10	Syngenta Finance NV 4,441 % fällig am 24.04.2023	\$	1.000	853	0,06		
WPC Eurobond BV 2,125 % fällig am 15.04.2027	900	900	0,06	John Lewis PLC 6,125 % fällig am 21.01.2025	€	1.300	1,718	0,12	4,892 % fällig am 24.04.2025	4.225	3.553	0,25		
		560.932	39,84	Kemira Oyj 1,750 % fällig am 30.05.2024	€	500	516	0,04	Tauron Polska Energia S.A. 2,375 % fällig am 05.07.2027	€	2.900	2.863	0,20	
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Kinder Morgan Energy Partners LP 4,250 % fällig am 01.09.2024	\$	100	86	0,01	TDF Infrastructure S.A.S. 2,500 % fällig am 07.04.2026	2.200	2.271	0,16		
AA Bond Co. Ltd. 2,875 % fällig am 31.07.2043	€	6.711	7,454	0,53	Kinder Morgan, Inc. 3,150 % fällig am 15.01.2023	800	662	0,05	2,875 % fällig am 19.10.2022	8.400	9.037	0,64		
ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. 2,875 % fällig am 01.04.2020	€	3.900	4,085	0,29	Leonardo SpA 8,000 % fällig am 16.12.2019	€	5.700	7,012	0,50	Teleperformance 1,875 % fällig am 02.07.2025 (a)	1.300	1.291	0,09	
Ahlstrom-Munksjo Oyj 1,875 % fällig am 09.06.2022	5.400	5.533	0,39	0,67	Marks & Spencer PLC 3,000 % fällig am 08.12.2023	400	460	0,03	Tesco PLC 6,125 % fällig am 24.02.2022	€	511	657	0,05	
Altice Financing S.A. 5,250 % fällig am 15.02.2023	7.800	8.063	0,57	0,06	Midcontinent Express Pipeline LLC 6,700 % fällig am 15.09.2019	\$	4.900	4,342	0,31	Teva Pharmaceutical Finance BV 1,500 % fällig am 25.10.2018	CHF	5.030	4.352	0,31
Altice France S.A. 5,625 % fällig am 15.05.2024	4.200	4.364	0,31	0,18	Mitchells & Butlers Finance PLC 1,081 % fällig am 15.12.2030	€	739	790	0,06	3,650 % fällig am 10.11.2021	\$	900	739	0,05
7,375 % fällig am 01.05.2026	\$	3.000	2,522	0,18	1,031	3.093	3,833	0,27	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 2,950 % fällig am 18.12.2022	400	234	0,02		
Altice Luxembourg S.A. 7,250 % fällig am 15.05.2022	€	9.300	9,376	0,67	0,04	0,04	0,06	0,06	3,650 % fällig am 10.11.2021	300	328	0,02		
BAT Capital Corp. 1,125 % fällig am 16.11.2023	800	808	0,06	0,04	PerkinElmer, Inc. 0,600 % fällig am 09.04.2021	€	5.000	5,034	0,36	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 0,125 % fällig am 27.07.2018	CHF	2.030	2.268	0,16
Bayer Capital Corp. BV 0,625 % fällig am 15.12.2022	500	503	0,04	0,03	Petrofac Ltd. 3,400 % fällig am 10.10.2018	\$	700	597	0,04	1,125 % fällig am 15.10.2024	€	6.500	5.519	0,39
Bureau Veritas S.A. 1,250 % fällig am 07.09.2023	500	505	0,04	0,03	Petroleos Mexicanos 2,750 % fällig am 21.04.2027	€	300	270	0,02	1,250 % fällig am 31.03.2023	\$	3.600	3.277	0,23
BWAY Holding Co. 4,750 % fällig am 15.04.2024 (a)	400	401	0,03	0,03					2,200 % fällig am 21.07.2021	\$	700	557	0,04	
Continental Airlines Pass-Through Trust 4,750 % fällig am 12.07.2022	\$	173	0,01	0,01					2,800 % fällig am 21.07.2023	€	1.700	1.259	0,09	
7,250 % fällig am 10.05.2021	61	55	0,00	0,00					3,250 % fällig am 15.04.2022	€	200	203	0,01	
Crown European Holdings S.A. 3,375 % fällig am 15.05.2025	€	7.000	7,098	0,50					Travis Perkins PLC 4,375 % fällig am 15.09.2021	€	200	236	0,02	
CVS Health Corp. 3,500 % fällig am 20.07.2022	\$	900	765	0,05					4,500 % fällig am 07.09.2023	5.600	6.543	0,46		
3,700 % fällig am 09.03.2023	6.700	5.715	0,41						U.S. Airways Pass-Through Trust 4,625 % fällig am 03.12.2026	\$	1.097	962	0,07	
DAE Funding LLC 4,000 % fällig am 01.08.2020	100	85	0,01						Ubisoft Entertainment S.A. 1,289 % fällig am 30.01.2023	€	6.900	6.918	0,49	
Davide Campari-Milano SpA 2,750 % fällig am 30.09.2020	€	3.473	3,660	0,26					UCB S.A. 5,125 % fällig am 02.10.2023	856	1.016	0,07		
									Unique Pub Finance Co. PLC 5,659 % fällig am 30.06.2027	€	4.986	6.243	0,44	
									6,542 % fällig am 30.03.2021	1.237	1.478	0,10		
									7,395 % fällig am 28.03.2024	400	502	0,04		
									UPCB Finance Ltd. 3,625 % fällig am 15.06.2029	€	1.000	969	0,07	
									4,000 % fällig am 15.01.2027	\$	7.100	7.205	0,51	
									Valeant Pharmaceuticals International, Inc. 5,375 % fällig am 15.03.2020	1.500	1.302	0,09		





## 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
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 163,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	151	€ (73)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Long	09/2018	1.668	590	0,04
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09/2018	62	166	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	241	304	0,02
Euro-Schatz September Futures	Long	09/2018	843	77	0,01
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 157,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	151	59	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09/2018	1.013	189	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09/2018	85	(87)	(0,01)
				€ 1.225	0,09

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 119,000	27.07.2018	124	€ (32)	€ (10)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	120,500	27.07.2018	124	(28)	(35)	(0,01)
				€ (60)	€ (45)	(0,01)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

€ 1.180 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-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000 %	20.12.2022	\$ 600	€ 0	0,00
BT Group	1,000	20.06.2023	€ 9.900	5	0,00
Carrefour	1,000	20.06.2023	9.100	(7)	0,00
Daimler AG	1,000	20.12.2020	200	0	0,00
Elictricite De France SA	1,000	20.12.2022	500	(5)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2022	\$ 4.900	(95)	(0,01)
General Electric Co.	1,000	20.06.2023	1.500	3	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2022	€ 3.300	19	0,00
Navient Corp.	5,000	20.06.2022	\$ 200	5	0,00
Novo Banco S.A.	5,000	20.12.2021	€ 500	78	0,01
Rolls-Royce PLC	0,000	20.12.2024	5.500	(52)	(0,01)
Schaeffler Finance BV	0,000	20.06.2023	100	(3)	0,00
Schaeffler Finance BV	5,000	20.06.2022	2.800	(131)	(0,01)
Telefonica Emisiones S.A.U.	0,000	20.06.2023	17.600	(272)	(0,02)
Telefonica Emisiones S.A.U.	1,000	20.12.2022	13.800	(164)	(0,01)
Tesco PLC	1,000	20.06.2025	4.100	(44)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	3.200	3	0,00
Volkswagen International Finance NV	0,000	20.06.2023	5.400	(107)	(0,01)
				€ (767)	(0,06)

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-30 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 97.300	€ (44)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000 %	19.12.2028	\$ 102.300	€ (420)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.12.2048	35.600	(353)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	£ 23.300	(155)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	13.500	(116)	(0,01)
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.12.2028	6.400	(38)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	6.100	53	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	¥8.940.000	(317)	(0,02)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,150 %	22.07.2027	MXN 175.600	€ (367)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,570	18.03.2025	3.300	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,670	05.03.2025	46.400	(28)	0,00
					€ (1.744)	(0,12)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>€ (2.555)</b>	<b>(0,18)</b>

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/- verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	15.08.2018	€ 25.000	€ (47)	€ (29)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	1,000	15.08.2018	6.700	(11)	(4)	0,00
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	6.900	(15)	(8)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.08.2018	6.900	(10)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	7.000	(13)	(23)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	21.000	(41)	(45)	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.08.2018	6.700	(9)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	20.100	(46)	(65)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	27.400	(48)	(59)	(0,01)
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	21.300	(40)	(37)	0,00
GST	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	6.900	(18)	(15)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	14.000	(27)	(25)	0,00
						€ (325)	€ (322)	(0,02)

## 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	Hammerson PLC	1,000 %	20.06.2021	€ 900	€ (25)	€ 36	€ 11	0,00
BPS	Hammerson PLC	1,000	20.06.2021	900	(25)	35	10	0,00
CBK	Heathrow Funding Ltd.	1,000	20.06.2021	200	1	2	3	0,00
GST	Hammerson PLC	1,000	20.06.2021	1.200	(35)	48	13	0,00
	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	3.600	31	(27)	4	0,00
	Heathrow Funding Ltd.	1,000	20.06.2021	200	1	2	3	0,00
HUS	Argentine Republic Government International Bond	0,000	20.12.2018	\$ 1.000	9	1	10	0,00
JPM	Heathrow Funding Ltd.	1,000	20.06.2021	€ 100	0	1	1	0,00
	UniCredit SpA	1,000	20.12.2022	2.500	(143)	(86)	(229)	(0,02)
MYC	Novo Banco S.A.	5,000	20.12.2021	100	(25)	21	(4)	0,00
UAG	Park Aerospace Holdings Ltd.	5,000	01.07.2020	\$ 2.200	110	(36)	74	0,01
					€ (101)	€ (3)	€ (104)	(0,01)

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	3.800	20.09.2018	€ 0	€ (6)	€ (6)	0,00
JPM	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	13.100	20.09.2018	10	21	31	0,00
MYC	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	3.900	20.12.2018	1	0	1	0,00
MYI	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	10.900	20.09.2018	9	37	46	0,01
							€ 20	€ 52	€ 72	0,01

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	08/2018	AUD 21.078	€ 13.215	€ 0	€ (83)	€ (83)	(0,01)
	08/2018	€ 6.884	£ 6.045	0	(57)	(57)	0,00
BOA	07/2018	\$ 6.753	ARS 175.339	0	(578)	(578)	(0,04)
	08/2018	€ 911	£ 803	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	£ 4.258	€ 4.829	20	0	20	0,00
	08/2018	\$ 200	RUB 12.516	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07/2018	ARS 175.339	\$ 6.388	265	0	265	0,02
	07/2018	€ 9.581	€ 11.273	74	0	74	0,01
	07/2018	\$ 6.332	ARS 175.339	0	(268)	(268)	(0,02)
	07/2018	€ 301.829	€ 260.229	1.714	0	1.714	0,12
	08/2018	£ 1.015	€ 1.160	14	0	14	0,00
	08/2018	\$ 100	RUB 6.257	0	(1)	(1)	0,00
	02/2019	€ 13.460	\$ 16.068	53	0	53	0,00
CBK	07/2018	DKK 6.473	€ 869	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 2.943	RUB 186.098	20	0	20	0,00
	08/2018	AUD 1.042	\$ 778	7	0	7	0,00
	08/2018	MXN 6.798	341	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	TRY 4.313	949	23	0	23	0,00
DUB	07/2018	ARS 1.278	45	1	0	1	0,00
GLM	07/2018	€ 5.066	€ 5.963	44	(3)	41	0,00
	07/2018	\$ 6.491	€ 5.530	0	(30)	(30)	0,00
	08/2018	CHF 312	€ 269	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	€ 3.739	£ 3.294	0	(19)	(19)	0,00
	08/2018	RUB 1.046.061	\$ 16.638	41	0	41	0,00
	08/2018	\$ 402	RUB 25.156	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	11.714	TRY 52.192	0	(452)	(452)	(0,03)
HUS	07/2018	RUB 186.098	\$ 2.953	0	(11)	(11)	0,00
	08/2018	\$ 15.798	RUB 989.803	11	(96)	(85)	(0,01)
JPM	07/2018	€ 2.670	\$ 3.092	0	(22)	(22)	0,00
	07/2018	\$ 10.250	€ 8.749	0	(30)	(30)	0,00
	08/2018	15.428	MXN 300.888	0	(216)	(216)	(0,02)
MSB	08/2018	300	RUB 18.768	0	(2)	(2)	0,00
NGF	07/2018	ARS 682	\$ 24	1	0	1	0,00
	09/2018	TWD 249.983	€ 8.229	0	(12)	(12)	0,00
RBC	08/2018	CHF 1.235	€ 1.068	4	(2)	2	0,00
	08/2018	\$ 300	£ 220	0	(8)	(8)	0,00
RYL	08/2018	CHF 202	€ 169	0	(5)	(5)	0,00
	08/2018	€ 1.058	£ 928	0	(10)	(10)	0,00
SCX	08/2018	SEK 296.145	€ 29.085	731	0	731	0,05
	08/2018	CHF 5.756	€ 4.816	0	(151)	(151)	(0,01)
	08/2018	£ 102.147	€ 116.321	958	0	958	0,07
	08/2018	¥ 62.400	€ 476	0	(7)	(7)	0,00
	08/2018	\$ 966	TRY 4.313	0	(35)	(35)	0,00
SOG	07/2018	€ 864	DKK 6.436	0	0	0	0,00
	10/2018	DKK 6.436	€ 864	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	€ 258.175	\$ 300.541	0	(763)	(763)	(0,05)
	08/2018	CHF 202	€ 171	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	\$ 301.208	€ 258.175	751	0	751	0,05
UAG	02/2019	€ 980	\$ 1.176	8	0	8	0,00
	02/2019	\$ 5.400	€ 4.260	0	(277)	(277)	(0,02)
				€ 4.740	€ (3.151)	€ 1.589	0,11

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die thesaurierenden Anteile der Institutional USD (Hedged) Class 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	07/2018	€ 4.243	\$ 5.005	€ 43	€ 0	€ 43	0,00
GLM	07/2018	2.703	3.158	2	0	2	0,00
MSB	07/2018	17.710	20.663	0	(12)	(12)	0,00
	07/2018	\$ 25.078	€ 21.713	234	0	234	0,02
	08/2018	€ 21.713	\$ 25.133	0	(233)	(233)	(0,02)
SCX	07/2018	20.251	23.460	0	(158)	(158)	(0,01)
SSB	07/2018	20.290	23.610	0	(68)	(68)	(0,01)
	07/2018	\$ 25.124	€ 21.582	64	0	64	0,00
	08/2018	€ 21.582	\$ 25.180	0	(63)	(63)	0,00
				€ 343	€ (534)	€ (191)	(0,02)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ 1.044 0,07

Summe Anlagen

€ 1.458.417 103,57

Sonstige Aktiva und Passiva

€ (50.314) (3,57)

Nettovermogen

€ 1.408.103 100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

## 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) 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.

Barmittel in Höhe von EUR 38.391 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von EUR 1.756 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(h) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	(0,650) %	29.06.2018	02.07.2018	€ 12.200	Kingdom of Belgium Government International Bond 1,000 % fällig am 22.06.2031	€ (12.303)	€ 12.200	€ 12.200	0,87
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	\$ 2.516	U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.11.2018	(2.202)	2.155	2.155	0,15
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>€ (14.505)</b>	<b>€ 14.355</b>	<b>€ 14.355</b>	<b>1,02</b>

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	€ 1.458.748	€ 0	€ 1.458.748
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.180	(1.585)	74	(331)
<b>Summen</b>	<b>€ 1.180</b>	<b>€ 1.457.163</b>	<b>€ 74</b>	<b>€ 1.458.417</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	€ 95.436	€ 924.814	€ 0	€ 1.020.250
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.244)	1.354	88	198
<b>Summen</b>	<b>€ 94.192</b>	<b>€ 926.168</b>	<b>€ 88</b>	<b>€ 1.020.448</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	€ (140)	€ 231	€ 91
BOA	(509)	223	(286)
BPS	1.828	(280)	1.548
BRC	(82)	17	(65)
CBK	52	0	52
CKL	(130)	0	(130)
DUB	(36)	(51)	(87)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
GLM	€ (421)	€ 403	€ (18)
GST	(26)	0	(26)
HUS	(86)	0	(86)
JPM	(465)	660	195
MSB	(13)	0	(13)
MYC	(3)	0	(3)
MYI	46	0	46
NGF	(11)	0	(11)
RBC	(6)	0	(6)
RYL	716	(950)	(234)
SCX	607	0	607
SSB	(82)	0	(82)
UAG	(195)	223	28

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	80,20	80,58
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	14,13	9,45
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	9,27	7,49
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,08	(0,12)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,18)	0,03
Freiverkehrsfinanzderivate	0,07	0,11

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Income Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
<b>PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)</b>			<b>PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)</b>		
	1.222.800	€ 123.417		760.330	€ 76.850
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>BNP Paribas S.A.</b>			<b>Italy Treasury Bills</b>		
1,000 % fällig am 27.06.2024	€ 19.200	19.088	0,000 % fällig am 13.07.2018	€ 43.700	43.746
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>			<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b>		
0,297 % fällig am 26.09.2023	16.400	16.464	3,875 % fällig am 21.01.2019	24.370	25.242
<b>Fairfax Financial Holdings Ltd.</b>			<b>La Poste SA</b>		
2,750 % fällig am 29.03.2028	14.200	14.110	3,125 % fällig am 01.01.2099	11.800	11.431
<b>Petroleos Mexicanos</b>			<b>Intesa Sanpaolo SpA</b>		
4,875 % fällig am 21.02.2028	12.100	13.192	7,000 % fällig am 19.01.2021	9.750	10.116
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>			<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>		
0,650 % fällig am 15.10.2023	13.600	13.177	2,050 % fällig am 01.08.2027	9.900	9.985
<b>Equinix, Inc.</b>			<b>Netherlands Treasury Bills</b>		
2,875 % fällig am 15.03.2024	12.800	12.810	0,000 % fällig am 29.03.2018	9.000	9.004
<b>Wells Fargo &amp; Co.</b>			<b>Altarea S.C.A.</b>		
1,625 % fällig am 02.06.2025	11.800	12.111	2,250 % fällig am 05.07.2024	8.900	8.992
<b>Corestate Capital Holding S.A.</b>			<b>Spain Government International Bond</b>		
3,500 % fällig am 15.04.2023	12.000	11.823	1,450 % fällig am 31.10.2027	8.800	8.830
<b>HSBC Holdings PLC</b>			<b>German Treasury Bill</b>		
0,875 % fällig am 06.09.2024	11.800	11.704	0,000 % fällig am 15.08.2018	8.610	8.636
<b>Europäischer Stabilitätsmechanismus</b>			<b>Volkswagen International Finance NV</b>		
0,000 % fällig am 06.09.2018	10.440	10.451	3,875 % fällig am 01.01.2099	7.800	7.847
<b>QNB Finance Ltd.</b>			<b>Telefonica Europe BV</b>		
3,713 % fällig am 07.02.2020	\$ 13.000	10.435	3,875 % fällig am 01.01.2099	8.200	7.819
<b>ADLER Real Estate AG</b>			<b>NN Group NV</b>		
3,000 % fällig am 27.04.2026	€ 10.300	10.157	4,625 % fällig am 13.01.2048	7.100	7.742
<b>Nationwide Building Society</b>			<b>Bundesrepublik Deutschland</b>		
6,875 % fällig am 20.06.2019	£ 8.300	9.996	0,000 % fällig am 14.12.2018	7.530	7.577
<b>Netherlands Treasury Bills</b>			<b>La Mondiale SAM</b>		
0,000 % fällig am 29.03.2018	€ 9.000	9.009	5,050 % fällig am 17.12.2025	6.400	7.065
<b>German Treasury Bill</b>			<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b>		
0,000 % fällig am 15.08.2018	8.610	8.638	0,000 % fällig am 07.12.2018	6.400	6.426
<b>Philip Morris International, Inc.</b>			<b>France Treasury Bills</b>		
2,750 % fällig am 19.03.2025	7.350	8.155	0,000 % fällig am 05.04.2018	5.980	5.989
<b>Lincoln Finance Ltd.</b>			<b>Tesco Property Finance PLC</b>		
6,875 % fällig am 15.04.2021	7.700	7.982	5,744 % fällig am 13.04.2040	£ 4.479	5.934
<b>Altareit S.C.A.</b>			<b>Intesa Sanpaolo SpA</b>		
2,875 % fällig am 02.07.2025	8.000	7.945	7,750 % fällig am 14.12.2018	€ 4.800	5.352
<b>Bundesrepublik Deutschland</b>			<b>Treasury Bills des europäischen Stabilitätsmechanismus</b>		
0,000 % fällig am 14.12.2018	7.530	7.577	0,000 % fällig am 05.07.2018	5.100	5.106
			<b>Europäische Investitionsbank</b>		
			4,250 % fällig am 15.04.2019	4.000	4.187
			<b>Cooperativa Muratori &amp; Cementisti-CMC di Ravenna SC</b>		
			6,875 % fällig am 01.08.2022	4.100	3.999
			<b>Altice Luxembourg S.A.</b>		
			6,250 % fällig am 15.02.2025	4.000	3.872
			<b>France Treasury Bills</b>		
			0,000 % fällig am 14.03.2018	3.780	3.781
			<b>Altice France S.A.</b>		
			5,625 % fällig am 15.05.2024	3.600	3.759
			<b>Europäische Union</b>		
			0,000 % fällig am 04.04.2018	3.670	3.683
			<b>Novatek OAO via Novatek Finance DAC</b>		
			6,604 % fällig am 03.02.2021	\$ 4.100	3.658

(a) Der Euro Income Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration Fund

30. Juni 2018

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>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>US-REGIERUNGSGEBÜHREN</b>				<b>US-REGIERUNGSGEBÜHREN</b>					
Skandinaviska Enskilda Banken AB				1,500 % fällig am 15.12.2021	SEK	10.000	€ 1.001	0,43	Fannie Mae				
SLM Student Loan Trust				0,229 % fällig am 15.12.2033	€	886	876	0,37	2,151 % fällig am 25.07.2037	\$	18	€ 15	0,01
Stadtshyotek AB				4,500 % fällig am 21.09.2022	SEK	18.000	2.018	0,86	3,704 % fällig am 01.08.2036		5	5	0,00
Sveriges Sakerstallda Obligationer AB				1,250 % fällig am 15.06.2022		19.000	1.883	0,80	Fannie Mae, TBA		2.800	2.321	0,99
Swedbank Hypotek AB				1,000 % fällig am 28.09.2021		5.000	492	0,21	3,000 % fällig am 01.08.2048		11.000	9.378	4,00
Telereal Secured Finance PLC				4,010 % fällig am 10.12.2033	£	870	1.053	0,45	Freddie Mac, TBA		6.000	4.974	2,12
Temasek Financial Ltd.				0,500 % fällig am 01.03.2022	€	600	609	0,26	3,500 % fällig am 01.07.2048		4.700	4.005	1,70
Wells Fargo & Co.				3,286 % fällig am 11.02.2022	\$	200	173	0,07					
						44.579	19,00						
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>US-SCHATZobligationen</b>					
Alice Luxembourg S.A.				7,250 % fällig am 15.05.2022	€	800	807	0,34	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)				
AP Moller - Maersk A/S				2,875 % fällig am 28.09.2020	\$	200	169	0,07	0,250 % fällig am 15.01.2025		1.375	1.146	0,49
Barry Callebaut Services NV				5,750 % fällig am 01.09.2020		400	358	0,15	1,750 % fällig am 15.01.2028		1.196	1.119	0,48
Charter Communications Operating LLC				4,464 % fällig am 23.07.2022		100	87	0,04					
Delta Air Lines, Inc.				3,625 % fällig am 15.03.2022		100	85	0,04					
EMC Corp.				2,650 % fällig am 01.06.2020		100	83	0,03					
Energy Transfer Partners LP				5,750 % fällig am 01.09.2020		100	89	0,04					
ERAC USA Finance LLC				2,350 % fällig am 15.10.2019		200	169	0,07					
Greif Nevada Holdings, Inc. SCS				7,375 % fällig am 15.07.2021	€	100	118	0,05					
IHO Verwaltungs GmbH (3,250 % bar oder 4,000 % PIK)				3,250 % fällig am 15.09.2023 (c)		200	203	0,09					
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)		100	102	0,04					
MGM Resorts International				6,750 % fällig am 01.10.2020	\$	100	90	0,04					
Penske Truck Leasing Co. LP				3,200 % fällig am 15.07.2020		100	86	0,04					
Sabine Pass Liquefaction LLC				5,625 % fällig am 01.02.2021		100	90	0,04					
Schaeffler Finance BV				3,250 % fällig am 15.05.2025	€	200	211	0,09					
Smurfit Kappa Acquisitions ULC				2,875 % fällig am 15.01.2026		200	199	0,08					
United Technologies Corp.				0,000 % fällig am 18.05.2020		1.000	1.002	0,43					
Verallia Packaging SASU				5,125 % fällig am 01.08.2022		1.000	1.028	0,44					
Volkswagen Group of America Finance LLC				2,450 % fällig am 20.11.2019	\$	200	169	0,07					
						5.145	2,19						
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>					
AT&T, Inc.				2,998 % fällig am 15.01.2020		800	689	0,29	Adagio CLO PLC				
				3,298 % fällig am 15.07.2021		2.700	2.336	1,00	0,000 % fällig am 15.09.2022 (a)(d)	€	452	452	0,20
Exelon Corp.				5,150 % fällig am 01.12.2022		100	89	0,04					
Sprint Capital Corp.				6,900 % fällig am 01.05.2019		200	175	0,07					
Sprint Communications, Inc.				9,000 % fällig am 15.11.2018		100	87	0,04					
						3.376	1,44						
						53.100	22,63						

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration 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
Arbour CLO DAC				Phoenix Park CLO DAC				Slovenia Government International Bond			
0,580 % fällig am 15.03.2029	€ 300	€ 300	0,13	0,772 % fällig am 29.07.2027	€ 850	€ 851	0,36	1,500 % fällig am 25.03.2035	€ 500	€ 502	0,21
0,850 % fällig am 15.07.2027	2.700	2.704	1,15	Red & Black Auto Lease Germany S.A.				1,750 % fällig am 03.11.2040	1.900	1.929	0,82
Asset-Backed European Securitisation Transaction Thirteen FT				0,030 % fällig am 15.11.2027	920	922	0,39	2,250 % fällig am 12.06.2068	300	308	0,13
0,030 % fällig am 23.08.2030	700	701	0,30	SC Germany Auto UG				5,250 % fällig am 18.02.2024	\$ 6.242	5.820	2,48
Aurium CLO DAC				0,031 % fällig am 13.12.2026	204	205	0,09	SNCF Reseau			
0,000 % fällig am 13.10.2029 (b)	900	900	0,38	SCF Rahoituspalvelut Kimi DAC				1,000 % fällig am 09.11.2031	€ 400	396	0,17
Babson Euro CLO BV				0,030 % fällig am 25.11.2026	635	638	0,27	2,000 % fällig am 05.02.2048	1.900	1.987	0,85
1,300 % fällig am 15.04.2027	500	502	0,21	SLM Student Loan Trust				Spain Government International Bond			
Bavarian Sky S.A.				0,000 % fällig am 15.12.2023	96	96	0,04	1,450 % fällig am 31.10.2027	1.000	1.018	0,43
0,030 % fällig am 20.10.2023	648	649	0,28	0,000 % fällig am 17.06.2024	488	489	0,21	1,950 % fällig am 30.04.2026	4.300	4.604	1,96
0,030 % fällig am 20.06.2025	877	881	0,38	0,229 % fällig am 15.12.2033	262	259	0,11				
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				Sorrento Park CLO DAC							
0,730 % fällig am 21.09.2029	500	500	0,21	0,624 % fällig am 16.11.2027	900	900	0,38				
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				Sunrise SPV SRL							
0,654 % fällig am 15.08.2027	1.100	1.101	0,47	0,029 % fällig am 27.11.2041	300	301	0,13				
0,780 % fällig am 16.04.2029	400	401	0,17	Towers CQ SRL							
Castle Park CLO Designated Activity Co.				0,627 % fällig am 28.12.2033	393	394	0,17				
0,671 % fällig am 15.01.2028	300	302	0,13								
Compartment VCL											
0,030 % fällig am 21.09.2023	1.168	1.171	0,50								
Cork Street CLO Designated Activity Co.											
0,760 % fällig am 27.11.2028	1.200	1.202	0,51								
CVC Cordatus Loan Fund Ltd.											
0,780 % fällig am 24.01.2028	900	901	0,38								
Dartry Park CLO DAC											
0,830 % fällig am 28.04.2029	400	401	0,17								
1,300 % fällig am 28.04.2029	100	100	0,04								
Driver Multi-Compartment S.A.											
0,030 % fällig am 21.02.2026	348	349	0,15								
Dryden Euro CLO BV											
0,659 % fällig am 23.08.2026	1.300	1.301	0,56								
0,679 % fällig am 17.05.2027	300	301	0,13								
1,250 % fällig am 23.08.2026	300	300	0,13								
Elm Park CLO DAC											
0,620 % fällig am 16.04.2029	700	699	0,30								
Grosvenor Place CLO BV											
0,720 % fällig am 30.10.2029	400	400	0,17								
Harvest CLO DAC											
0,593 % fällig am 15.11.2028	800	799	0,34								
Holland Park CLO Ltd.											
0,604 % fällig am 14.05.2027	1.000	1.001	0,43								
NovoStar Mortgage Funding Trust											
2,665 % fällig am 25.01.2036	\$ 1.000	851	0,36								

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
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 152,000 EUR auf Euro-BTP 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	76	€ 0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 160,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	17	(39)	(0,02)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 162,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	16	(6)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 166,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	15	(1)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 99,500 EUR auf Euribor 3-Year Mid Curve December 2018 Futures	Short	12/2018	508	(105)	(0,04)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 99,875 EUR auf Euribor 2-Year Mid Curve September 2018 Futures	Short	09/2018	55	(7)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09/2018	101	39	0,02
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	71	(29)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	67	97	0,04
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	345	1.497	0,64
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	279	680	0,29
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	21	(33)	(0,01)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 125,000 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Long	08/2018	175	0	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 131,250 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Short	08/2018	42	7	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 131,500 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Short	08/2018	41	8	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 155,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	30	(1)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 98,500 EUR auf Euribor 3-Year Mid Curve December 2018 Futures	Short	12/2018	508	15	0,01
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 98,750 EUR auf Euribor 3-Year Mid Curve December 2018 Futures	Long	12/2018	508	(39)	(0,02)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 99,125 EUR auf Euribor 2-Year Mid Curve December 2018 Futures	Long	12/2018	169	(35)	(0,02)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 99,250 EUR auf Euribor 2-Year Mid Curve December 2018 Futures	Short	09/2018	368	58	0,02
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 99,375 EUR auf Euribor 2-Year Mid Curve September 2018 Futures	Long	09/2018	71	(17)	(0,01)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 99,500 EUR auf Euribor 2-Year Mid Curve September 2018 Futures	Long	09/2018	368	(136)	(0,06)

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	10	€ 2	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	4	2	0,00
				€ 1.957	0,83

**VERKAUFSOPTIONEN****OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CME 90-Day Eurodollar December 2018 Futures	\$ 96,875	14.12.2018	163	€ 0	€ (45)	(0,02)
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>					<b>€ 1.912</b>	<b>0,81</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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2020	\$ 1.500	€ 9	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2021	200	3	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.06.2023	€ 1.300	5	0,00
Renault SA	1,000	20.12.2020	1.400	4	0,00
				€ 21	0,00

**ZINSSWAPS**

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250 %	21.12.2046	\$ 6.000	€ 1.441	0,62
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,000	19.12.2023	ZAR 77.300	10	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2028	€ 11.500	154	0,07
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.12.2048	£ 2.400	81	0,04
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	2,000	15.03.2028	7.900	(65)	(0,03)
					€ 1.621	0,70
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>€ 1.642</b>	<b>0,70</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

**FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

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

**VERKAUFSOPTIONEN****CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES**

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800 %	19.09.2018	€ 11.600	€ (23)	€ (38)	(0,02)

**DEVIENOPTIENEN**

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC USD versus JPY	¥ 80,000	28.02.2019	\$ 900	€ (35)	€ 0	0,00
FBF	Put - OTC USD versus JPY	80,000	28.02.2019	600	(23)	0	0,00
SOG	Call - OTC USD versus TRY	TRY 5,150	20.05.2019	1.400	(85)	(82)	(0,03)
	Put - OTC USD versus TRY	5,150	20.05.2019	1.400	(80)	(63)	(0,03)
					€ (223)	€ (145)	(0,06)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

30. Juni 2018

## ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	10-Year EUR-EURIBOR - 2-Year EUR-EURIBOR	1,250 %	16.11.2018	4.000	€ (2)	€ (1)	0,00
DUB	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	10-Year EUR-EURIBOR - 2-Year EUR-EURIBOR	1,250	16.11.2018	20.000	(10)	(3)	0,00
						€ (12)	€ (4)	0,00

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

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	€ 1.300	20.09.2018	€ 0	€ (2)	€ (2)	0,00
MYC	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	1.300	20.12.2018	0	0	0	0,00
MYI	Erhalt	iBoxx EUR Corporates	k. A.	3-Month EUR-EURIBOR	900	20.09.2018	1	3	4	0,00
							€ 1	€ 1	€ 2	0,00

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	08/2018	€	240	£	211	€ 0	€ (1)		
	08/2018	\$	1.116	\$	1.309	7	(5)		
	08/2018	£	242	€	276	3	0		
BPS	08/2018	SEK	86.445		8.326	49	0		
	08/2018	\$	22.214		18.581	0	(386)		
	07/2018	TRY	1.529	\$	318	0	(12)		
BRC	08/2018	€	263		310	2	0		
	08/2018	\$	525	€	450	2	0		
	08/2018	¥	29.100		229	4	0		
CBK	07/2018	DKK	49.960		6.709	3	0		
	07/2018	€	124	DKK	925	0	0		
	07/2018	\$	1.850	RUB	117.015	12	0		
DUB	08/2018	MXN	13.825	\$	663	0	(29)		
	08/2018	\$	843	€	699	0	(21)		
	08/2018		1.232	TRY	5.453	0	(54)		
FBF	09/2018	CNY	12.807	\$	1.945	13	0		
	07/2018	€	1.004	DKK	7.475	0	0		
	08/2018		529	SEK	5.430	0	(9)		
GLM	07/2018	\$	1.377	COP	3.963.076	0	(24)		
	07/2018		232	PLN	847	0	(5)		
	08/2018	RUB	23.389	\$	376	4	0		
HUS	07/2018		127.098		2.016	0	(8)		
	07/2018	TRY	2.348		508	0	(1)		
	07/2018	\$	158	RUB	10.083	3	0		
JPM	08/2018		2.320		146.678	7	(2)		
	09/2018		2.310	CNY	14.833	0	(64)		
	07/2018	COP	3.973.133	\$	1.456	89	0		
MSB	07/2018	€	5.786	DKK	43.065	0	(6)		
	08/2018	\$	1.776	€	1.513	4	(8)		
	08/2018		1.448	MXN	28.237	0	(20)		
RYL	07/2018	PLN	847	\$	249	20	0		
	08/2018	€	468	£	412	0	(3)		
	08/2018		1.105	NOK	10.595	7	0		
SCX	07/2018	DKK	1.580	€	212	0	0		
	08/2018	£	10.466		11.918	98	0		
	08/2018	ZAR	1.005	\$	79	5	0		
SOG	09/2018	CNY	2.032		316	8	0		
	05/2019	\$	84	TRY	433	0	(1)		
	07/2018		674	COP	1.925.618	0	(16)		
UAG	08/2018		€901	£	793	0	(6)		
							€ 340	€ (681)	€ (341)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ (526) (0,22)

Summe Anlagen

€ 254.765 108,60

Sonstige Aktiva und Passiva

€ (20.166) (8,60)

Nettovermögen

€ 234.599 100,00

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

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

- Reines Kapitalwertpapier.
- Wertpapier per Emissionstermin.
- 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) Mit dem Fonds verbunden.  
 (h) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 3.417 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 4.981 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von EUR 970 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	(0,650) %	29.06.2018	02.07.2018	€ 3.200	Kingdom of Belgium Government International Bond 1,000 % fällig am 22.06.2031	€ (3.227)	€ 3.200	€ 3.200	1,36
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 242	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	(213)	207	207	0,09
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>€ (3.440)</b>	<b>€ 3.407</b>	<b>€ 3.407</b>	<b>1,45</b>

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

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	€ 354	€ 251.383	€ 0	€ 251.737
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.911	1.117	0	3.028
<b>Summen</b>	<b>€ 2.265</b>	<b>€ 252.500</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 254.765</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	€ 8.659	€ 236.627	€ 0	€ 245.286
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.482)	1.851	(1)	368
<b>Summen</b>	<b>€ 7.177</b>	<b>€ 238.478</b>	<b>€ (1)</b>	<b>€ 245.654</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 der Wertpapieranlagen.

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:**

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
SCX	(0,380) %	24.04.2018	25.07.2018	€ (3.447)	€ (3.444)	(1,47)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>€ (3.444)</b>	<b>(1,47)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (333)	€ 450	€ 117
BPS	(9)	0	(9)
BRC	4	0	4
CBK	(76)	260	184
CKL	(38)	0	(38)
DUB	(12)	0	(12)
FBF	(29)	0	(29)
GLM	4	0	4
GST	(2)	0	(2)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
	€ (65)	€ 0	€ (65)
HUS	59	0	59
JPM	20	0	20
MSB	4	0	4
MYI	4	0	4
RYL	103	0	103
SCX	(138)	260	122
SOG	(22)	0	(22)
UAG			

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	67,95	81,47
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	31,22	7,00
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	8,14	7,95
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,81	(0,58)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,70	0,44
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,22)	0,29
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,47)	0,00

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Long Average Duration Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)	247.470	€ 25.058	PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)	154.800	€ 15.666
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
France Government International Bond 3,250 % fällig am 25.05.2045	€ 8.900	12.124	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,250 % fällig am 01.02.2019	€ 8.900	9.187
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,250 % fällig am 01.02.2019	8.900	9.252	France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048	7.000	7.416
Italy Certificati Di Credito Del Tesoro 0,532 % fällig am 15.12.2020	7.500	7.663	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,250 % fällig am 24.05.2033	4.300	4.317
Italy Certificati Di Credito Del Tesoro 0,929 % fällig am 15.11.2019	6.300	6.432	France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2066	3.200	3.074
Landwirtschaftliche Rentenbank 1,375 % fällig am 19.11.2020	4.600	4.814	Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 29.06.2018	3.000	3.008
Spain Government International Bonds 1,950 % fällig am 30.04.2026	4.300	4.562	Landwirtschaftliche Rentenbank 1,375 % fällig am 19.11.2020	2.600	2.714
Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 29.06.2018	3.000	3.008	State of Lower Saxony 0,000 % fällig am 01.03.2021	2.400	2.417
France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048	2.300	2.540	Spain Government International Bond 2,900 % fällig am 31.10.2046	2.200	2.364
State of Lower Saxony 0,000 % fällig am 01.03.2021	2.400	2.418	Netherlands Government International Bond 3,750 % fällig am 15.01.2042	1.500	2.336
Spain Government International Bond 2,900 % fällig am 31.10.2046	2.200	2.276	France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2055	1.300	2.055
SNCF Reseau EPIC 2,000 % fällig am 05.02.2048	1.900	1.868	Netherlands Government International Bond 2,750 % fällig am 15.01.2047	1.400	1.890
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2066	1.800	1.772	Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2047	DKK 13.100	1.772
Cooperatieve Rabobank UA 1,500 % fällig am 26.04.2038	1.500	1.499	Dexia Credit Local S.A. 0,250 % fällig am 02.06.2022	€ 1.600	1.606
Morgan Stanley 0,074 % fällig am 21.05.2021	1.300	1.300	Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 15.08.2046	1.200	1.557
CPPIB Capital Inc 1,500 % fällig am 04.03.2033	1.200	1.189	Barclays PLC 8,250 % fällig am 15.12.2018	\$ 1.700	1.485
Deutsche Hypothekenbank AG 0,929 % fällig am 22.03.2021	£ 1.000	1.132	Morgan Stanley 0,074 % fällig am 21.05.2021	€ 1.300	1.300
Gosforth Funding PLC 0,123 % fällig am 15.02.2058	€ 1.100	1.108	Spain Government International Bonds 3,450 % fällig am 30.07.2066	1.100	1.273
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 1.184	1.060	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0,221 % fällig am 12.10.2020	1.200	1.203
United Technologies Corp. 0,000 % fällig am 18.05.2020	€ 1.000	1.003	Ziggo Secured Finance BV 3,750 % fällig am 15.01.2025	1.200	1.200
			Ball Corp. 4,375 % fällig am 15.12.2023	1.000	1.137
			Barclays PLC 7,000 % fällig am 15.09.2019	£ 900	1.058
			Italy Certificati Di Credito Del Tesoro 0,929 % fällig am 15.11.2019	€ 1.000	1.012
			Bank Nederlandse Gemeenten NV 0,500 % fällig am 16.04.2025	1.000	1.000

(a) Der Euro Long Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



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>				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
Volkswagen International Finance NV 0,500 % fällig am 30.03.2021	€ 2.100	€ 2.109	0,31	Adagio CLO PLC 0,000 % fällig am 15.09.2022	€ 90	€ 91	0,01	Slovenia Government International Bond 4,125 % fällig am 26.01.2020	€ 1.900	€ 2.034	0,30	
Volvo Treasury AB 0,149 % fällig am 06.09.2019	300	300	0,04	Arbour CLO DAC 0,580 % fällig am 15.03.2029	700	700	0,10	Spain Government International Bond 0,750 % fällig am 30.07.2021	6.500	6.663	0,99	
ZF North America Capital, Inc. 2,250 % fällig am 26.04.2019	4.200	4.278	0,63	Babson Euro CLO BV 0,771 % fällig am 15.04.2027	250	250	0,04			45.775	6,77	
		97.782	14,46	Bavarian Sky S.A. 0,030 % fällig am 20.05.2024	1.860	1.865	0,28	<b>AKTIEN</b>				
				0,030 % fällig am 20.06.2025	5.070	5.089	0,75	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>				
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				Bumper NL Finance BV 0,030 % fällig am 22.07.2031	3.100	3.108	0,46	PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (d)	41.000	4.129	0,61	
British Telecommunications PLC 0,625 % fällig am 10.03.2021	7.300	7.382	1,09	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 0,751 % fällig am 15.04.2027	200	200	0,03					
Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 2,850 % fällig am 25.10.2019	CHF 7.450	6.602	0,98	0,780 % fällig am 16.04.2029	300	301	0,04					
3,375 % fällig am 30.11.2018	2.000	1.745	0,26	Compartment VCL 0,030 % fällig am 21.09.2023	3.212	3.221	0,48					
9,250 % fällig am 23.04.2019	\$ 300	268	0,04	Driver Espana Four FT 0,010 % fällig am 21.04.2028	195	196	0,03					
Optus Finance Pty. Ltd. 3,500 % fällig am 15.09.2020	€ 4.100	4.418	0,65	FCT Bavarian Sky France 0,720 % fällig am 30.10.2029	500	500	0,07					
Petrobras Global Finance BV 5,875 % fällig am 07.03.2022	3.200	3.560	0,53	Euro-Galaxy CLO BV 1,140 % fällig am 10.11.2030	200	201	0,03					
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. 5,298 % fällig am 30.09.2020	\$ 2.665	2.337	0,35	FCT Ginkgo Compartment Sales Finance 0,030 % fällig am 22.04.2025	3.492	3.501	0,52					
Telecom Italia SpA 6,125 % fällig am 14.12.2018	€ 300	308	0,04	Grosvenor Place CLO BV 0,720 % fällig am 30.10.2029	3.600	3.619	0,54					
		26.620	3,94	Jubilee CLO BV 0,479 % fällig am 15.12.2029	400	300	0,04	Letras del Banco Central de la Republica Argentina 25,600 % fällig am 18.07.2018	ARS 1.720	50	0,01	
				0,511 % fällig am 12.07.2028	300	399	0,06	25,800 % fällig am 18.07.2018	212	6	0,00	
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		497.325	73,57	Malin CLO BV 0,042 % fällig am 07.05.2023	2.268	2.270	0,34	40,700 % fällig am 18.07.2018	3.760	110	0,02	
				Quarzo CQS SRL 0,001 % fällig am 18.11.2033	976	977	0,15	<b>Nigeria Open Market Operation Bills</b>				
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				SC Germany Auto UG 0,031 % fällig am 13.12.2026	136	137	0,02	0,010 % fällig am 09.08.2018	NGN 100.000	234	0,04	
Berica Residential MBS SRL 0,000 % fällig am 26.07.2041	522	521	0,08	0,031 % fällig am 13.12.2027	3.100	3.116	0,46	12,080 % fällig am 13.12.2018	85.700	192	0,03	
Bluestep Mortgage Securities DAC 1,136 % fällig am 10.05.2063	SEK 1.747	169	0,02	SCF Rahoituspalvelut Kimi DAC 0,030 % fällig am 25.11.2026	1.765	1.771	0,26	15,190 % fällig am 23.08.2018	12.000	28	0,00	
Cartesian Residential Mortgages S.A. 0,000 % fällig am 18.11.2051	€ 7.212	7.209	1,07	Silver Arrow S.A. 0,080 % fällig am 17.03.2025	2.016	2.023	0,30	15,294 % fällig am 09.08.2018	100.000	234	0,04	
0,771 % fällig am 18.07.2044	2.350	2.366	0,35	Sunrise SPV 0,189 % fällig am 27.06.2041	1.946	1.952	0,29	15,298 % fällig am 09.08.2018	100.000	234	0,03	
Duncan Funding PLC 0,071 % fällig am 17.04.2063	193	194	0,03	Tymon Park CLO Ltd. 0,590 % fällig am 21.01.2029	300	300	0,04	15,302 % fällig am 06.09.2018	100.000	232	0,03	
0,159 % fällig am 17.12.2062	3.600	3.620	0,53							1.320	0,20	
Dutch Property Finance BV 0,352 % fällig am 28.01.2048	3.558	3.583	0,53	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>				
Eurocall PLC 0,000 % fällig am 13.03.2045	3.121	3.087	0,46	Argentina Government International Bond 0,010 % fällig am 15.08.2018	ARS 5.600	158	0,02	1,138 % fällig am 24.08.2018 (a)(b)	\$ 100	85	0,01	
FCT Credit Agricole Habitat 0,000 % fällig am 27.06.2052	2.148	2.156	0,32	3,875 % fällig am 15.01.2022	€ 1.000	961	0,14	1,183 % fällig am 10.08.2018 (a)(b)	1.000	853	0,13	
FT RMBS Prado 0,139 % fällig am 15.03.2056	5.670	5.687	0,84	Autonomous Community of Andalusia 4,850 % fällig am 17.03.2020	900	975	0,15	2,493 % fällig am 14.09.2018 (a)(b)	200	170	0,03	
Gosforth Funding PLC 0,122 % fällig am 24.07.2058	1.277	1.279	0,19	5,200 % fällig am 15.07.2019	8.330	8.792	1,30	2,799 % fällig am 27.07.2018 (a)(b)	1.500	1.281	0,19	
0,123 % fällig am 15.02.2058	600	603	0,09	Autonomous Community of Catalonia 4,900 % fällig am 15.09.2021	200	217	0,03	3,100 % fällig am 26.10.2018 (a)(b)	200	169	0,02	
Great Hall Mortgages PLC 0,000 % fällig am 18.03.2039	106	105	0,02	4,950 % fällig am 11.02.2020	7.100	7.515	1,11	3,100 % fällig am 11.01.2019 (a)(b)	1.500	1.260	0,19	
Grecale ABS SRL 0,031 % fällig am 28.04.2056	235	235	0,03	Autonomous Community of Valencia 4,900 % fällig am 17.03.2020	5.339	5.758	0,85	3,100 % fällig am 25.01.2019 (a)(b)	2.000	1.681	0,25	
Hawksmoor Mortgages PLC 2,011 % fällig am 25.05.2053	€ 305	348	0,05	Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social 3,625 % fällig am 21.01.2019	600	610	0,09	3,110 % fällig am 16.11.2018 (a)(b)	200	168	0,02	
Lanark Master Issuer PLC 0,124 % fällig am 22.12.2054	€ 5.600	5.621	0,83	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 3,750 % fällig am 25.10.2020	6.966	7.644	1,13	3,120 % fällig am 28.09.2018 (a)(b)	100	85	0,01	
Permanent Master Issuer PLC 0,091 % fällig am 15.07.2042	1.600	1.607	0,24	Cyprus Government International Bond 3,875 % fällig am 06.05.2022	2.900	3.186	0,47	25,800 % fällig am 19.09.2018 (a)(b)	ARS 1.288	35	0,01	
Residential Mortgage Securities PLC 1,429 % fällig am 20.03.2050	€ 4.286	4.859	0,72	Export-Import Bank of Korea 2,000 % fällig am 30.04.2020	600	621	0,09			5.787	0,86	
RMBS Prado FT 0,579 % fällig am 17.03.2056	€ 3.415	3.457	0,51	Korea Government International Bond 4,250 % fällig am 07.12.2021	200	229	0,04	<b>FRANCE TREASURY BILLS</b>				
SapphireOne Mortgages FCT 0,177 % fällig am 25.02.2061	3.578	3.591	0,53	Republic of Greece Government International Bond 4,750 % fällig am 17.04.2019	400	412	0,06	(0,585)% fällig am 26.09.2018 (a)(b)	€ 1.250	1.252	0,18	
0,177 % fällig am 25.06.2061	437	440	0,06					<b>GREECE TREASURY BILLS</b>				
0,177 % fällig am 27.06.2061	533	536	0,08					0,800 % fällig am 13.07.2018 (a)(b)	600	600	0,09	
Silverstone Master Issuer PLC 0,000 % fällig am 21.01.2070	6.000	6.010	0,89					1,082 % fällig am 05.10.2018 (a)(b)	2.000	1.996	0,29	
Taurus DEU DAC 1,280 % fällig am 03.01.2027	66	67	0,01							2.596	0,38	
Taurus DEU Ltd. 0,800 % fällig am 01.02.2026	274	274	0,04					<b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>				
		61.185	9,05					15,151 % fällig am 04.10.2018	(a)(b) NGN 100.000	231	0,04	
								15,152 % fällig am 13.09.2018 (a)(b)	100.000	231	0,04	
								15,400 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	100.000	231	0,04	
								15,448 % fällig am 20.09.2018 (a)(b)	100.000	231	0,04	
								15,498 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	100.000	231	0,03	
								15,542 % fällig am 11.10.2018 (a)(b)	100.000	230	0,03	
								15,566 % fällig am 29.11.2018 (a)(b)	100.000	226	0,03	
								15,603 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	100.000	231	0,03	
								15,609 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	100.000	231	0,03	
								15,646 % fällig am 01.11.2018 (a)(b)	12.000	27	0,00	
										2.100	0,31	
								Summe kurzfristige Instrumente		21.977	3,25	
								<b>Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt</b>	€ 666.678	98,62		

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Low Duration 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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor June Futures	Long	06/2019	1.136	€ 251	0,04
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 161,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	90	(140)	(0,02)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 163,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	51	(22)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 166,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	46	(3)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 99,500 EUR auf Euribor 3-Year Mid Curve December 2018 Futures	Short	12/2018	621	(137)	(0,02)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09/2018	183	(77)	(0,01)
Euro-Schatz September Futures	Long	09/2018	464	49	0,01
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	39	65	0,01
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 131,250 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Short	08/2018	60	10	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 131,500 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Short	08/2018	61	13	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 155,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	92	(3)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 156,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	90	42	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 98,500 EUR auf Euribor 3-Year Mid Curve December 2018 Futures	Short	12/2018	621	19	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 98,750 EUR auf Euribor 3-Year Mid Curve December 2018 Futures	Long	12/2018	621	(39)	(0,01)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 99,125 EUR auf Euribor 2-Year Mid Curve December 2018 Futures	Long	12/2018	254	(48)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	360	57	0,01
				€ 37	0,00

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CME 90-Day Eurodollar December 2018 Futures	\$ 96,875	14.12.2018	244	€ (51)	€ (68)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					€ (31)	(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-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	1,000 %	20.06.2019	€ 1.400	€ 2	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2019	500	1	0,00
				€ 3	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750 %	20.12.2047	\$ 9.500	€ 440	0,07
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,000	21.03.2048	¥ 1.435.000	(463)	(0,07)
					€ (23)	0,00
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ (20)	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	15.08.2018	€ 21.300	€ (46)	€ (25)	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	\$ 4.400	(4)	(2)	0,00
						€ (50)	€ (27)	0,00

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BOA	07/2018	€	\$	0	(8)	(8)	0,00
	08/2018	ARS		30	0	30	0,00
	08/2018	CZK		28	0	28	0,00
	08/2018	£	€	0	0	0	0,00
	08/2018	SEK		219	0	219	0,03
	08/2018	\$	CZK	0	(367)	(367)	(0,05)
	08/2018		RUB	0	(106)	(106)	(0,02)
	09/2018	ARS	\$	14	0	14	0,00
	07/2018	€		53	0	53	0,01
BPS	07/2018	\$	€	176	0	176	0,03
	07/2018		TRY	0	(52)	(52)	(0,01)
	08/2018	ARS	\$	26	0	26	0,00
BRC	08/2018	\$	RUB	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018		€	0	(21)	(21)	0,00
CBK	08/2018	RUB	\$	0	0	0	0,00
	07/2018	\$	ARS	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018		TRY	7	0	7	0,00
DUB	08/2018	MXN	\$	0	(68)	(68)	(0,01)
	08/2018	\$	CZK	2	0	2	0,00
	08/2018		MXN	1	(124)	(123)	(0,02)
	07/2018	ARS	\$	3	0	3	0,00
FBF	07/2018	TRY		0	(66)	(66)	(0,01)
	07/2018	\$	COP	0	(41)	(41)	(0,01)
	07/2018			0	(64)	(64)	(0,01)
GLM	07/2018	€	\$	60	0	60	0,01
	07/2018	\$	€	0	(30)	(30)	0,00
	08/2018	CHF		0	0	0	0,00
	08/2018	€	SEK	0	(14)	(14)	0,00
HUS	08/2018	RUB	\$	2	0	2	0,00
	08/2018	SEK	€	239	0	239	0,03
	07/2018	ARS	\$	31	0	31	0,00
	07/2018	TRY		0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	\$	ARS	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	ARS	\$	7	0	7	0,00
JPM	08/2018	RUB		9	0	9	0,00
	07/2018	\$	€	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	NGN	\$	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018			0	(7)	(7)	0,00
MSB	10/2018			0	(27)	(27)	0,00
	07/2018	COP		147	0	147	0,02
	07/2018	\$	€	0	(3)	(3)	0,00
NGF	07/2018	ARS	\$	1	0	1	0,00
RBC	08/2018	CHF	€	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	€	NOK	2	0	2	0,00
RYL	08/2018			37	0	37	0,01
	08/2018		SEK	0	(19)	(19)	0,00
SCX	08/2018	SEK	€	46	0	46	0,01
	08/2018	CHF		0	(307)	(307)	(0,05)
	08/2018	£		75	0	75	0,01
	08/2018	¥		0	(10)	(10)	0,00
	08/2018	NGN	\$	0	(22)	(22)	0,00
	08/2018	\$	TRY	0	(165)	(165)	(0,02)
SSB	09/2018	NGN	\$	0	(15)	(15)	0,00
	10/2018			0	(13)	(13)	0,00
	11/2018			0	(6)	(6)	0,00
	07/2018	€		0	(80)	(80)	(0,01)
UAG	08/2018	CHF	€	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	\$		78	0	78	0,01
	08/2018		MXN	8	0	8	0,00
				€ 1.301	€ (1.649)	€ (348)	(0,05)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ (375)	(0,05)
Summe Anlagen						€ 666.252	98,56
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 9.727	1,44
Nettovermögen						€ 675.979	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.

- (a) Nullkuponwertpapier.
- (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (d) Mit dem Fonds verbunden.
- (e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Low Duration Fund (Forts.)

Barmittel in Höhe von EUR 3.487 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 1.279 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(f) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	(0,650) %	29.06.2018	02.07.2018	€ 8.300	Kingdom of Belgium Government International Bond 1,000 % fällig am 22.06.2031	€ (8.370)	€ 8.300	€ 8.300	1,23
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	\$ 726	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	(635)	622	622	0,09
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>€ (9.005)</b>	<b>€ 8.922</b>	<b>€ 8.922</b>	<b>1,32</b>

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

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	€ 666.678	€ 0	€ 666.678
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(31)	(395)	0	(426)
<b>Summen</b>	<b>€ (31)</b>	<b>€ 666.283</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 666.252</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	€ 1.126	€ 427.299	€ 0	€ 428.425
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(71)	153	0	82
<b>Summen</b>	<b>€ 1.055</b>	<b>€ 427.452</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 428.507</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (190)	€ 490	€ 300
BPS	202	(90)	112
BRC	(46)	0	(46)
CBK	(184)	250	66
DUB	(104)	(60)	(164)
FBF	(64)	0	(64)
GLM	257	(223)	34
HUS	43	(20)	23
JPM	(39)	0	(39)
MSB	144	0	144
NGF	1	0	1
RBC	1	0	1
RYL	64	(330)	(266)
SCX	(463)	530	67
SSB	(5)	9	4
UAG	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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	91,55	97,43
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	4,73	0,95
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	2,34	0,27
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,05)	0,04

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Low Duration Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
Spain Government Bond 1,150 % fällig am 30.07.2020	€ 54.200	€ 55.897	Spain Government Bond 1,150 % fällig am 30.07.2020	€ 54.200	€ 55.709
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 13.12.2019	34.700	35.080	Italy Certificati Di Credito Del Tesoro 0,532 % fällig am 15.12.2020	45.000	44.988
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.03.2018	21.140	21.158	Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 13.12.2019	34.700	35.090
Sveriges Sakerstallida Obligationer AB 1,000 % fällig am 17.03.2021	SEK 166.000	16.617	France Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.03.2018	21.140	21.156
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,625 % fällig am 20.01.2020	€ 14.400	15.474	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,350 % fällig am 15.06.2020	17.600	17.757
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,350 % fällig am 15.06.2020	15.300	15.430	Dexia Credit Local S.A. 1,375 % fällig am 18.09.2019	15.800	16.225
Netherlands Government Bond 1,250 % fällig am 15.01.2019	15.000	15.254	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,625 % fällig am 20.01.2020	14.400	15.470
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,500 % fällig am 22.01.2020	11.100	11.456	Netherlands Government Bond 1,250 % fällig am 15.01.2019	15.000	15.254
France Treasury Bill BTF 0,000 % fällig am 29.08.2018	11.190	11.210	France Treasury Bill BTF 0,000 % fällig am 29.08.2018	11.190	11.210
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,625 % fällig am 15.01.2021	10.600	11.162	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,625 % fällig am 15.01.2021	10.600	11.157
Europäische Union 3,500 % fällig am 04.06.2021	10.000	11.140	French Republic Government Bond OAT 0,000 % fällig am 25.02.2021	11.000	11.121
French Republic Government Bond OAT 0,000 % fällig am 25.02.2021	11.000	11.109	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,875 % fällig am 20.03.2019	9.000	9.162
Nordea Hypotek AB 1,250 % fällig am 19.05.2021	SEK 104.800	10.381	France Treasury Bill BTF 0,000 % fällig am 12.09.2018	9.000	9.013
FMS Wertmanagement 1,375 % fällig am 15.01.2020	€ 10.000	10.291	Bank Nederlandse Gemeenten NV 3,875 % fällig am 04.11.2019	8.053	8.681
FMS Wertmanagement 0,125 % fällig am 16.04.2020	10.000	10.098	Skandinaviska Enskilda Banken AB 3,000 % fällig am 19.06.2019	SEK 77.500	8.057
Bank Nederlandse Gemeenten NV 1,500 % fällig am 15.04.2020	9.700	10.069	FMS Wertmanagement 1,875 % fällig am 09.05.2019	€ 7.400	7.634
UBS AG/London 0,179 % fällig am 23.04.2021	9.700	9.772	Nordea Hypotek AB 2,250 % fällig am 19.06.2019	SEK 69.100	7.117
Lansforsakringar Hypotek AB 3,250 % fällig am 16.09.2020	SEK 88.100	9.705	Autobahnen- und Schnellstrassen-Finanzierungs AG 4,375 % fällig am 08.07.2019	€ 6.463	6.938
			Slovenia Government International Bond 4,125 % fällig am 18.02.2019	\$ 8.300	6.856
				<b>AKTIEN</b>	
<b>PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)</b>	94.500	9.555	<b>PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)</b>	64.600	6.544
				<b>PARI (000S)</b>	
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,875 % fällig am 20.03.2019	£ 9.000	9.164	Swedbank Hypotek AB 3,750 % fällig am 19.06.2019	SEK 56.700	5.951
France Treasury Bill BTF 0,000 % fällig am 12.09.2018	9.000	9.013	Santander International Debt S.A. 4,000 % fällig am 24.01.2020	€ 5.500	5.930
Stadshypotek AB 4,250 % fällig am 17.06.2020	SEK 76.000	8.514	Intesa Sanpaolo SpA 0,622 % fällig am 19.04.2022	5.600	5.701
Volkswagen Bank GmbH 0,099 % fällig am 15.06.2021	€ 8.500	8.507	HSBC Holdings PLC 3,375 % fällig am 10.01.2024	5.000	5.141
Dexia Credit Local S.A. 2,000 % fällig am 22.01.2021	7.900	8.392	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,125 % fällig am 01.06.2020	5.000	5.059
Morgan Stanley 0,074 % fällig am 21.05.2021	8.200	8.200	Continental AG 0,000 % fällig am 05.02.2020	5.000	5.009
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,125 % fällig am 01.06.2020	8.000	8.094	UNEDIC 1,250 % fällig am 29.05.2020	4.700	4.866
			G4S International Finance PLC 2,625 % fällig am 06.12.2018	4.800	4.858

(a) Der Euro Low Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Short-Term 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
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGLTER MARKT				ING Bank NV 3,500 % fällig am 21.11.2023	€ 2.800	€ 2.836	0,27	Anheuser-Busch InBev S.A. 0,429 % fällig am 17.03.2020	€ 2.700	€ 2.732	0,26
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Intesa Sanpaolo SpA 2,750 % fällig am 20.03.2020	2.500	2.584	0,24	AP Moller - Maersk A/S 1,750 % fällig am 18.03.2021	1.400	1.455	0,14
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				5,000 % fällig am 25.10.2018	3.500	3.555	0,34	3,375 % fällig am 28.08.2019	6.442	6.697	0,63
ASR Nederland NV 10,000 % fällig am 26.10.2019 (d)	€ 2.500	€ 2.769	0,26	KBC Group NV 2,375 % fällig am 25.11.2024	1.700	1.748	0,16	BAT Capital Corp. 0,174 % fällig am 16.08.2021	3.600	3.600	0,34
Banco Popular Espanol S.A. 0,750 % fällig am 29.09.2020	700	712	0,07	Landesbank Baden-Wuerttemberg 0,893 % fällig am 18.05.2021	£ 3.100	3.506	0,33	BAT International Finance PLC 0,375 % fällig am 13.03.2019	5.000	5.010	0,47
Bank of America Corp. 0,047 % fällig am 21.09.2021	8.200	8.188	0,77	Lansforsakringar Hypotek AB 3,250 % fällig am 16.09.2020	SEK 192.000	19.791	1,87	Bayer Capital Corp. BV 0,227 % fällig am 26.06.2022	800	803	0,08
1,875 % fällig am 10.01.2019	3.000	3.033	0,29	LeasePlan Corp. NV 2,375 % fällig am 23.04.2019	€ 4.300	4.381	0,41	Buzzi Unicem SpA 6,250 % fällig am 28.09.2018	2.000	2.029	0,19
Bank of China Ltd. 0,144 % fällig am 22.11.2020	700	700	0,07	Lincoln Finance Ltd. 6,875 % fällig am 15.04.2021	2.100	2.175	0,21	Cappemini SE 0,521 % fällig am 02.07.2018	4.900	4.900	0,46
0,171 % fällig am 17.04.2021	7.000	7.006	0,66	Lloyds Bank PLC 0,172 % fällig am 09.10.2018	9.500	9.512	0,90	Continental AG 3,000 % fällig am 16.07.2018	4.700	4.706	0,44
Bank of China Luxembourg S.A. 0,342 % fällig am 20.04.2020	600	603	0,06	6,500 % fällig am 24.03.2020	4.700	5.190	0,49	Deutsche Telekom International Finance BV 0,029 % fällig am 03.04.2020	2.300	2.307	0,22
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 2,000 % fällig am 19.09.2019	10.000	10.263	0,97	10,375 % fällig am 12.02.2024	6.773	7.206	0,68	Essity AB 0,000 % fällig am 27.11.2018 (b)	6.900	6.905	0,65
Barclays Bank PLC 14,000 % fällig am 15.06.2019 (d)	£ 3.000	3.756	0,35	Morgan Stanley 0,052 % fällig am 09.11.2021	10.700	10.656	1,01	Fortum Oyj 6,000 % fällig am 20.03.2019	3.034	3.166	0,30
BNP Paribas S.A. 0,224 % fällig am 20.05.2019	€ 3.300	3.314	0,31	0,074 % fällig am 21.05.2021	2.600	2.597	0,25	G4S International Finance PLC 2,625 % fällig am 06.12.2018	3.800	3.844	0,36
Caisse Centrale du Credit Immobilier de France S.A. 0,500 % fällig am 11.07.2018	2.900	2.900	0,27	Nationwide Building Society 6,750 % fällig am 23.07.2020	1.400	1.583	0,15	General Mills, Inc. 0,401 % fällig am 15.01.2020	4.000	4.036	0,38
Citigroup, Inc. 0,223 % fällig am 11.11.2019	8.700	8.750	0,83	Netwest Markets PLC 0,079 % fällig am 02.03.2020	800	800	0,08	Glencore Finance Dubai Ltd. 2,625 % fällig am 19.07.2018	7.200	7.268	0,69
7,375 % fällig am 04.09.2019	2.000	2.175	0,21	Nordea Hypotek AB 3,250 % fällig am 17.06.2020	SEK 261.000	26.729	2,52	HeidelbergCement Finance Luxembourg S.A. 9,500 % fällig am 15.12.2018	6.600	6.889	0,65
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co. Ltd. 7,500 % fällig am 24.07.2039	2.000	2.144	0,20	Programa Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos 4,000 % fällig am 23.10.2018	€ 3.700	3.748	0,35	Imperial Brands Finance PLC 4,500 % fällig am 05.07.2018	6.600	6.602	0,62
CNP Assurances 7,500 % fällig am 18.10.2018 (d)(e)	\$ 400	346	0,03	QNB Finance Ltd. 1,880 % fällig am 02.08.2018	\$ 2.300	1.968	0,19	INEOS Grangemouth PLC 0,750 % fällig am 30.07.2019	2.900	2.946	0,28
Cooperative Rabobank UA 0,000 % fällig am 27.11.2019	SEK 44.000	4.181	0,39	3,657 % fällig am 31.05.2021	7.400	6.397	0,60	Leonardo SpA 5,750 % fällig am 12.12.2018	3.500	3.589	0,34
6,875 % fällig am 19.03.2020 (e)	€ 3.100	3.442	0,32	RCI Banque S.A. 0,251 % fällig am 16.07.2018	€ 7.500	7.502	0,71	Mercedes-Benz Japan Co. Ltd. 0,100 % fällig am 20.11.2020	7.900	7.900	0,75
Credit Suisse AG 0,375 % fällig am 11.04.2019	5.000	5.024	0,47	Royal Bank of Scotland Group PLC 3,625 % fällig am 25.03.2024	8.500	8.663	0,82	Molson Coors Brewing Co. 0,029 % fällig am 15.03.2019	4.400	4.404	0,42
de Volksbank NV 3,750 % fällig am 05.11.2025	3.800	4.033	0,38	Santander UK PLC 0,077 % fällig am 27.02.2020	6.400	6.426	0,61	Mylan NV 0,176 % fällig am 24.05.2020	7.500	7.515	0,71
Deutsche Bank AG 0,178 % fällig am 07.12.2020	1.000	979	0,09	0,299 % fällig am 22.05.2019	8.300	8.338	0,79	National Express Group PLC 0,073 % fällig am 15.05.2020	1.000	999	0,09
0,221 % fällig am 15.04.2019	8.200	8.177	0,77	Scentre Group Trust 0,321 % fällig am 16.07.2018	2.700	2.701	0,25	Origin Energy Finance Ltd. 2,875 % fällig am 11.10.2019	1.800	1.865	0,18
1,875 % fällig am 28.02.2020	£ 200	224	0,02	Slovenska izvozna in razvojna banka DD 0,875 % fällig am 04.08.2018	700	701	0,07	ProSiebenSat.1 Media SE 2,625 % fällig am 15.04.2021	1.400	1.466	0,14
Deutsche Hypothekbank AG 0,929 % fällig am 22.03.2021	6.400	7.237	0,68	Stadshypotek AB 2,500 % fällig am 18.09.2019	SEK 180.000	17.847	1,69	Renault S.A. 0,750 % fällig am 26.11.2018	¥ 1.300.000	10.078	0,95
Deutsche Pfandbriefbank AG 1,875 % fällig am 20.12.2019	900	1.029	0,10	3,275 % fällig am 06.04.2020	SEK 258.000	26.918	2,54	Roche Holdings, Inc. 2,674 % fällig am 30.09.2019	\$ 5.600	4.815	0,45
Dexia Credit Local S.A. 0,040 % fällig am 11.12.2019	€ 25.600	25.733	2,43	State Bank of India 1,000 % fällig am 16.12.2020	\$ 17.300	14.868	1,40	Safran S.A. 0,000 % fällig am 28.06.2019	€ 4.700	4.707	0,44
0,250 % fällig am 19.03.2020	3.200	3.231	0,30	Swedbank Hypotek AB 1,000 % fällig am 16.12.2020	SEK 323.000	31.789	3,00	Schaeffler Finance BV 3,500 % fällig am 15.05.2022	1.500	1.513	0,14
Europäischer Stabilitätsmechanismus 0,875 % fällig am 15.10.2019	20.000	20.351	1,92	UBS AG 0,171 % fällig am 10.01.2020	€ 2.000	2.009	0,19	Sky PLC 0,426 % fällig am 01.04.2020	7.100	7.158	0,68
FCE Bank PLC 1,875 % fällig am 18.04.2019	3.500	3.556	0,34	0,172 % fällig am 23.04.2021	14.800	14.869	1,40	Symrise AG 1,750 % fällig am 10.07.2019	1.050	1.067	0,10
FMS Wertmanagement 0,000 % fällig am 20.10.2020 (b)	13.000	13.117	1,24	Vesteda Finance BV 1,750 % fällig am 22.07.2019	500	507	0,05	Telefonica Emisiones S.A.U. 4,710 % fällig am 20.01.2020	6.200	6.659	0,63
1,375 % fällig am 15.01.2020	20.000	20.569	1,94	Volkswagen Financial Services AG 0,021 % fällig am 11.10.2019	8.600	8.606	0,81	Tesco Corporate Treasury Services PLC 1,375 % fällig am 01.07.2019	200	203	0,02
Ford Motor Credit Co. LLC 0,103 % fällig am 14.05.2021	7.600	7.581	0,72	Vonovia Finance BV 0,024 % fällig am 20.11.2019	2.600	2.605	0,25	Tesco PLC 3,375 % fällig am 02.11.2018	6.900	6.979	0,66
GE Capital European Funding Unlimited Co. 0,352 % fällig am 21.01.2020	1.000	1.003	0,09	Wells Fargo & Co. 0,099 % fällig am 02.06.2020	6.600	6.621	0,63	Teva Pharmaceutical Finance BV 1,500 % fällig am 25.10.2018	CHF 2.300	1.990	0,19
General Motors Financial Co., Inc. 0,376 % fällig am 29.05.2020	4.300	4.325	0,41	Yorkshire Building Society 2,125 % fällig am 18.03.2019	£ 8.400	8.529	0,81	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 0,125 % fällig am 27.07.2018	500	431	0,04
0,422 % fällig am 29.10.2019	2.800	2.818	0,27	4,125 % fällig am 20.11.2024	£ 2.400	2.792	0,26	Thermo Fisher Scientific, Inc. 0,000 % fällig am 24.07.2019	€ 1.000	1.002	0,09
3,680 % fällig am 08.08.2018	AUD 700	443	0,04			510.907	48,26	thyssenkrupp AG 3,125 % fällig am 25.10.2019	2.360	2.430	0,23
5,000 % fällig am 08.08.2018	1.260	800	0,08								
Hammerston PLC 2,750 % fällig am 26.09.2019	€ 3.365	3.478	0,33	<b>INDUSTRIEWERTE</b>							
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0,221 % fällig am 12.10.2020	7.900	7.906	0,75	AbbVie, Inc. 0,375 % fällig am 18.11.2019	€ 5.000	5.027	0,48				
0,275 % fällig am 23.05.2020	800	802	0,08	Air Liquide S.A. 2,908 % fällig am 12.10.2018	2.000	2.017	0,19				
				Amgen, Inc. 2,125 % fällig am 13.09.2019	5.100	5.237	0,49				

BESCHREIBUNG	PARI	MARKT- TWER	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI	MARKT- TWER	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI	MARKT- TWER	% DES NETTO- VERMÖ- GENS			
<b>STAAATSEMISSIONEN</b>														
Toyota Motor Finance Netherlands BV 0,022 % fällig am 27.04.2020	€	3.700	3,718	0,35	0,000 % fällig am 27.03.2038	€	1.762	1,763	0,17	Autonomous Community of Catalonia 4,950 % fällig am 11.02.2020	€	600	635	0,06
United Technologies Corp. 0,000 % fällig am 18.05.2020		5.500	5,513	0,52	Asset-Backed European Securitisation Transaction Fifteen SRL 0,030 % fällig am 15.04.2031		6.000	5,999	0,57	Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social 3,625 % fällig am 21.01.2019	€	2.700	2,744	0,26
Volvo Treasury AB 0,149 % fällig am 06.09.2019		9.700	9,698	0,92	Asset-Backed European Securitisation Transaction Thirteen FT 0,030 % fällig am 23.08.2030		2.000	2,003	0,19	Caisse Francaise de Financement Local 0,359 % fällig am 20.11.2018		2.800	2,792	0,26
ZF North America Capital, Inc. 2,250 % fällig am 26.04.2019		3.000	3,056	0,29	Bavarian Sky Europe S.A. 0,030 % fällig am 15.07.2026		3.000	3,006	0,28	Italy Certificati Di Credito Del Tesoro 0,532 % fällig am 15.12.2020		104.200	103,219	9,75
			186,931	17,65	Bavarian Sky S.A. 0,030 % fällig am 22.11.2023		5,262	5,268	0,50	Korea Development Bank 2,875 % fällig am 22.08.2018	\$	380	326	0,03
					0,030 % fällig am 20.05.2024		1,240	1,243	0,12				109,716	10,36
					0,030 % fällig am 20.10.2024		7,358	7,382	0,70					
<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>														
<b>COMMERCIAL PAPER</b>														
Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 2,850 % fällig am 25.10.2019	CHF	1.100	975	0,09	Bumper NL Finance BV 0,030 % fällig am 22.07.2031		12,100	12,130	1,15	Syngenta Finance NV 0,193 % fällig am 30.07.2018	€	5,000	5,002	0,47
3,375 % fällig am 30.11.2018		9,400	8,204	0,78	Bumper S.A. 0,260 % fällig am 23.03.2026		6,549	6,564	0,62					
Innogy Finance BV 6,500 % fällig am 20.04.2021	€	400	513	0,05	Bumper UK Finance PLC 1,038 % fällig am 20.11.2027	£	323	365	0,03					
Madriena Red de Gas Finance BV 3,779 % fällig am 11.09.2018	€	4,000	4,029	0,38	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,730 % fällig am 21.09.2029	€	200	200	0,02					
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 1,750 % fällig am 29.09.2019	\$	3,400	2,860	0,27	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 0,654 % fällig am 15.08.2027		300	300	0,03					
SSE PLC 5,000 % fällig am 01.10.2018	€	1,800	2,055	0,19	0,751 % fällig am 15.04.2027		3,297	3,302	0,31					
Telecom Italia SpA 6,125 % fällig am 14.12.2018	€	1,200	1,232	0,12	Cars Alliance Auto Loans France 0,030 % fällig am 21.10.2029		12,600	12,666	1,20					
Telenor ASA 2,375 % fällig am 19.03.2019	SEK	20,000	1,948	0,18	Compartment VCL 0,030 % fällig am 21.09.2023		4,307	4,318	0,41					
			21,816	2,06	Driver Australia Four Trust 2,920 % fällig am 15.08.2027	AUD	1,034	655	0,06					
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			719,654	67,97	Driver Espana Four FT 0,010 % fällig am 21.04.2028	€	11,135	11,168	1,05					
					Driver Italia One SRL 0,030 % fällig am 21.04.2029		5,262	5,259	0,50					
<b>NON-AGENCY-MBS</b>														
Arena NHG BV 0,000 % fällig am 17.06.2048	€	3,100	3,114	0,30	FCT Bavarian Sky France 0,030 % fällig am 22.04.2025		6,434	6,449	0,61					
Bluestep Mortgage Securities DAC 0,392 % fällig am 10.08.2066		3,234	3,253	0,31	FCT Ginkgo Compartment Personal Loans 0,000 % fällig am 18.01.2039		262	263	0,02					
1,136 % fällig am 10.05.2063	SEK	3,564	344	0,03	FCT Titrisocram 0,080 % fällig am 25.07.2036		10,000	10,062	0,95					
Cartesian Residential Mortgages S.A. 0,771 % fällig am 18.07.2044	€	6,768	6,816	0,64	0,110 % fällig am 25.11.2035		816	818	0,08					
Dolphin Master Issuer BV 0,047 % fällig am 28.09.2099		8,500	8,523	0,81	Flexi ABS Trust 2,660 % fällig am 23.05.2019	AUD	602	381	0,04					
Duncan Funding PLC 0,071 % fällig am 17.04.2063		725	727	0,07	3,080 % fällig am 23.06.2023		500	317	0,03					
Eurosall PLC 0,000 % fällig am 13.03.2045		229	227	0,02	Globaldrive Auto Receivables BV 0,030 % fällig am 20.08.2025	€	664	667	0,06					
Gosforth Funding PLC 0,122 % fällig am 24.07.2058		1,477	1,480	0,14	0,130 % fällig am 20.08.2024		839	843	0,08					
Grecale ABS SRL 0,031 % fällig am 28.04.2056		863	862	0,08	Highway BV 0,060 % fällig am 26.05.2025		1,334	1,335	0,13					
Hawksmoor Mortgages PLC 2,011 % fällig am 25.05.2053	€	3,053	3,480	0,33	Purple Master Credit Cards 0,000 % fällig am 25.10.2028		1,000	1,001	0,09					
Lanark Master Issuer PLC 0,074 % fällig am 22.12.2054	€	2,360	2,361	0,22	Quarzo QQS SRL 0,001 % fällig am 18.11.2033		2,504	2,506	0,24					
Liberty Funding Pty. Ltd. 2,562 % fällig am 10.10.2049	AUD	854	541	0,05	Red & Black Auto Germany UG 0,130 % fällig am 15.09.2025		3,404	3,418	0,32					
Pepper Residential Securities Trust 2,565 % fällig am 16.09.2059		733	464	0,04	Red & Black Auto Lease Germany S.A. 0,030 % fällig am 15.11.2027		2,915	2,921	0,28					
Residential Mortgage Securities PLC 1,781 % fällig am 15.06.2046	€	656	747	0,07	SC Germany Auto UG 0,031 % fällig am 13.12.2026		2,655	2,665	0,25					
RMBS Prado FT 0,579 % fällig am 17.03.2056	€	4,098	4,148	0,39	SCF Rahoituspalvelut Kimi DAC 0,030 % fällig am 25.11.2026		4,166	4,181	0,39					
SapphireOne Mortgages FCT 0,177 % fällig am 25.02.2061		8,915	8,948	0,85	Silver Arrow S.A. 0,080 % fällig am 17.03.2025		7,938	7,967	0,75					
0,177 % fällig am 27.06.2061		2,597	2,613	0,25	SLM Student Loan Trust 0,000 % fällig am 15.12.2023		82	82	0,01					
Silverstone Master Issuer PLC 0,000 % fällig am 21.01.2070		6,500	6,511	0,62	0,000 % fällig am 25.01.2024		313	313	0,03					
TORRENS Trust 3,020 % fällig am 14.09.2041	AUD	1,572	996	0,09	0,000 % fällig am 17.06.2024		262	262	0,02					
Uropa Securities PLC 0,000 % fällig am 10.10.2040	€	852	853	0,08	Sunrise SPV SRL 0,029 % fällig am 27.11.2041		900	902	0,08					
			57,008	5,39	Wizink Master Credit Cards FT 0,080 % fällig am 26.12.2031		2,100	2,105	0,20					
							133,954	12,65						
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>														
Adagio CLO PLC 0,000 % fällig am 15.09.2022 (a)(b)		530	530	0,05										
0,000 % fällig am 15.09.2022		375	375	0,03										

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Short-Term Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
15,646 % fällig am 01.11.2018 (b)(c) NGN	38.000	€ 86	0,01
15,683 % fällig am 11.10.2018 (b)(c)	100.000	230	0,02
15,699 % fällig am 22.11.2018 (b)(c)	100.000	227	0,02
15,777 % fällig am 04.10.2018 (b)(c)	100.000	231	0,02
15,965 % fällig am 04.10.2018 (b)(c)	100.000	231	0,02
16,147 % fällig am 04.10.2018 (b)(c)	100.000	231	0,02
		2.837	0,27
Summe kurzfristige Instrumente		29.446	2,78
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt	€ 1.049.778		99,15

### 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	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
Deutsche Bank AG	1,000 %	20.06.2019	€ 1.500	€ 2	0,00

#### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,510	20.07.2068	€ 4.100	€ 298	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		20.07.2068	4.100	(300)	(0,03)
					€ (2)	0,00
					€ 0	0,00

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* 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 Nettover- mögens	
BOA	07/2018	DKK	103.400	€ 13.916	€ 38	€ 38	0,00	
	07/2018	€	26.108	£ 23.106	20	0	0,00	
	08/2018	CZK	301.427	\$ 13.610	47	0	0,00	
	08/2018	£	23.125	€ 26.108	0	(20)	(20)	0,00
	08/2018	\$	20.314	RUB 1.285.641	65	0	65	0,01
BPS	07/2018	€	6.298	\$ 7.432	67	0	67	0,01
	07/2018	\$	58.264	€ 50.214	323	(12)	311	0,03
	08/2018	ARS	4.250	\$ 197	48	0	48	0,00
	10/2018	€	10.521	DKK 78.198	0	(22)	(22)	0,00
BRC	07/2018	\$	7.886	€ 6.709	0	(45)	(45)	0,00
	08/2018	RUB	21.608	\$ 343	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	€	603	£ 530	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018		27.405	SEK 277.740	0	(814)	(814)	(0,08)
	07/2018	\$	24	ARS 629	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	CZK	70.913	\$ 3.235	40	0	40	0,00
	08/2018	MXN	68.755	3.296	0	(146)	(146)	(0,01)
DUB	11/2018	NGN	94.750	250	0	(7)	(7)	0,00
	07/2018	€	10.681	SEK 109.870	0	(162)	(162)	(0,02)
	07/2018	TRY	18.442	\$ 3.740	0	(220)	(220)	(0,02)
FBF	07/2018	\$	3.821	COP 10.935.702	0	(85)	(85)	(0,01)
	07/2018		8.976	25.835.445	0	(158)	(158)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
GLM	07/2018	DKK 104.740	€ 14.057	€ 0	€ (1)	€ (1)	0,00
	07/2018	€ 14.057	DKK 104.740	1	0	1	0,00
	07/2018	1.496	€ 1.770	20	0	20	0,00
	07/2018	\$ 13.302	€ 11.342	0	(51)	(51)	0,00
	08/2018	RUB 602.406	\$ 9.568	12	0	12	0,00
	08/2018	\$ 12.349	TRY 55.022	0	(476)	(476)	(0,05)
HUS	07/2018	ARS 3.887	\$ 184	44	0	44	0,00
	07/2018	£ 23.400	€ 26.711	250	0	250	0,02
	07/2018	TRY 20.702	\$ 4.479	0	(6)	(6)	0,00
	07/2018	\$ 21	ARS 546	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	AUD 6.241	€ 3.890	0	(48)	(48)	0,00
	08/2018	RUB 245.930	\$ 3.927	23	0	23	0,00
	10/2018	NGN 93.950	250	0	(6)	(6)	0,00
JPM	07/2018	€ 180	DKK 1.340	0	0	0	0,00
	07/2018	10.326	\$ 12.098	36	0	36	0,00
	08/2018	AUD 1.946	€ 1.213	0	(15)	(15)	0,00
	08/2018	NGN 35.839	\$ 95	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	\$ 17.742	CZK 370.815	0	(911)	(911)	(0,09)
	08/2018	21.412	MXN 417.595	0	(300)	(300)	(0,03)
	10/2018	NGN 376.238	\$ 1.000	0	(23)	(23)	0,00
	11/2018	470.645	1.250	0	(24)	(24)	0,00
MSB	07/2018	COP 25.717.525	9.175	362	0	362	0,03
	07/2018	SEK 1.630.240	€ 158.774	2.694	0	2.694	0,25
	10/2018	NGN 93.813	\$ 250	0	(5)	(5)	0,00
RYL	08/2018	CHF 101	€ 85	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	€ 14.815	NOK 142.005	86	0	86	0,01
	08/2018	NOK 31.440	€ 3.286	0	(13)	(13)	0,00
SCX	08/2018	CHF 13.827	11.570	0	(362)	(362)	(0,03)
	08/2018	¥ 1.325.800	10.103	0	(146)	(146)	(0,01)
	09/2018	NGN 188.063	\$ 500	0	(13)	(13)	0,00
	10/2018	€ 25.043	DKK 185.971	0	(74)	(74)	(0,01)
	10/2018	NGN 283.755	\$ 754	0	(17)	(17)	0,00
	11/2018	227.294	603	0	(13)	(13)	0,00
SOG	07/2018	DKK 1.034	€ 139	0	0	0	0,00
	10/2018	264.169	35.565	97	0	97	0,01
SSB	07/2018	€ 50.144	\$ 58.373	0	(148)	(148)	(0,01)
	08/2018	CHF 100	€ 85	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	\$ 58.503	50.144	146	0	146	0,01
UAG	07/2018	€ 14.043	DKK 104.434	0	(27)	(27)	0,00
	07/2018	94.961	SEK 991.145	0	(68)	(68)	(0,01)
	08/2018	MXN 72.584	\$ 3.631	0	(25)	(25)	0,00
	08/2018	SEK 991.145	€ 94.963	66	0	66	0,01
				€ 4.485	€ (4.477)	€ 8	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ 8	0,00
Summe Anlagen						€ 1.049.786	99,15
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 8.963	0,85
Nettovermögen						€ 1.058.749	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.

- (a) Reines Kapitalwertpapier.  
(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) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von EUR 1.165 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von EUR 4.100 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(f) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettover- mögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 236	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	€ (209)	€ 202	€ 202	0,02
Summe Pensionsgeschäfte						€ (209)	€ 202	€ 202	0,02

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Short-Term Fund (Forts.)

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	€ 1.049.778	€ 0	€ 1.049.778
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	8	0	8
<b>Summen</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 1.049.786</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 1.049.786</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	€ 1.485.515	€ 0	€ 1.485.515
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(236)	(598)	0	(834)
<b>Summen</b>	<b>€ (236)</b>	<b>€ 1.484.917</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 1.484.681</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ 150	€ 0	€ 150
BPS	404	(110)	294
BRC	(45)	0	(45)
CBK	(932)	850	(82)
DUB	(467)	40	(427)
FBF	(158)	0	(158)
GLM	(495)	550	55
HUS	255	(270)	(15)
JPM	(1.240)	1.500	260
MSB	3.051	(2.930)	121
RYL	70	(140)	(70)
SCX	(625)	910	285
SOG	97	0	97
SSB	(3)	0	(3)
UAG	(54)	0	(54)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	92,74	94,88
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	5,60	3,84
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0,81	3,13
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate	0,00	(0,02)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate	0,00	(0,04)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte	0,00	(3,55)





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>ISRAEL</b>				<b>ISRAEL</b>				<b>KUWAIT</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
CNPC General Capital Ltd. 2,750 % fällig am 14.05.2019	\$ 900	\$ 897	0,12	Israel Government International Bond 1,750 % fällig am 31.08.2025	ILS 3.700	\$ 1.012	0,13	Kuwait International Government Bond 2,750 % fällig am 20.03.2022	\$ 3.100	\$ 3.024	0,40
Eastern Creation Investment Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 26.09.2020	800	783	0,10	3,250 % fällig am 17.01.2028	\$ 700	677	0,09	3,500 % fällig am 20.03.2027	9.700	9.461	1,27
Horse Gallop Finance Ltd. 3,516 % fällig am 28.06.2021	700	701	0,09	4,125 % fällig am 17.01.2048	600	569	0,08	Summe Kuwait		12.485	1,67
Poly Real Estate Finance Ltd. 3,950 % fällig am 05.02.2023	500	486	0,07	Summe Israel		2.258	0,30				
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3,880 % fällig am 25.05.2023	500	498	0,07	<b>ITALIEN</b>				<b>LITAUEN</b>			
Summe Hongkong		3.865	0,52	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				Banca Carige SpA 3,875 % fällig am 24.10.2018	€ 1.000	1.179	0,16	Lithuania Government International Bond 6,125 % fällig am 09.03.2021	1.200	1.285	0,17
				Intesa Sanpaolo SpA 6,250 % fällig am 16.05.2024 (g)(i)	1.000	1.153	0,15	<b>LUXEMBURG</b>			
				7,750 % fällig am 11.01.2027 (g)(i)	1.300	1.641	0,22	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
				Summe Italien		3.973	0,53	Bavarian Sky S.A. 0,030 % fällig am 20.05.2024	€ 434	508	0,07
								Silver Arrow S.A. 0,080 % fällig am 17.03.2025	1.008	1.181	0,16
								Summe Luxemburg		1.689	0,23
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								Allergan Funding SCS 3,850 % fällig am 15.06.2024	\$ 900	885	0,12
								Alice Luxembourg S.A. 7,750 % fällig am 15.05.2022	900	874	0,12
								Aroundtown S.A. 2,000 % fällig am 02.11.2026	€ 500	577	0,08
								Emerald Bay S.A. 0,000 % fällig am 08.10.2020 (d)	840	918	0,12
								Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,375 % fällig am 31.05.2047	550	616	0,08
								NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank 2,875 % fällig am 16.02.2021	\$ 1.400	1.390	0,19
								Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 3,080 % fällig am 07.03.2019	€ 600	710	0,09
								SELP Finance SARL 1,250 % fällig am 25.10.2023	1.400	1.637	0,22
								Unigel Luxembourg S.A. 10,500 % fällig am 22.01.2024	\$ 2.200	2.274	0,30
								Summe Luxemburg		11.570	1,55
								<b>MALAYSIA</b>			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Malaysia Government International Bond 4,232 % fällig am 30.06.2031	MYR 3.600	855	0,11
								4,378 % fällig am 29.11.2019	2.400	601	0,08
								Summe Malaysia		1.456	0,19
								<b>MEXIKO</b>			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 15.03.2115	€ 2.200	2.339	0,31
								4,350 % fällig am 15.01.2047	\$ 1.700	1.523	0,21
								Summe Mexiko		3.862	0,52
								<b>MULTINATIONAL</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								Preferred Term Securities Ltd. 2,735 % fällig am 23.06.2035	2.027	1.905	0,26
								<b>NIEDERLANDE</b>			
								<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
								Barings Euro CLO BV 0,000 % fällig am 27.07.2030 (b)	€ 900	1.051	0,14
								Dryden Euro CLO BV 0,659 % fällig am 23.08.2026	2.000	2.336	0,31
								Summe Niederlande		3.387	0,45
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								ABN AMRO Bank NV 2,450 % fällig am 04.06.2020	\$ 900	886	0,12
								Summe Japan		41.858	5,61







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
UDR, Inc.	\$ 300	\$ 300	0,04	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>				15,542 % fällig am 11.10.2018 (d)(e)	NGN 107.800	\$ 290	0,04
2.400 % fällig am 13.07.2018				(12,971) % fällig am 14.09.2018 (d)(e)	ARS 441	\$ 16	0,00				
VW CR, Inc.				2,121 % fällig am 14.12.2018 (d)(e)	\$ 2.300	2.260	0,30	15,609 % fällig am 04.10.2018 (d)(e)	107.800	290	0,04
2,550 % fällig am 15.08.2018	1.200	1.196	0,16	2,645 % fällig am 13.07.2018 (d)(e)	1.100	1.099	0,15				
				2,830 % fällig am 13.07.2018 (d)(e)	1.000	999	0,14				
		11,287	1,51	25,450 % fällig am 14.09.2018 (d)(e)	ARS 800	25	0,00	Summe kurzfristige Instrumente		45,086	6,04
				25,800 % fällig am 19.09.2018 (d)(e)	4.065	129	0,02				
		1,092	0,15								
						4,528	0,61				
<b>PENSIONSGESCHÄFTE (I)</b>				<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>				<b>AKTIEN</b>			
				(0,126) % fällig am 18.09.2018 (d)(e)	¥ 1.960.000	17.700	2,37	<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				<b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>				PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US			
Harris Corp.				12,144 % fällig am 04.04.2019 (d)(e)	NGN 1.205.000	3.035	0,41	Dollar Short-Term Floating NAV	104.226	1.044	0,14
2,794 % fällig am 27.02.2019	1.200	1.201	0,16	15,284 % fällig am 04.10.2018 (d)(e)	143.600	387	0,05	Fund (h)			
Letras del Banco Central de la Republica Argentina				15,450 % fällig am 04.10.2018 (d)(e)	480.000	1.293	0,17	Summe Übertragbare Wertpapiere und			
25,600 % fällig am 18.07.2018	ARS 4.073	138	0,02				Geldmarktinstrumente – Amtliche				
25,650 % fällig am 15.08.2018	4.460	147	0,02				Börse/Geregelter Markt	\$ 987.533	132,28		
25,800 % fällig am 18.07.2018	212	7	0,00								
40,700 % fällig am 18.07.2018	7.500	255	0,03								
Nigeria Open Market Operation Bills											
15,432 % fällig am 25.10.2018	NGN 239.300	637	0,09								
15,696 % fällig am 08.11.2018	144.000	383	0,05								
15,703 % fällig am 25.10.2018	143.700	382	0,05								
15,716 % fällig am 08.11.2018	191.600	510	0,07								
15,737 % fällig am 08.11.2018	429.400	1.142	0,15								
15,798 % fällig am 08.11.2018	143.700	382	0,05								
		5,184	0,69								

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
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2019	13	\$ 1	0,00
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2020	13	(3)	0,00
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2019	1.367	(404)	(0,05)
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03/2020	1.367	188	(0,03)
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2018	76	(48)	(0,01)
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09/2019	76	69	0,01
Australia Government 3-Year Note September Futures	Long	09/2018	17	6	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	85	133	0,02
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 113,200 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	100	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 133,000 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	103	1	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 152,000 EUR auf Euro-BTP 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	146	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 160,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	68	(180)	(0,02)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 168,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	150	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 177,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	50	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 185,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	304	0	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	6	(17)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09/2018	878	406	0,05
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	146	(125)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	56	(45)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09/2018	15	(39)	(0,01)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	483	(764)	(0,10)
Euro-Schatz September Futures	Long	09/2018	118	10	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	25	49	0,01
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 124,000 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Long	08/2018	150	0	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 125,000 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Long	08/2018	754	(1)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 128,250 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Long	08/2018	50	0	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 131,250 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Short	08/2018	103	2	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	87	18	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	95	32	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09/2018	249	768	0,10
United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate December Futures	Long	12/2018	699	12	0,00
United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate December Futures	Short	12/2019	699	(12)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	84	(186)	(0,02)
				\$ (129)	(0,02)

#### OPTIONSKAUF

##### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	\$ 105,750	24.08.2018	1	\$ 0	\$ 0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	106,500	24.08.2018	12	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens	
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	\$ 107,250	24.08.2018	74	\$ 1	\$ 0	0,00	
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	107,000	24.08.2018	1	0	0	0,00	
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	108,500	24.08.2018	94	1	0	0,00	
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	109,000	24.08.2018	32	0	0	0,00	
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	109,500	24.08.2018	21	0	0	0,00	
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	110,000	24.08.2018	3	0	0	0,00	
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	175,000	24.08.2018	70	1	0	0,00	
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	185,000	24.08.2018	3	0	0	0,00	
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	186,000	24.08.2018	19	0	0	0,00	
Put - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2018 Futures	117,000	24.08.2018	288	3	1	0,00	
Put - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2018 Futures	118,000	24.08.2018	43	0	0	0,00	
Put - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2018 Futures	120,000	24.08.2018	7	0	0	0,00	
				\$ 6	\$ 1	0,00	
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate						\$ (128)	(0,02)

### 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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Altria Group, Inc.	(1,000) %	20.12.2020	\$ 1.800	\$ 16	0,01
BASF SE	(1,000)	20.12.2020	€ 600	3	0,00
Bayer AG	(1,000)	20.12.2020	300	0	0,00
Fortum Oyj	(1,000)	20.12.2020	100	0	0,00
Koninklijke DSM NV	(1,000)	20.12.2020	1.000	7	0,00
Pfizer, Inc.	(1,000)	20.12.2020	\$ 1.300	11	0,00
Reynolds American, Inc.	(1,000)	20.12.2020	1.800	17	0,00
Telia Co. AB	(1,000)	20.12.2020	€ 300	0	0,00
United Utilities PLC	(1,000)	20.12.2020	600	(2)	0,00
UnitedHealth Group, Inc.	(1,000)	20.12.2020	\$ 900	7	0,00
				\$ 59	0,01

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Marks & Spencer PLC	1,000 %	20.06.2023	€ 2.000	\$ 13	0,00
Shell International Finance BV	1,000	20.12.2026	600	33	0,01
				\$ 46	0,01

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-29 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2022	\$ 1.200	\$ 15	0,00
CDX.IG-29 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	49.200	131	0,02
iTraxx Europe Main 26 5-Year Index	(1,000)	20.12.2021	€ 19.600	(133)	(0,02)
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	54.200	527	0,07
iTraxx Europe Senior 28 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	11.900	200	0,03
				\$ 740	0,10

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,673 %	30.04.2025	\$ 1.600	\$ (18)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,683	30.04.2025	5.000	(63)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,684	30.04.2025	1.600	(19)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,696	30.04.2025	1.600	(21)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,710	30.04.2025	1.700	(24)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,714	30.04.2025	3.300	(46)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,880	04.01.2021	BRL 29.300	(42)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,600	04.01.2027	42.500	794	0,11
Erhalt	3-Month CAD Bank Bill	1,750	16.12.2046	CAD 2.300	60	0,01
Erhalt	3-Month CAD Bank Bill	1,850	15.09.2027	12.200	64	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD Bank Bill	2,300	16.07.2020	59.100	105	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month NZD-BBR	2,500	14.02.2020	NZD 136.400	166	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month PLN-WIBOR	3,000	19.09.2028	PLN 4.600	4	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,000	02.03.2023	\$ 13.600	(7)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,750	01.04.2019	219.900	(737)	(0,10)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	20.06.2020	43.800	25	0,00

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000 %	20.12.2019	\$ 8.000	\$ 143	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,000	01.04.2020	219.900	925	0,12
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	59.200	48	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	11.000	(70)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	35.900	(17)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,326	12.06.2022	15.700	10	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,326	19.06.2022	34.000	35	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027	600	20	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	5.100	(79)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	25.700	2.130	0,29
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	20.06.2023	ZAR 182.400	(343)	(0,05)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,500	15.03.2019	78.700	35	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	15.03.2022	66.400	83	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,250	15.03.2022	9.600	12	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	19.09.2020	€ 300	1	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	19.12.2020	11.000	27	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	23.700	381	0,05
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.12.2023	3.900	39	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	47.150	1.036	0,14
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.12.2028	34.750	492	0,07
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.09.2048	1.600	(52)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	19.09.2019	£ 65.000	74	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	18.09.2020	65.000	(75)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.12.2019	58.500	130	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.09.2020	21.300	97	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	18.12.2020	58.500	(142)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	17.300	(164)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	3.000	(3)	0,00
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,500	21.03.2068	300	12	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	900	(11)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,100	20.03.2024	¥ 5.720.000	46	0,01
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	4.830.000	(201)	(0,03)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	560.000	(54)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,380	18.06.2028	120.000	(12)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,399	18.06.2028	120.000	(12)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	3.412.000	(80)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,000	21.03.2048	630.000	(161)	(0,02)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	1,250	17.06.2035	410.000	352	0,05
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,500	21.12.2045	980.000	1.212	0,16
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,500	21.12.2045	150.000	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,070	03.02.2021	MXN 5.000	(18)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,555	25.01.2023	13.600	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,715	15.10.2021	20.900	(61)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,000	18.07.2022	22.900	(78)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	10.03.2026	68.000	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,740	22.02.2027	17.500	(12)	0,00
					\$ 5.927	0,79
					\$ 6.772	0,91

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

#### FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

#### OPTIONSKAUF

#### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC AUD versus USD	\$ 0,693	16.07.2018	AUD 6.000	\$ 0	\$ 0	0,00
	Call - OTC USD versus JPY	¥ 120,000	17.04.2020	\$ 2.673	49	16	0,00
CBK	Call - OTC USD versus CAD	CAD 1,370	17.08.2018	3.957	7	5	0,00
DUB	Call - OTC USD versus JPY	¥ 120,000	17.04.2020	2.246	41	14	0,00
GLM	Call - OTC USD versus JPY	120,000	20.04.2020	3.327	62	20	0,00
HUS	Put - OTC AUD versus USD	\$ 0,735	05.02.2019	AUD 8.500	84	158	0,02
	Put - OTC EUR versus USD	1,140	24.05.2019	€ 3.800	49	55	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
MSB	Call - OTC EUR versus USD	\$ 1,291	24.06.2021	€ 603	\$ 37	\$ 37	0,01
	Put - OTC EUR versus USD	1,291	24.06.2021	603	44	43	0,01
SCX	Put - OTC USD versus INR	INR 69,220	25.10.2018	\$ 2.125	30	26	0,00
UAG	Call - OTC USD versus CHF	CHF 1,050	16.07.2018	8.000	1	0	0,00
					\$ 404	\$ 374	0,05

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.09.2048	\$ 76,500	06.08.2018	\$ 54.000	\$ 2	\$ 0	0,00

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	\$ 2.700	\$ (3)	\$ (1)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	3.500	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	2.900	(4)	(3)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	900	(2)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Kauf	0,475	19.09.2018	€ 17.500	(9)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,750	19.09.2018	17.500	(35)	(82)	(0,01)
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	\$ 1.400	(2)	(2)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	1.100	(2)	0	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	500	0	0	0,00
						\$ (60)	\$ (90)	(0,01)

### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC USD versus KRW	KRW 1.200.000	25.10.2018	\$ 2.125	\$ (9)	\$ (9)	0,00
CBK	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,315	14.06.2019	£ 2.323	(74)	(71)	(0,01)
	Call - OTC GBP versus USD	1,440	14.06.2019	2.370	(34)	(27)	0,00
	Put - OTC USD versus CAD	CAD 1,305	17.08.2018	\$ 2.638	(20)	(20)	0,00
HUS	Call - OTC AUD versus USD	\$ 0,825	04.12.2018	AUD 8.500	(111)	(6)	0,00
	Call - OTC EUR versus USD	1,270	24.05.2019	€ 3.800	(53)	(41)	(0,01)
					\$ (301)	\$ (174)	(0,02)

### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Floor - OTC CPURNSA	\$ 216,687	Maximal $[(1 + 0,000\%)^{10} - (\text{Index Final/Index Initial})]$ oder 0	07.04.2020	\$ 500	\$ (4)	\$ 0	0,00
DUB	Floor - OTC CPURNSA	\$ 218,011	Maximal $[0,000\% - (\text{Index Final/Index Initial} - 1)]$ oder 0	13.10.2020	400	(4)	0	0,00
						\$ (8)	\$ 0	0,00

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Japan Government International Bond	(1,000) %	20.06.2022	\$ 400	\$ (14)	£ 1	\$ (13)	0,00
BPS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	3.100	(111)	13	(98)	(0,01)
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.100	(52)	3	(49)	(0,01)
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.200	(23)	6	(17)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	2.200	(77)	7	(70)	(0,01)
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	900	(21)	0	(21)	0,00
CBK	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	1.500	(52)	5	(47)	(0,01)
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.200	(42)	10	(32)	(0,01)
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	2.800	(98)	10	(88)	(0,01)
HUS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.200	(30)	2	(28)	0,00
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.700	(40)	0	(40)	(0,01)
					\$ (560)	\$ 57	\$ (503)	(0,07)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Mexico Government International Bond	1,000 %	20.06.2022	\$ 8.400	\$ 4	\$ (21)	\$ (17)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	600	(7)	(2)	(9)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.03.2020	1.400	(63)	57	(6)	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2021	2.000	(75)	83	8	0,00

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
CBK	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.12.2022	\$ 3.000	\$ (39)	\$ 24	\$ (15)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	700	(7)	(3)	(10)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	5.400	(173)	150	(23)	0,00
DUB	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	2.700	(96)	(30)	(126)	(0,02)
FBF	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2021	500	(33)	36	3	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	700	(41)	8	(33)	(0,01)
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	0	0	0	0	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.700	(108)	(17)	(125)	(0,02)
HUS	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	3.200	(32)	16	(16)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2022	1.100	(7)	(2)	(9)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	2.600	(85)	74	(11)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2022	1.400	(60)	18	(42)	(0,01)
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2021	2.400	(164)	78	(86)	(0,01)
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	0	0	0	0	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	700	(44)	(7)	(51)	(0,01)
JPM	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	7.000	(66)	(39)	(105)	(0,01)
	AP Moller - Maersk	1,000	20.06.2022	€ 1.700	(10)	24	14	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2020	\$ 7.500	(247)	311	64	0,01
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2023	3.600	(38)	(20)	(58)	(0,01)
					\$ (1.391)	\$ 738	\$ (653)	(0,09)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
BPS	iTraxx Europe Subordinated 27 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2022	€ 2.700	\$ 141	\$ (92)	\$ 49	0,01

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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 Nettvermögens
BPS	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,362 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	26.09.2027	AUD 4.400	\$ 3.488	\$ 23	\$ (263)	\$ (240)	(0,03)
		Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,368 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	05.10.2027	2.700	2.127	(4)	(129)	(133)	(0,02)
DUB	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month GBP-LIBOR abzgl. 0,055 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	13.10.2026	GBP 1.300	1.586	(1)	112	111	0,02
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,368 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	06.10.2027	AUD 990	774	1	(44)	(43)	(0,01)
RYL	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month GBP-LIBOR abzgl. 0,055 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	13.10.2026	GBP 1.800	2.196	50	103	153	0,02
						\$ 69	\$ (221)	\$ (152)	(0,02)

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
BOA	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370) %	20.06.2020	ILS 26.800	\$ 0	\$ 9	\$ 9	0,00
CBK	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	5.600	0	(4)	(4)	0,00
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(1,928)	02.08.2027	KRW 4.200.000	0	88	88	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,480	18.05.2027	THB 4.000	0	1	1	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,810	18.05.2037	52.000	0	10	10	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlt/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370) %	20.06.2020	ILS 55.000	\$ 4	\$ 16	\$ 20	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,270)	21.03.2020	53.000	0	16	16	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,883	21.03.2028	11.100	0	(16)	(16)	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	11.800	0	(9)	(9)	0,00
HUS	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	74.300	0	26	26	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	16.000	1	(13)	(12)	0,00
JPM	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(1,993)	10.07.2027	KRW 3.848.200	0	59	59	0,01
SOG	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(2,025)	10.07.2027	9.175.300	0	117	117	0,02
						\$ 5	\$ 300	\$ 305	0,04

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	08/2018	AUD 270	\$ 206	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
BOA	07/2018	ARS 18.535	667	23	0	23	0,00
	07/2018	BRL 53.743	14.214	245	0	245	0,03
	07/2018	¥ 130.000	1.235	61	0	61	0,01
	07/2018	KRW 1.087	1	0	0	0	0,00
	07/2018	TRY 25.762	5.525	0	(55)	(55)	(0,01)
	07/2018	\$ 2.453	ARS 65.153	0	(203)	(203)	(0,03)
	07/2018	257	INR 17.566	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	ARS 8.280	\$ 384	109	0	109	0,01
	08/2018	CAD 336	260	4	0	4	0,00
	08/2018	CHF 227	229	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	€ 2.666	3.135	13	0	13	0,00
	08/2018	NOK 46.320	5.657	0	(36)	(36)	0,00
	08/2018	SEK 311.470	35.890	964	0	964	0,13
	08/2018	\$ 564	AUD 719	0	(33)	(33)	0,00
	08/2018	15.923	BRL 60.447	0	(267)	(267)	(0,04)
	08/2018	8.774	CAD 11.331	0	(154)	(154)	(0,02)
	08/2018	8.603	CHF 8.558	47	0	47	0,01
	08/2018	3.175	CZK 66.600	0	(181)	(181)	(0,02)
	08/2018	48.000	€ 40.157	6	(974)	(968)	(0,13)
	08/2018	1.512	ILS 5.415	0	(28)	(28)	0,00
	08/2018	ZAR 6.752	\$ 525	34	0	34	0,00
	09/2018	ARS 4.065	185	54	0	54	0,01
	09/2018	SGD 10.669	8.034	197	0	197	0,03
	09/2018	\$ 114	IDR 1.641.606	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07/2018	ARS 46.405	\$ 1.700	94	0	94	0,01
	07/2018	£ 255	342	5	0	5	0,00
	07/2018	KRW 875.249	790	3	0	3	0,00
	07/2018	\$ 1.427	ARS 39.527	0	(70)	(70)	(0,01)
	07/2018	204	CLP 130.082	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	797	£ 599	0	(6)	(6)	0,00
	07/2018	1.002	PEN 3.281	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	1.587	VND 36.303.350	0	(5)	(5)	0,00
	08/2018	ARS 4.460	\$ 207	59	0	59	0,01
	08/2018	€ 1.678	1.966	0	0	0	0,00
	08/2018	RON 4.684	1.186	15	0	15	0,00
	08/2018	\$ 379	AUD 486	0	(20)	(20)	0,00
	08/2018	1.136	HUF 294.721	0	(88)	(88)	(0,01)
	08/2018	810	RON 3.147	0	(24)	(24)	0,00
	09/2018	TWD 295.584	\$ 10.060	313	0	313	0,04
	10/2018	KRW 236.249	213	0	(1)	(1)	0,00
BRC	07/2018	ARS 16.569	608	42	0	42	0,01
CBK	09/2018	\$ 1.932	INR 133.521	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	ARS 3.040	\$ 106	3	0	3	0,00
	07/2018	£ 10.341	13.795	142	0	142	0,02
	07/2018	\$ 38	ARS 995	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	1.893	£ 1.437	5	0	5	0,00
	07/2018	244	TRY 1.115	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	AUD 1.260	\$ 952	21	0	21	0,00
	08/2018	CZK 41.386	1.891	30	0	30	0,00
	08/2018	MXN 72.682	3.711	56	(11)	45	0,01
	08/2018	\$ 76	ARS 1.569	0	(24)	(24)	0,00
	08/2018	1.425	CAD 1.876	3	0	3	0,00
	08/2018	848	€ 724	0	0	0	0,00
	09/2018	¥ 1.960.000	\$ 17.877	87	0	87	0,01
	09/2018	\$ 647	CNH 4.306	1	0	1	0,00
	11/2018	NGN 136.440	\$ 360	0	(11)	(11)	0,00
	02/2019	€ 2.951	3.735	229	0	229	0,03
	04/2019	SEK 4.478	€ 431	3	0	3	0,00
	06/2019	£ 817	\$ 1.095	0	(2)	(2)	0,00
DUB	07/2018	BRL 5.460	1.549	130	0	130	0,02
	07/2018	COP 1.262.601	463	33	0	33	0,00
	07/2018	\$ 410	ARS 11.445	0	(14)	(14)	0,00
	07/2018	1.417	BRL 5.460	2	0	2	0,00
	07/2018	139	COP 397.660	0	(4)	(4)	0,00
	01/2019	2.264	€ 1.800	0	(127)	(127)	(0,02)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	03/2019	BRL 3.624	\$ 947	\$ 27	\$ 0	\$ 27	0,00
	03/2019	\$ 806	MXN 17.292	40	0	40	0,01
	04/2019	SEK 3.141	€ 305	5	0	5	0,00
FBF	07/2018	COP 215.236	\$ 79	6	0	6	0,00
	07/2018	KRW 1.959.861	1.803	42	0	42	0,01
	07/2018	\$ 4.983	COP 14.343.052	0	(103)	(103)	(0,01)
	08/2018	989	CAD 1.272	0	(21)	(21)	0,00
GLM	04/2019	€ 609	SEK 6.246	0	(13)	(13)	0,00
	07/2018	ARS 1.086	\$ 38	1	0	1	0,00
	07/2018	BRL 8.352	2.191	20	0	20	0,00
	07/2018	CAD 1.266	AUD 1.310	5	0	5	0,00
	07/2018	CLP 1.430.082	\$ 2.204	7	0	7	0,00
	07/2018	DKK 4.585	726	8	0	8	0,00
	07/2018	£ 3.964	5.287	53	0	53	0,01
	07/2018	KRW 1.649.150	1.488	6	0	6	0,00
	07/2018	\$ 2.051	BRL 7.865	0	(7)	(7)	0,00
	08/2018	BRL 7.865	\$ 2.046	9	0	9	0,00
	08/2018	€ 982	1.165	15	0	15	0,00
	08/2018	RON 9.640	2.427	19	0	19	0,00
	08/2018	\$ 9.134	€ 7.808	20	(9)	11	0,00
	08/2018	12.652	TRY 56.370	0	(571)	(571)	(0,08)
	09/2018	INR 25.435	\$ 369	2	0	2	0,00
	09/2018	RON 372	€ 79	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 2.204	CLP 1.430.082	0	(7)	(7)	0,00
HUS	09/2018	81	PHP 4.268	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	ARS 11.407	\$ 491	101	0	101	0,01
	07/2018	BRL 10.920	2.880	44	(2)	42	0,01
	07/2018	DKK 1.105	185	11	0	11	0,00
	07/2018	KRW 1.221.356	1.106	8	0	8	0,00
	07/2018	RUB 255.594	4.055	0	(18)	(18)	0,00
	07/2018	\$ 33	ARS 863	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	1.463	BRL 5.460	0	(44)	(44)	(0,01)
	07/2018	99	€ 86	1	0	1	0,00
	07/2018	3.999	RUB 255.594	75	0	75	0,01
	08/2018	ARS 2.110	\$ 98	28	0	28	0,00
	08/2018	CAD 2.666	2.057	29	0	29	0,00
	08/2018	MXN 7.112	353	0	(6)	(6)	0,00
	08/2018	\$ 155	ARS 3.207	0	(50)	(50)	(0,01)
	08/2018	12.187	AUD 16.373	0	(88)	(88)	(0,01)
	08/2018	4.213	RUB 266.679	18	(2)	16	0,00
	09/2018	IDR 56.451.434	\$ 3.931	33	0	33	0,00
	09/2018	\$ 421	ARS 11.452	0	(51)	(51)	(0,01)
	09/2018	15.371	CNY 98.687	0	(537)	(537)	(0,07)
	12/2018	€ 2.404	\$ 3.008	164	0	164	0,02
	12/2018	\$ 2.122	AUD 2.670	0	(147)	(147)	(0,02)
	01/2019	€ 1.877	\$ 2.256	28	0	28	0,00
	02/2019	\$ 1.121	AUD 1.410	0	(78)	(78)	(0,01)
	03/2019	BRL 1.215	\$ 360	51	0	51	0,01
	03/2019	\$ 360	MXN 7.090	0	(13)	(13)	0,00
IND	05/2019	1.901	€ 1.575	0	(12)	(12)	0,00
JPM	09/2018	INR 21.596	\$ 318	6	0	6	0,00
	07/2018	ARS 11.183	420	37	0	37	0,01
	07/2018	BRL 8.879	2.380	73	0	73	0,01
	07/2018	£ 4.578	6.060	25	(9)	16	0,00
	07/2018	\$ 2.067	CLP 1.300.000	0	(70)	(70)	(0,01)
	07/2018	2.248	NZD 3.193	0	(86)	(86)	(0,01)
	08/2018	AUD 429	\$ 326	9	0	9	0,00
	08/2018	€ 1.654	1.916	0	(22)	(22)	0,00
	08/2018	¥ 346.800	3.184	44	0	44	0,01
	08/2018	RUB 31.048	494	2	0	2	0,00
	08/2018	\$ 737	€ 620	0	(11)	(11)	0,00
	08/2018	10.394	NOK 84.135	0	(54)	(54)	(0,01)
	08/2018	2.834	ZAR 36.168	0	(207)	(207)	(0,03)
	09/2018	RON 405	€ 86	0	0	0	0,00
	10/2018	NGN 911.742	\$ 2.427	0	(62)	(62)	(0,01)
MSB	11/2018	540.452	1.433	0	(38)	(38)	(0,01)
	07/2018	ARS 5.112	181	7	0	7	0,00
	07/2018	\$ 18.659	BRL 68.570	0	(837)	(837)	(0,11)
	07/2018	4.553	PLN 15.472	0	(420)	(420)	(0,06)
	08/2018	CAD 4.244	\$ 3.297	68	0	68	0,01
	08/2018	\$ 27	ARS 558	0	(9)	(9)	0,00
	10/2018	NGN 134.696	\$ 359	0	(9)	(9)	0,00
NGF	06/2021	\$ 52	€ 41	0	0	0	0,00
	07/2018	ARS 2.388	\$ 84	2	0	2	0,00
	07/2018	KRW 405.382	366	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 1.916	INR 131.045	0	(7)	(7)	0,00
	09/2018	18.282	CNH 116.730	0	(718)	(718)	(0,10)
	09/2018	2.090	INR 143.155	0	(22)	(22)	0,00
RBC	09/2018	6.921	TWD 205.063	0	(160)	(160)	(0,02)
	07/2018	1.194	¥ 130.000	0	(20)	(20)	0,00
	08/2018	CAD 506	\$ 380	0	(5)	(5)	0,00
	08/2018	\$ 2.645	CAD 3.513	28	0	28	0,00
	09/2018	CNH 3.637	\$ 566	19	0	19	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermogens
RYL	07/2018	DKK 1.465	\$ 230	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	08/2018	AUD 450	338	5	0	5	0,00
	08/2018	NOK 1.365	168	0	0	0	0,00
	08/2018	RUB 21.643	346	3	0	3	0,00
SCX	07/2018	£ 318	419	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 92	COP 263.120	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	20.340	DKK 129.776	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	585	£ 438	0	(6)	(6)	0,00
	08/2018	AUD 2.682	\$ 2.026	44	0	44	0,01
	08/2018	\$ 545	AUD 699	0	(28)	(28)	0,00
	08/2018	1.062	£ 898	0	(10)	(10)	0,00
	09/2018	CNH 4.657	\$ 728	27	0	27	0,00
	09/2018	IDR 7.736.301	539	5	0	5	0,00
	09/2018	\$ 19.494	INR 1.323.834	0	(367)	(367)	(0,05)
	09/2018	10.806	KRW 11.614.769	0	(348)	(348)	(0,05)
	10/2018	DKK 129.776	\$ 20.488	7	0	7	0,00
	10/2018	INR 81.195	1.173	6	0	6	0,00
	10/2018	NGN 101.063	270	0	(7)	(7)	0,00
	11/2018	180.463	479	0	(12)	(12)	0,00
	04/2019	1.144.337	3.013	0	(31)	(31)	0,00
SOG	08/2018	\$ 30	ARS 628	0	(10)	(10)	0,00
	09/2018	2.951	HKD 23.114	0	(1)	(1)	0,00
	12/2018	1.380	£ 1.095	0	(85)	(85)	(0,01)
SSB	08/2018	CAD 552	\$ 426	6	0	6	0,00
	08/2018	\$ 44.553	¥ 4.859.300	0	(556)	(556)	(0,07)
	09/2018	1.277	MYR 5.113	0	(15)	(15)	0,00
UAG	07/2018	DKK 126.979	\$ 21.172	1.274	0	1.274	0,17
	07/2018	PLN 432	129	14	0	14	0,00
	07/2018	\$ 592	DKK 3.565	0	(33)	(33)	0,00
	07/2018	24.450	£ 18.491	0	(37)	(37)	(0,01)
	08/2018	CAD 2.116	\$ 1.587	0	(22)	(22)	0,00
	08/2018	£ 18.491	24.484	39	0	39	0,01
	08/2018	\$ 22.027	MXN 431.030	0	(286)	(286)	(0,04)
	08/2018	19.393	RUB 1.218.255	0	(70)	(70)	(0,01)
	09/2018	1.550	PHP 82.314	0	(18)	(18)	0,00
	09/2018	5.326	THB 169.279	0	(205)	(205)	(0,03)
				\$ 5.668	\$ (9.060)	\$ (3.392)	(0,45)

### ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CHF (Partially Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermogens
BOA	07/2018	\$ 2.388	AUD 3.235	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07/2018	73	CAD 94	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	11.789	CHF 11.610	0	(97)	(97)	(0,01)
	08/2018	AUD 3.235	\$ 2.388	0	(2)	(2)	0,00
BPS	07/2018	£ 19.160	22.223	0	(147)	(147)	(0,02)
	07/2018	¥ 1.013.456	9.331	182	0	182	0,02
BRC	07/2018	\$ 55	AUD 73	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07/2018	CAD 4.256	\$ 3.269	34	0	34	0,01
	07/2018	DKK 3.330	554	32	0	32	0,00
	07/2018	£ 3.841	5.089	18	0	18	0,00
	07/2018	\$ 36.663	CHF 36.213	0	(193)	(193)	(0,03)
GLM	07/2018	AUD 3.308	\$ 2.487	43	0	43	0,01
	07/2018	CHF 34.744	34.810	0	(181)	(181)	(0,02)
	07/2018	\$ 36.525	CHF 36.145	0	(124)	(124)	(0,02)
	07/2018	209	¥ 22.743	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	34.898	CHF 34.744	180	0	180	0,02
	07/2018	3.128	CAD 4.162	36	0	36	0,01
	08/2018	CAD 4.162	\$ 3.130	0	(36)	(36)	0,00
JPM	07/2018	CHF 35.211	35.536	75	0	75	0,01
	07/2018	NOK 7.317	883	0	(15)	(15)	0,00
	08/2018	\$ 35.626	CHF 35.211	0	(77)	(77)	(0,01)
RBC	07/2018	308	£ 266	2	0	2	0,00
RYL	07/2018	499	£ 425	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07/2018	NZD 482	\$ 340	13	0	13	0,00
	07/2018	\$ 115	£ 86	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	897	NOK 7.317	0	0	0	0,00
	07/2018	879	SEK 7.831	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	NOK 7.317	898	0	0	0	0,00
	08/2018	SEK 7.831	881	4	0	4	0,00
	07/2018	7.831	879	4	0	4	0,00
SOG	07/2018	CHF 3.021	3.057	19	(5)	14	0,00
SSB	07/2018	\$ 21.810	£ 18.735	65	0	65	0,01
	07/2018	69	£ 53	1	0	1	0,00
	08/2018	£ 18.735	\$ 21.858	0	(64)	(64)	(0,01)
TOR	07/2018	\$ 9.144	¥ 1.004.751	0	(74)	(74)	(0,01)
	08/2018	¥ 990.713	\$ 9.036	74	0	74	0,01
UAG	07/2018	\$ 4.965	£ 3.755	0	(8)	(8)	0,00
	08/2018	£ 3.755	\$ 4.972	8	0	8	0,00
				\$ 792	\$ (1.038)	\$ (246)	(0,03)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional DKK (Partially 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 Nettover- mögens
BOA	07/2018	\$ 1.911	AUD 2.589	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	08/2018	AUD 2.589	\$ 1.911	0	(2)	(2)	0,00
BPS	07/2018	€ 16.659	\$ 19.322	0	(128)	(128)	(0,02)
	07/2018	¥ 910.034	8.379	163	0	163	0,02
CBK	07/2018	CAD 3.329	2.557	26	0	26	0,00
	07/2018	DKK 3.826	621	21	0	21	0,00
	07/2018	£ 3.216	4.261	15	0	15	0,00
	07/2018	\$ 24.425	DKK 146.595	0	(1.453)	(1.453)	(0,19)
GLM	07/2018	AUD 2.589	\$ 1.946	33	0	33	0,01
	07/2018	CHF 1.058	1.069	4	0	4	0,00
HUS	07/2018	\$ 2.502	CAD 3.329	29	0	29	0,00
	08/2018	CAD 3.329	\$ 2.504	0	(28)	(28)	0,00
JPM	07/2018	\$ 1.068	CHF 1.058	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	25.553	DKK 162.108	0	(150)	(150)	(0,02)
	08/2018	CHF 1.058	\$ 1.070	2	0	2	0,00
MSB	07/2018	\$ 24.950	DKK 158.319	0	(141)	(141)	(0,02)
SCX	07/2018	DKK 146.558	\$ 22.970	4	0	4	0,00
	07/2018	\$ 793	SEK 7.065	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	SEK 7.065	\$ 795	4	0	4	0,00
	10/2018	\$ 23.138	DKK 146.558	0	(8)	(8)	0,00
SOG	07/2018	SEK 7.065	\$ 793	3	0	3	0,00
SSB	07/2018	NOK 4.824	591	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 19.393	€ 16.659	58	0	58	0,01
	08/2018	€ 16.659	\$ 19.436	0	(57)	(57)	(0,01)
TOR	07/2018	\$ 8.283	¥ 910.034	0	(67)	(67)	(0,01)
	08/2018	¥ 910.034	\$ 8.300	68	0	68	0,01
UAG	07/2018	\$ 4.252	£ 3.216	0	(6)	(6)	0,00
	08/2018	£ 3.216	\$ 4.258	7	0	7	0,00
				\$ 439	\$ (2.047)	\$ (1.608)	(0,22)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Partially Hedged) Class und Class E EUR (Partially Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BOA	07/2018	\$ 9.166	AUD 12.417	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
	08/2018	AUD 12.417	\$ 9.167	0	(8)	(8)	0,00
BPS	07/2018	¥ 4.239.927	39.038	760	0	760	0,10
	07/2018	\$ 142.655	€ 122.993	946	0	946	0,13
BRC	07/2018	€ 1.088	\$ 1.284	13	0	13	0,00
CBK	07/2018	CAD 17.166	13.186	136	0	136	0,02
	07/2018	€ 1.702	1.979	0	(8)	(8)	0,00
	07/2018	£ 15.401	20.404	71	0	71	0,01
	07/2018	\$ 36	€ 31	0	0	0	0,00
	07/2018	299	¥ 32.998	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07/2018	AUD 12.417	\$ 9.334	160	0	160	0,02
	07/2018	CHF 5.367	5.424	18	0	18	0,00
	07/2018	€ 14	16	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 2.053	€ 1.758	0	(1)	(1)	0,00
HUS	07/2018	12.902	CAD 17.166	148	0	148	0,02
	08/2018	CAD 17.166	\$ 12.909	0	(147)	(147)	(0,02)
JPM	07/2018	NOK 23.183	2.796	0	(48)	(48)	(0,01)
	07/2018	\$ 5.417	CHF 5.367	0	(11)	(11)	0,00
	08/2018	CHF 5.367	\$ 5.430	12	0	12	0,00
MSB	07/2018	€ 92.598	106.951	0	(1.162)	(1.162)	(0,16)
	08/2018	\$ 107.187	€ 92.598	1.161	0	1.161	0,16
RBC	07/2018	€ 34	\$ 39	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	\$ 2.261	€ 1.929	0	(8)	(8)	0,00
SCX	07/2018	€ 21	\$ 24	0	0	0	0,00
	07/2018	¥ 34.659	316	3	0	3	0,00
	07/2018	\$ 1.389	DKK 8.861	0	0	0	0,00
	07/2018	3.637	€ 3.084	0	(37)	(37)	0,00
	07/2018	2.843	NOK 23.183	1	0	1	0,00
	07/2018	3.745	SEK 33.351	0	(17)	(17)	0,00
	08/2018	NOK 23.183	\$ 2.847	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	SEK 33.351	3.754	18	0	18	0,00
	10/2018	DKK 8.861	1.399	0	0	0	0,00
SOG	07/2018	SEK 33.351	3.743	15	0	15	0,00
SSB	07/2018	€ 123.041	143.232	0	(425)	(425)	(0,06)
	07/2018	\$ 103.207	€ 88.692	345	0	345	0,05
	08/2018	143.549	123.041	419	0	419	0,06
TOR	07/2018	38.606	¥ 4.241.588	0	(312)	(312)	(0,04)
	08/2018	¥ 4.241.588	\$ 38.685	315	0	315	0,04
UAG	07/2018	DKK 8.861	1.477	89	0	89	0,01
	07/2018	\$ 20.364	£ 15.401	0	(31)	(31)	0,00
	08/2018	£ 15.401	\$ 20.393	32	0	32	0,00
				\$ 4.670	\$ (2.217)	\$ 2.453	0,33

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Partially 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 Nettover- mögens
BOA	07/2018	\$ 817	AUD 1.107	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07/2018	2.627	£ 1.967	0	(29)	(29)	0,00
	08/2018	AUD 1.107	\$ 817	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07/2018	€ 6.601	7.656	0	(51)	(51)	(0,01)
	07/2018	¥ 352.309	3.244	63	0	63	0,01
BRC	07/2018	£ 9.150	11.965	0	(115)	(115)	(0,01)
	08/2018	\$ 11.982	£ 9.150	115	0	115	0,02
CBK	07/2018	CAD 1.452	\$ 1.116	12	0	12	0,00
	07/2018	DKK 969	161	9	0	9	0,00
GLM	07/2018	\$ 12.122	£ 9.150	0	(42)	(42)	(0,01)
	07/2018	AUD 1.107	\$ 832	14	0	14	0,00
	07/2018	CHF 417	421	1	0	1	0,00
HUS	07/2018	SEK 2.591	294	4	0	4	0,00
	07/2018	\$ 1.092	CAD 1.452	12	0	12	0,00
JPM	08/2018	CAD 1.452	\$ 1.092	0	(12)	(12)	0,00
	07/2018	\$ 420	CHF 417	0	(1)	(1)	0,00
SCX	08/2018	CHF 417	\$ 422	1	0	1	0,00
	07/2018	NZD 157	111	4	0	4	0,00
SSB	07/2018	\$ 12.184	£ 9.165	0	(84)	(84)	(0,01)
	07/2018	NOK 2.232	\$ 273	0	0	0	0,00
TOR	07/2018	\$ 7.684	€ 6.601	23	0	23	0,00
	08/2018	€ 6.601	\$ 7.701	0	(22)	(22)	0,00
	07/2018	\$ 3.207	¥ 352.309	0	(26)	(26)	0,00
UAG	08/2018	¥ 352.309	\$ 3.213	26	0	26	0,00
	07/2018	£ 9.134	12.078	18	0	18	0,00
	08/2018	\$ 12.095	£ 9.134	0	(19)	(19)	0,00
				\$ 303	\$ (402)	\$ (99)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional NOK (Partially 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 Nettover- mögens
BOA	07/2018	NOK 145.414	\$ 17.719	\$ 0	\$ (123)	\$ (123)	(0,02)
	07/2018	\$ 1.273	AUD 1.724	1	0	1	0,00
	07/2018	5.901	NOK 48.102	0	0	0	0,00
BPS	08/2018	AUD 1.724	\$ 1.273	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	\$ 17.740	NOK 145.414	122	0	122	0,02
	07/2018	€ 9.615	\$ 11.152	0	(74)	(74)	(0,01)
CBK	07/2018	¥ 520.375	4.791	93	0	93	0,01
	07/2018	CAD 2.088	1.604	17	0	17	0,00
	07/2018	DKK 1.198	199	12	0	12	0,00
GLM	07/2018	£ 1.847	2.447	9	0	9	0,00
	07/2018	AUD 1.724	1.296	22	0	22	0,00
	07/2018	CHF 603	609	2	0	2	0,00
HUS	07/2018	SEK 4.106	466	7	0	7	0,00
	07/2018	\$ 1.569	CAD 2.088	18	0	18	0,00
JPM	08/2018	CAD 2.088	\$ 1.570	0	(18)	(18)	0,00
	07/2018	\$ 608	CHF 603	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2018	17.589	NOK 145.817	302	0	302	0,04
	08/2018	CHF 603	\$ 610	1	0	1	0,00
SSB	07/2018	NOK 145.337	17.824	0	(8)	(8)	0,00
	07/2018	\$ 17.780	146.379	179	0	179	0,02
	08/2018	17.846	145.337	8	0	8	0,00
TOR	07/2018	€ 11.193	9.615	33	0	33	0,01
	08/2018	€ 9.615	\$ 11.217	0	(33)	(33)	0,00
UAG	07/2018	\$ 4.736	¥ 520.375	0	(38)	(38)	(0,01)
	08/2018	¥ 520.375	\$ 4.746	39	0	39	0,01
	07/2018	\$ 2.442	£ 1.847	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	£ 1.847	\$ 2.446	4	0	4	0,00
				\$ 869	\$ (300)	\$ 569	0,07

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (3.167) (0,42)

Summe Anlagen

\$ 991.010 132,75

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (244.485) (32,75)

Nettovermögen

\$ 746.525 100,00

### 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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Nullkuponwertpapier.

(d) 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.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 68.326 als Sicherheiten verpfändet.

(k) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 24.636 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 12.508 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 6.980 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(l) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 1.092	U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.11.2019	\$ (1.118)	\$ 1.092	\$ 1.092	0,15
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (1.118)</b>	<b>\$ 1.092</b>	<b>\$ 1.092</b>	<b>0,15</b>

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

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 8.863	\$ 978.670	\$ 0	\$ 987.533
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(128)	3.605	0	3.477
<b>Summen</b>	<b>\$ 8.735</b>	<b>\$ 982.275</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 991.010</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 49.474	\$ 924.839	\$ 904	\$ 975.217
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	304	12.741	(1)	13.044
<b>Summen</b>	<b>\$ 49.778</b>	<b>\$ 937.580</b>	<b>\$ 903</b>	<b>\$ 988.261</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 der Wertpapieranlagen.

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:**

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	1,980 %	01.05.2018	02.07.2018	\$ (16.928)	\$ (16.984)	(2,27)
	2,170	12.06.2018	12.07.2018	(1.402)	(1.403)	(0,19)
BPS	(0,450)	19.04.2018	19.07.2018	€ (6.858)	(7.999)	(1,07)
GRE	1,930	18.04.2018	18.07.2018	\$ (2.222)	(2.231)	(0,30)
	2,170	18.06.2018	18.07.2018	(8.030)	(8.036)	(1,08)
	2,200	15.06.2018	05.07.2018	(4.635)	(4.640)	(0,62)
IND	0,650	02.05.2018	05.07.2018	£ (535)	(707)	(0,09)
	0,660	26.04.2018	26.07.2018	(7.519)	(9.939)	(1,33)
	1,980	03.05.2018	03.07.2018	\$ (15.970)	(16.022)	(2,15)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (67.961)</b>	<b>(9,10)</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkaufgeschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BCY	2,200 %	14.06.2018	05.07.2018	\$ (5.609)	\$ (5.615)	(0,75)
	2,350	27.06.2018	05.07.2018	(5.891)	(5.893)	(0,79)
GSC	2,130	21.06.2018	05.07.2018	(13.042)	(13.050)	(1,75)
<b>Summe Rückkaufgeschäfte</b>					<b>\$ (24.558)</b>	<b>(3,29)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 6 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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 6	\$ 0	\$ 6
BOA	(331)	560	229
BPS	1.593	(1.170)	423
BRC	(133)	150	17
CBK	(870)	890	20
DUB	91	(60)	31
FBF	(86)	0	(86)
GLM	(222)	420	198
GST	(356)	210	(146)
HUS	(549)	320	(229)
IND	6	0	6
JPM	(242)	550	308
MSB	(1.262)	1.370	108
MYC	(43)	(64)	(107)
NGF	(903)	710	(193)
RBC	24	0	24
RYL	152	(30)	122
SCX	(627)	840	213
SOG	43	0	43
SSB	(209)	960	751
TOR	5	0	5
UAG	746	(770)	(24)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	98,58	75,39
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	28,35	46,98
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	5,35	1,22
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,91	0,29
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,42)	1,32
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(9,10)	(8,81)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(3,29)	(0,85)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Advantage Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	13.018.824	\$ 130.344	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.402.590	\$ 144.200
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.06.2018	¥ 3.430.000	32.347	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.06.2018	¥ 3.430.000	31.397
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 18.06.2018	2.800.000	26.409	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	\$ 20.400	20.142
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 21.487	20.928		<b>AKTIEN</b>	
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	20.400	20.137	PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)	137.410	17.018
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 18.09.2018	¥ 1.960.000	17.781	PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)	99.620	10.109
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 30.04.2025	\$ 15.000	14.845		<b>PARI (000S)</b>	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	¥ 700.000	6.591	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b)	\$ 10.019	9.902
United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 22.07.2047	£ 4.500	5.509	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 18.06.2018	¥ 840.000	7.689
Indonesia Government International Bond 9,000 % fällig am 15.03.2029	IDR 54.197.000	4.603	Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN 19.500	7.544
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b)	\$ 3.876	3.831	Peru Government International Bond 6,150 % fällig am 12.08.2032	21.700	7.353
QNB Finance Ltd. 3,713 % fällig am 07.02.2020	3.700	3.700	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	¥ 700.000	6.413
AT&T, Inc. 2,975 % fällig am 01.06.2021	3.700	3.700	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,650 % fällig am 23.04.2020	€ 4.502	5.653
QNB Finance Ltd. 3,705 % fällig am 12.02.2020	3.600	3.600	Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2047	DKK 26.700	4.387
Indonesia Government International Bond 8,250 % fällig am 15.05.2036	IDR 43.550.000	3.469	Saudi Government International Bond 3,625 % fällig am 04.03.2028	\$ 4.000	3.806
Banco Santander S.A. 4,750 % fällig am 19.03.2025	2.600	3.227	Bank Nederlandse Gemeenten NV 0,500 % fällig am 16.04.2025	€ 2.600	3.209
Bank Nederlandse Gemeenten NV 0,500 % fällig am 16.04.2025	2.600	3.197	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,450 % fällig am 01.03.2048	2.400	3.073
Nigeria Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.04.2019	NGN 1.205.000	3.004	Japan Government International Bond 0,500 % fällig am 20.09.2046	¥ 340.000	2.855
Verizon Communications, Inc. 3,443 % fällig am 15.05.2025	\$ 2.800	2.800	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.07.2022	\$ 2.900	2.810
			Ireland Government International Bond 1,000 % fällig am 15.05.2026	€ 2.000	2.508
			Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 31.10.2027	2.000	2.441
			Province of Alberta 1,250 % fällig am 01.06.2020	CAD 3.100	2.367

(a) Der Global Advantage Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Nennbetrag des Wertpapiers wurde 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Real Return 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 UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>DÄNEMARK</b>				<b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>					
<b>ARGENTINIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (e)</b>					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>BRFKredit A/S</b>				<b>Summe Irland</b>					
Argentina Government International Bond				2,500 % fällig am 01.10.2047	DKK	63	10	0,01					
5,875 % fällig am 11.01.2028	\$	100	82	0,08	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab								
6,875 % fällig am 26.01.2027		600	530	0,52	2,500 % fällig am 01.10.2047	10	2	0,00					
34,188 % fällig am 03.04.2022	ARS	479	15	0,02	Nykredit Realkredit A/S								
40,000 % fällig am 21.06.2020	5,434	196	0,19	2,500 % fällig am 01.10.2047	97	16	0,02		1,000	101	0,10		
Summe Argentinien		823	0,81	2,500 % fällig am 01.07.2047	69	11	0,01					1,313	1,29
						39	0,04						
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>ISRAEL</b>					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Denmark Government International Bond</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
Australia Government International Bond				0,100 % fällig am 15.11.2023 (c)	3,615	615	0,60	Israel Government International Bond					
0,750 % fällig am 21.11.2027 (c)	AUD	1,121	833	0,82	Summe Dänemark			4,000 % fällig am 30.05.2036 (c)					
1,250 % fällig am 21.02.2022 (c)		3,386	2,579	2,54				ILS					
3,000 % fällig am 20.09.2025 (c)	1,204	1,038	1,03					3,819					
Summe Australien		4,450	4,39					1,536					
								1,51					
<b>BRASILIEN</b>				<b>FRANKREICH</b>				<b>ITALIEN</b>					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
Petrobras Global Finance BV				6,000 % fällig am 15.05.2022	\$	600	603	0,60	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
5,999 % fällig am 27.01.2028	\$	583	529	0,52				0,450 % fällig am 22.05.2023 (c)					
7,375 % fällig am 17.01.2027		300	300	0,30				1,250 % fällig am 15.09.2032 (c)					
Summe Brasilien		829	0,82					1,300 % fällig am 15.05.2028 (c)					
								1,650 % fällig am 23.04.2020 (c)					
<b>KANADA</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Summe Italien</b>					
<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>France Government International Bond</b>				<b>Summe Japan</b>					
Enbridge, Inc.				0,100 % fällig am 01.03.2025 (c)	€	719	915	0,90	Japan Government International Bond				
2,737 % fällig am 10.01.2020	100	100	0,10	0,100 % fällig am 01.03.2028 (c)(f)	349	447	0,44	0,100 % fällig am 10.09.2024 (c)					
				0,100 % fällig am 25.07.2047 (c)	202	264	0,26	¥					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Summe Frankreich</b>				<b>Summe Japan</b>					
Canadian Government Real Return Bond						3,445	3,40	875,220					
1,250 % fällig am 01.12.2047 (c)	CAD	2,068	1,914	1,89				8,277					
2,000 % fällig am 01.12.2041 (c)	240	244	0,24					8,778					
								8,85					
Summe Kanada		2,158	2,13										
<b>CAYMAN INSELN</b>				<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>LUXEMBURG</b>					
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>					
Sudbury Mill CLO Ltd.				4,250 % fällig am 14.10.2021	\$	1,100	1,085	1,07	Delos Finance SARL				
3,503 % fällig am 17.01.2026	\$	469	470	0,46				4,084 % fällig am 06.10.2023					
Symphony CLO Ltd.								\$					
3,378 % fällig am 15.10.2025	492	492	0,49					100					
Summe Cayman Inseln		962	0,95					100					
								100					
<b>CHILE</b>				<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>				<b>MEXIKO</b>					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
Bonos de la Tesoreria de la Republica				3,800 % fällig am 15.09.2022	\$	600	598	0,59	Mexico Government International Bond				
1,500 % fällig am 01.03.2026	CLP	407,504	622	0,62				4,000 % fällig am 15.11.2040 (c)					
3,000 % fällig am 01.01.2044	244,502	426	0,42					4,500 % fällig am 04.12.2025 (c)					
Bonos del Banco Central de Chile en UF								50,310					
3,000 % fällig am 01.03.2022	2,064,685	3,400	3,35					2,817					
Summe Chile		4,448	4,39					6,902					
								6,80					
<b>KOLUMBIEN</b>				<b>IRLAND</b>				<b>NIEDERLANDE</b>					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>					
Colombian TES				Arbour CLO DAC				Cairn CLO BV					
3,000 % fällig am 25.03.2033	COP	6,248,996	1,999	1,97	0,580 % fällig am 15.03.2029	€	180	210	0,21	0,650 % fällig am 20.10.2028			
3,500 % fällig am 07.05.2025	1,328,504	470	0,46	0,800 % fällig am 26.04.2029				€					
Summe Kolumbien		2,469	2,43	0,620 % fällig am 16.04.2029	100	117	0,11	300					
				Harvest CLO DAC	270	315	0,31	350					
<b>ZYPERN</b>				<b>Summe Deutschland</b>				<b>Grosvenor Place CLO BV</b>					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Summe Deutschland</b>				<b>0,720 % fällig am 30.10.2029</b>					
Cyprus Government International Bond						1,801	1,78						
2,750 % fällig am 27.06.2024	€	10	12	0,01									
3,750 % fällig am 26.07.2023	40	52	0,05										
3,875 % fällig am 06.05.2022	40	51	0,05										
4,250 % fällig am 04.11.2025	70	94	0,10										
Summe Zypern		209	0,21										
<b>PERU</b>				<b>Summe Frankreich</b>				<b>Summe Mexiko</b>					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Summe Frankreich</b>				<b>Summe Mexiko</b>					
Peru Government International Bond						3,445	3,40						
6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN	1,200	377	0,37									

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>SAUDI-ARABIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Saudi Government International Bond			
4,000 % fällig am 17.04.2025	\$ 250	\$ 249	0,25
<b>SÜDAFRIKA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
South Africa Government International Bond			
1,875 % fällig am 28.02.2033 (c)	ZAR 15.253	974	0,96
2,000 % fällig am 31.01.2025 (c)	27.631	1.934	1,91
2,750 % fällig am 31.01.2022 (c)	9.413	691	0,68
3,450 % fällig am 07.12.2033 (c)	1.332	103	0,10
5,500 % fällig am 07.12.2023 (c)	6.628	552	0,54
Summe Südafrika		4.254	4,19
<b>SÜDKOREA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Korea Government International Bond CPI Linked Bond			
1,125 % fällig am 10.06.2023	KRW 2.913.415	2.642	2,60
<b>SPANIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Spain Government International Bond			
1,800 % fällig am 30.11.2024 (c)(f)	€ 1.432	1.950	1,92
<b>SCHWEDEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Sweden Government International Bond			
0,125 % fällig am 01.06.2032 (c)	SEK 3.684	488	0,48
0,250 % fällig am 01.06.2022 (c)	2.627	324	0,32
Summe Schweden		812	0,80
<b>SCHWEIZ</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
UBS AG			
2,639 % fällig am 07.12.2018	\$ 500	500	0,49
2,901 % fällig am 08.06.2020	500	502	0,50
Summe Schweiz		1.002	0,99
<b>TÜRKEI</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Turkey Government International Bond			
2,800 % fällig am 08.11.2023 (c)	TRY 25.284	5.432	5,36
<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nationwide Building Society			
10,250 % fällig am (d)	£ 2	419	0,41
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
United Kingdom Gilt			
0,125 % fällig am 22.03.2026 (c)(f)	4.227	6.460	6,37
0,125 % fällig am 22.03.2046 (c)	602	1.260	1,24
0,125 % fällig am 10.08.2048 (c)	325	705	0,70
0,125 % fällig am 22.11.2056 (c)	74	183	0,18
0,375 % fällig am 22.03.2062 (c)	166	485	0,48
0,750 % fällig am 22.03.2034 (c)	301	568	0,56
1,875 % fällig am 22.11.2022 (c)	1.278	1.996	1,97
2,500 % fällig am 16.04.2020 (c)(f)	3.587	5.100	5,03
4,250 % fällig am 07.12.2027	100	167	0,16
		16.924	16,69
Summe Großbritannien		17.343	17,10
<b>USA</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
CIT Mortgage Loan Trust			
3,441 % fällig am 25.10.2037	\$ 374	378	0,37
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
2,551 % fällig am 25.10.2035 ^	300	279	0,27

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>Fremont Home Loan Trust</b>			
2,828 % fällig am 25.07.2035	\$ 300	\$ 300	0,29
<b>GSAMP Trust</b>			
2,231 % fällig am 25.06.2036	578	566	0,56
<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>			
2,231 % fällig am 25.01.2046	9	9	0,01
<b>Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust</b>			
2,601 % fällig am 25.05.2035	1.300	1.246	1,23
<b>Residential Asset Securities Corp. Trust</b>			
2,511 % fällig am 25.12.2035	600	599	0,59
<b>VOLT LLC</b>			
3,375 % fällig am 25.04.2047	80	80	0,08
3,500 % fällig am 25.03.2047	67	67	0,07
		3.524	3,47

<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>American Honda Finance Corp.</b>			
2,713 % fällig am 05.11.2021	20	20	0,02
<b>AT&amp;T, Inc.</b>			
2,975 % fällig am 01.06.2021	100	100	0,10
3,298 % fällig am 15.07.2021	600	606	0,60
5,150 % fällig am 15.02.2050	100	94	0,09
<b>BAT Capital Corp.</b>			
2,945 % fällig am 14.08.2020	100	100	0,10
<b>CVS Health Corp.</b>			
3,700 % fällig am 09.03.2023	600	598	0,59
<b>Dell International LLC</b>			
3,480 % fällig am 01.06.2019	300	301	0,30
<b>Dominion Energy Gas Holdings LLC</b>			
2,928 % fällig am 15.06.2021	100	100	0,10
<b>eBay, Inc.</b>			
2,750 % fällig am 30.01.2023	100	96	0,09
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>			
2,876 % fällig am 31.10.2022	100	98	0,09
<b>Navient Corp.</b>			
5,500 % fällig am 15.01.2019	300	303	0,30
<b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b>			
2,636 % fällig am 03.09.2019	220	220	0,22
<b>Sempra Energy</b>			
2,791 % fällig am 15.03.2021	100	100	0,10
<b>VMware, Inc.</b>			
2,950 % fällig am 21.08.2022	100	96	0,09
		2.832	2,79

<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b>			
2,160 % fällig am 25.06.2047	374	375	0,37
<b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>			
2,731 % fällig am 25.07.2045	12	11	0,01
<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>			
3,522 % fällig am 25.06.2036	108	111	0,11
<b>MortgageIT Trust</b>			
3,096 % fällig am 25.12.2034	252	234	0,23
		731	0,72

<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
<b>Fannie Mae, TBA</b>			
3,500 % fällig am 01.07.2033 - 01.08.2048	11.960	11.916	11,75
4,000 % fällig am 01.08.2048	6.200	6.312	6,22
		18.228	17,97

<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>			
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)</b>			
0,125 % fällig am 15.04.2020	905	896	0,88
0,125 % fällig am 15.04.2022	267	261	0,26
0,125 % fällig am 15.07.2024 (f)	2.321	2.257	2,23
0,125 % fällig am 15.07.2026 (f)	732	701	0,69
0,250 % fällig am 15.01.2025	1.281	1.246	1,23
0,375 % fällig am 15.07.2025 (f)(g)	2.969	2.918	2,88
0,500 % fällig am 15.01.2028	2.263	2.215	2,18
0,625 % fällig am 15.01.2024 (f)	215	214	0,21
0,625 % fällig am 15.02.2043	109	103	0,10
0,750 % fällig am 15.02.2042	998	976	0,96
1,000 % fällig am 15.02.2048	483	499	0,49
1,250 % fällig am 15.07.2020	574	584	0,58

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
1,875 % fällig am 15.07.2019	\$ 469	\$ 477	0,47
2,125 % fällig am 15.02.2040 (f)	2.179	2.743	2,71
2,125 % fällig am 15.02.2041 (f)	1.258	1.595	1,57
2,375 % fällig am 15.01.2025 (f)	1.940	2.152	2,12
2,500 % fällig am 15.01.2029 (f)	3.675	4.323	4,26
3,375 % fällig am 15.04.2032	481	643	0,63
3,875 % fällig am 15.04.2029	570	752	0,74
<b>U.S. Treasury Notes</b>			
2,750 % fällig am 15.02.2024 (f)	3.000	2.997	2,96
Summe USA		53.867	53,10

<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
<b>Bank of Nova Scotia</b>			
1,527 % fällig am 05.07.2018	CAD 700	532	0,52
<b>HSBC Bank Canada</b>			
1,579 % fällig am 06.07.2018	200	152	0,15
<b>Royal Bank of Canada</b>			
1,527 % fällig am 06.07.2018	100	76	0,08
		760	0,75
<b>PENSIONSGESCHÄFTE (h)</b>			
		590	0,58

<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
2,171 % fällig am 27.07.2018 (a)(b)	\$ 100	100	0,09
2,830 % fällig am 13.07.2018 (a)(b)	100	100	0,10
25,500 % fällig am 14.09.2018 (a)(b)	ARS 200	6	0,01
		206	

<b>GREECE TREASURY BILLS</b>			
0,800 % fällig am 13.07.2018 (a)(b)	€ 110	129	0,13
1,082 % fällig am 05.10.2018 (a)(b)	110	128	0,13
1,211 % fällig am 31.08.2018 (a)(b)	500	583	0,57
		840	0,83

<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
(0,156)% fällig am 30.07.2018 (a)(b)	¥ 230.000	2.077	2,05
Summe kurzfristige Instrumente		4.473	4,41

<b>AKTIEN</b>			
<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)</b>			
	300.376	3.007	2,97
<b>Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt</b>			
		\$ 145.937	143,87

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Real Return 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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	3	\$ (3)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 162,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	8	(8)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Long	09/2018	8	6	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09/2018	10	18	0,02
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	26	25	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	15	20	0,02
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	1	2	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	5	(17)	(0,02)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	1	2	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 144,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	27	0	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 157,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	4	2	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2018	4	(2)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	21	3	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09/2018	32	(33)	(0,03)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09/2018	36	(164)	(0,16)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	5	(11)	(0,01)
				\$ (160)	(0,15)

## OPTIONSKAUF

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	\$ 120,500	24.08.2018	4	\$ 0	\$ 0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	133,000	24.08.2018	5	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	168,000	24.08.2018	1	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	170,000	24.08.2018	12	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	175,000	24.08.2018	25	1	0	0,00
				\$ 1	\$ 0	0,00

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	\$ 141,000	27.07.2018	1	\$ (1)	\$ 0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	142,000	27.07.2018	2	(2)	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	143,000	27.07.2018	4	(3)	(1)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	145,000	27.07.2018	2	(1)	(2)	(0,01)
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	146,000	27.07.2018	3	(2)	(2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	146,500	27.07.2018	2	(1)	(1)	0,00
				\$ (10)	\$ (6)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (166)	(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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.06.2022	\$ 400	\$ 2	0,00
Daimler AG	1,000	20.12.2020	€ 40	0	0,00
				\$ 2	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-30 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2023	\$ 5.820	\$ 28	0,03
iTraxx Europe Main 26 5-Year Index	(1,000)	20.12.2021	€ 1.100	(6)	(0,01)
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	3.100	27	0,03
				\$ 49	0,05

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000 %	15.12.2047	\$ 430	\$ 41	0,04
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,478	20.12.2047	254	(4)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,650	02.01.2025	BRL 8.400	(75)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,945	02.01.2025	41.900	(512)	(0,51)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,970	02.01.2025	56.300	(523)	(0,52)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,970	04.01.2027	1.200	3	0,00
Erhalt	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	NZD 1.000	(23)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	20.06.2020	\$ 12.800	7	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,850	20.07.2026	5.900	71	0,07
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,850	27.07.2026	1.350	16	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	3.400	(11)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,000	27.07.2026	3.900	51	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,150	19.06.2048	600	43	0,04
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	5.900	(167)	(0,17)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	2.710	18	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	2.600	10	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,300	27.04.2026	5.500	73	0,07
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,400	07.12.2026	700	9	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,500	19.12.2023	1.800	(49)	(0,05)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,655	19.10.2023	1.600	(45)	(0,04)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,670	19.11.2023	2.000	(55)	(0,06)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,681	12.12.2023	2.000	(55)	(0,05)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	3,100	17.04.2028	140	0	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	€ 1.850	31	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.09.2020	£ 16.890	(77)	(0,08)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	700	(13)	(0,01)
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,500	21.03.2068	460	37	0,04
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 190.000	(5)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	200.000	(9)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	1,165	15.12.2021	€ 2.320	39	0,04
Erhalt	CPTFEMU	1,505	26.06.2021	100	0	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,535	15.03.2028	100	(1)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,710	15.03.2033	100	0	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	100	(1)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,678	24.05.2021	\$ 3.200	44	0,04
Erhalt	CPURNSA	1,845	24.05.2026	500	(14)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,550	26.07.2021	700	6	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,603	12.09.2021	620	6	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,730	26.07.2026	700	(8)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	1,780	15.09.2026	500	(6)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	1,801	12.09.2026	620	(8)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,021	25.11.2020	800	6	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,027	23.11.2020	900	6	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,102	20.07.2027	400	(11)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,122	01.08.2027	1.200	(31)	(0,03)
Erhalt	CPURNSA	2,150	25.09.2027	200	(5)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,156	17.10.2027	500	(12)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,180	20.09.2027	240	(5)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,210	05.02.2023	1.240	8	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,263	27.04.2023	180	0	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,263	09.05.2023	380	1	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,281	10.05.2023	570	1	0,00
Zahlung	FRCPXTOB	1,345	15.06.2021	€ 1.120	1	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,350	15.01.2023	680	(4)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,575	15.01.2028	140	(1)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,590	15.02.2028	750	(2)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,606	15.02.2028	90	0	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,910	15.01.2038	220	2	0,00
Erhalt	UKRPI	3,350	15.05.2030	£ 3.700	114	0,11
Zahlung	UKRPI	3,428	15.03.2047	350	(33)	(0,03)
Erhalt	UKRPI	3,470	15.09.2032	1.400	33	0,03
Zahlung	UKRPI	3,585	15.10.2046	370	(25)	(0,03)
					\$ (1.113)	(1,10)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (1.062)</b>	<b>(1,05)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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 der Wertpapieranlagen des Global Advantage Real Return Fund (Forts.)

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* 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	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettöver- mögens
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,720 %	16.07.2018	\$ 700	\$ 8	\$ 15	0,01
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,765	16.07.2018	3.250	37	59	0,06
							\$ 45	\$ 74	0,07

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettöver- mögens
FAR	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 73,000	05.07.2018	\$ 2.660	\$ 0	\$ 0	0,00
JPM	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	69,000	05.07.2018	7.300	0	0	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2048	71,000	05.07.2018	8.200	1	0	0,00
					\$ 1	\$ 0	0,00

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettöver- mögens
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.07.2018	\$ 300	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	€ 1.600	(3)	(2)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 200	0	0	0,00
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	200	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	300	(1)	(1)	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 3.300	(7)	(8)	(0,01)
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 200	0	0	0,00
						\$ (12)	\$ (12)	(0,01)

#### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettöver- mögens
CBK	Call - OTC USD versus MXN	MXN 21,100	22.08.2018	\$ 382	\$ (4)	\$ (2)	0,00

#### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettöver- mögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	€ 2.400	\$ (109)	\$ (14)	(0,02)
JPM	Cap - OTC CPURNSA	\$ 233,916	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	22.04.2024	\$ 7.500	(55)	0	0,00
	Cap - OTC CPURNSA	\$ 234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	700	(5)	0	0,00
	Floor - OTC YOY CPURNSA	\$ 234,812	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	24.03.2020	10.900	(123)	(10)	(0,01)
						\$ (292)	\$ (24)	(0,03)

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettöver- mögens
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,250 %	04.12.2018	\$ 1.000	\$ (6)	\$ (4)	0,00

#### ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettöver- mögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	10-Year USD-ISDA -2-Year USD-ISDA	0,000 %	02.01.2020	9.600	\$ (7)	\$ (14)	(0,02)

<sup>(1)</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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2021	\$ 100	\$ (10)	\$ 6	\$ (4)	0,00
DUB	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2021	100	(8)	6	(2)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	200	(13)	4	(9)	(0,01)
					\$ (31)	\$ 16	\$ (15)	(0,01)

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
DUB	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,000 %	17.01.2047	\$ 720	\$ (22)	\$ 26	\$ 4	0,01
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,000	17.10.2057	500	(22)	24	2	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,000	17.10.2057	1.100	(56)	60	4	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,000	17.10.2057	1.800	(94)	100	6	0,01
MYC	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17.01.2047	580	(17)	21	4	0,00
					\$ (211)	\$ 231	\$ 20	0,02

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	1-Year ILS-TELBOR	1,963 %	16.02.2028	ILS 340	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,374)	20.06.2020	850	0	0	0	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	180	0	0	0	0,00
DUB	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	180	0	0	0	0,00
	Zahlung	CPURNSA	2,500	15.07.2022	\$ 500	3	(42)	(39)	(0,04)
GLM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	ILS 670	0	0	0	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,290)	16.02.2020	1.610	0	0	0	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,270)	21.03.2020	1.000	0	0	0	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,883	21.03.2028	210	0	0	0	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	140	0	0	0	0,00
JPM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,420)	20.06.2020	820	0	0	0	0,00
MYC	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	200	0	(10)	(10)	(0,01)
						\$ 3	\$ (52)	\$ (49)	(0,05)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07/2018	BRL 61.061	\$ 16.150	\$ 279	\$ 0	\$ 279	0,27
	07/2018	CLP 286.732	455	15	0	15	0,01
	07/2018	COP 1.459.881	506	9	0	9	0,01
	07/2018	TRY 2.224	477	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	\$ 98	ARS 2.539	0	(10)	(10)	(0,01)
	07/2018	2.271	AUD 3.076	2	0	2	0,00
	08/2018	AUD 3.076	\$ 2.271	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	€ 237	279	1	0	1	0,00
	08/2018	MXN 21.716	1.085	1	(12)	(11)	(0,01)
	08/2018	\$ 16.104	BRL 61.061	0	(289)	(289)	(0,28)
	08/2018	934	€ 802	7	(2)	5	0,01
	08/2018	2.493	ZAR 31.330	0	(218)	(218)	(0,22)
	08/2018	ZAR 5.728	\$ 453	38	0	38	0,04
BPS	07/2018	ARS 1.763	64	3	0	3	0,00
	07/2018	CLP 2.129.241	3.342	73	0	73	0,07
	07/2018	¥ 8.700	79	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 69	ARS 1.902	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	474	€ 405	0	0	0	0,00
	09/2018	16	IDR 221.134	0	0	0	0,00
	09/2018	335	INR 22.909	0	(4)	(4)	0,00
BRC	09/2018	KRW 144.011	\$ 130	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	DKK 3.645	606	36	0	36	0,03
	07/2018	£ 2.040	2.703	9	0	9	0,01
	07/2018	RUB 23.502	372	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	TRY 438	96	1	0	1	0,00
	08/2018	€ 94	110	0	0	0	0,00
	08/2018	MXN 10.027	496	0	(9)	(9)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	08/2018	\$ 2.458	€ 2.111	\$ 15	\$ 0	\$ 15	0,01
	08/2018	130	MXN 2.723	7	0	7	0,01
	08/2018	1.956	TRY 8.658	0	(102)	(102)	(0,10)
DUB	07/2018	ARS 4.936	\$ 177	6	0	6	0,01
	07/2018	\$ 25	ARS 634	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	4.197	BRL 15.628	0	(136)	(136)	(0,13)
FBF	07/2018	€ 20	\$ 25	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 1.013	COP 2.916.126	0	(21)	(21)	(0,02)
GLM	07/2018	AUD 3.076	\$ 2.312	40	0	40	0,04
	07/2018	BRL 619	165	4	0	4	0,00
	07/2018	£ 178	237	2	0	2	0,00
	07/2018	¥ 39.100	357	4	0	4	0,00
	07/2018	PEN 1.337	408	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 1.316	CLP 819.558	0	(57)	(57)	(0,06)
	08/2018	€ 97	\$ 115	1	0	1	0,00
	08/2018	\$ 798	€ 681	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	INR 22.668	\$ 329	2	0	2	0,00
HUS	07/2018	\$ 8.604	BRL 32.038	0	(277)	(277)	(0,27)
	07/2018	40	£ 31	0	0	0	0,00
	07/2018	373	RUB 23.502	2	0	2	0,00
	08/2018	€ 500	\$ 619	33	0	33	0,03
	08/2018	MXN 1.951	97	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	RUB 23.502	371	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	\$ 1.096	MXN 21.996	14	0	14	0,01
	08/2018	367	RUB 22.957	0	(3)	(3)	0,00
	09/2018	CNH 3.957	\$ 622	26	0	26	0,03
	10/2018	€ 30	37	2	0	2	0,00
IND	07/2018	TRY 317	69	1	0	1	0,00
JPM	07/2018	BRL 680	181	4	0	4	0,00
	07/2018	€ 90	112	7	0	7	0,01
	07/2018	¥ 160.000	1.472	25	0	25	0,02
	07/2018	NZD 1.543	1.067	22	0	22	0,02
	07/2018	\$ 129	£ 97	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	216	SEK 1.900	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	€ 491	\$ 585	10	0	10	0,01
	08/2018	ILS 970	274	8	0	8	0,01
	08/2018	MXN 2.727	138	1	0	1	0,00
	08/2018	\$ 903	CAD 1.150	0	(28)	(28)	(0,03)
	08/2018	ZAR 50.466	\$ 3.954	289	0	289	0,29
MSB	07/2018	CAD 300	231	3	0	3	0,00
	07/2018	¥ 70.000	644	11	0	11	0,01
	07/2018	\$ 3.998	BRL 14.694	0	(179)	(179)	(0,18)
	09/2018	ARS 508	\$ 23	6	0	6	0,01
NGF	09/2018	KRW 79.751	72	0	0	0	0,00
	09/2018	SGD 274	202	1	0	1	0,00
	09/2018	TWD 6.109	202	1	0	1	0,00
RYL	07/2018	TRY 349	74	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	€ 212	254	6	0	6	0,01
	10/2018	80	100	6	0	6	0,01
SCX	07/2018	CAD 700	541	9	0	9	0,01
	07/2018	¥ 11.100	102	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 1.052	NZD 1.543	0	(8)	(8)	(0,01)
	08/2018	€ 239	\$ 281	1	0	1	0,00
	08/2018	NZD 1.543	1.052	8	0	8	0,01
	08/2018	\$ 1.912	€ 1.616	0	(20)	(20)	(0,02)
	09/2018	KRW 622.850	\$ 579	19	0	19	0,02
SOG	08/2018	\$ 10	ARS 211	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	1.082	ILS 3.903	0	(13)	(13)	(0,01)
SSB	08/2018	CAD 434	\$ 340	10	0	10	0,01
	09/2018	\$ 213	IDR 2.994.706	0	(7)	(7)	(0,01)
TOR	07/2018	536	¥ 58.900	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	¥ 58.900	\$ 537	4	0	4	0,00
UAG	07/2018	\$ 2.804	£ 2.121	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	£ 2.121	\$ 2.808	4	0	4	0,00
	08/2018	\$ 3.002	MXN 58.747	0	(39)	(39)	(0,04)
				\$ 1.092	\$ (1.471)	\$ (379)	(0,37)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CHF (Partially Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07/2018	\$ 225	AUD 304	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08/2018	AUD 304	\$ 225	0	0	0	0,00
BPS	07/2018	€ 1.361	1.578	0	(10)	(10)	(0,01)
	07/2018	¥ 73.745	679	13	0	13	0,01
CBK	07/2018	CAD 350	269	3	0	3	0,00
	07/2018	£ 324	429	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 2.397	CHF 2.368	0	(13)	(13)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
GLM	07/2018	AUD 304	\$ 229	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	07/2018	CHF 2.402	\$ 2.408	0	(12)	(12)	(0,01)
	07/2018	\$ 3.145	CHF 3.112	0	(11)	(11)	(0,01)
	08/2018	2.322	2.312	12	0	12	0,01
HUS	07/2018	263	CAD 350	3	0	3	0,00
	08/2018	CAD 350	\$ 263	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07/2018	CHF 3.078	\$ 3.106	7	0	7	0,01
	08/2018	\$ 3.114	CHF 3.078	0	(7)	(7)	(0,01)
RYL	07/2018	63	€ 54	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	NZD 37	\$ 26	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 100	SEK 891	0	0	0	0,00
	08/2018	SEK 891	\$ 100	0	0	0	0,00
SOG	07/2018	891	100	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	\$ 1.521	€ 1.307	5	0	5	0,01
	08/2018	€ 1.307	\$ 1.525	0	(4)	(4)	0,00
TOR	07/2018	\$ 671	¥ 73.745	0	(5)	(5)	(0,01)
	08/2018	¥ 73.745	\$ 673	5	0	5	0,01
UAG	07/2018	\$ 428	£ 324	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	£ 324	\$ 429	1	0	1	0,00
				\$ 56	\$ (66)	\$ (10)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Class E EUR (Partially Hedged) und Class G Institutional EUR (Partially Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07/2018	\$ 1.304	AUD 1.767	\$ 1	\$ 0	£ 1	0,00
	07/2018	35	CAD 45	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	AUD 1.767	\$ 1.305	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07/2018	€ 3.854	4.484	0	(16)	(16)	(0,02)
	07/2018	¥ 430.815	3.967	77	0	77	0,08
	07/2018	\$ 17.947	€ 15.474	119	0	119	0,12
	08/2018	4.494	3.854	15	0	15	0,01
BRC	07/2018	27	AUD 36	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2018	CAD 2.261	\$ 1.736	18	0	18	0,02
	07/2018	€ 73	85	0	0	0	0,00
	07/2018	£ 1.655	2.193	8	0	8	0,01
	07/2018	\$ 223	¥ 24.511	0	(2)	(2)	0,00
GLM	07/2018	AUD 1.803	\$ 1.355	23	0	23	0,02
	07/2018	\$ 6	€ 5	0	0	0	0,00
	07/2018	81	¥ 8.750	0	(1)	(1)	0,00
HUS	07/2018	1.665	CAD 2.216	19	0	19	0,02
	08/2018	CAD 2.216	\$ 1.666	0	(19)	(19)	(0,02)
RYL	07/2018	€ 407	477	2	0	2	0,00
SCX	07/2018	114	133	0	0	0	0,00
	07/2018	NZD 610	430	17	0	17	0,02
	07/2018	\$ 200	€ 169	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	44	£ 33	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	711	SEK 6.334	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	SEK 6.334	\$ 713	3	0	3	0,00
SOG	07/2018	6.334	711	3	0	3	0,00
SSB	07/2018	€ 14.775	17.200	0	(51)	(51)	(0,05)
	07/2018	£ 190	255	5	0	5	0,00
	07/2018	\$ 4.165	€ 3.580	14	0	14	0,01
	08/2018	17.238	14.775	50	0	50	0,05
TOR	07/2018	3.618	¥ 397.554	0	(29)	(29)	(0,03)
	08/2018	¥ 397.554	\$ 3.626	30	0	30	0,03
UAG	07/2018	\$ 2.396	£ 1.812	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	£ 1.812	\$ 2.399	4	0	4	0,00
				\$ 408	\$ (131)	\$ 277	0,27

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Partially Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	07/2018	£ 15	\$ 20	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	07/2018	\$ 318	AUD 431	0	0	0	0,00
	08/2018	AUD 431	\$ 318	0	0	0	0,00
BPS	07/2018	€ 1.730	2.006	0	(13)	(13)	(0,01)
	07/2018	£ 5	6	0	0	0	0,00
	07/2018	¥ 97.854	901	17	0	17	0,02
BRC	07/2018	£ 1.806	2.362	1	(23)	(22)	(0,02)
	08/2018	£ 2.342	£ 1.788	22	0	22	0,02
CBK	07/2018	CAD 478	\$ 367	4	0	4	0,00
	07/2018	£ 26	35	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 12	€ 10	0	0	0	0,00
	07/2018	3.948	£ 2.980	0	(14)	(14)	(0,01)
	07/2018	73	¥ 7.979	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07/2018	AUD 431	\$ 324	6	0	6	0,01
	07/2018	SEK 924	105	2	0	2	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	07/2018	\$ 7	€ 6	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2018	35	£ 26	0	0	0	0,00
HUS	07/2018	359	CAD 478	4	0	4	0,00
	08/2018	CAD 478	\$ 359	0	(4)	(4)	0,00
RYL	07/2018	€ 9	11	0	0	0	0,00
	07/2018	£ 30	40	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	14	19	0	0	0	0,00
	07/2018	NZD 62	44	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 74	€ 63	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	2.358	£ 1.774	0	(16)	(16)	(0,02)
SSB	07/2018	£ 28	\$ 36	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 1.932	€ 1.660	6	0	6	0,01
	07/2018	£ 61	45	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	€ 1.660	\$ 1.936	0	(6)	(6)	(0,01)
TOR	07/2018	\$ 818	¥ 89.875	0	(7)	(7)	(0,01)
	08/2018	¥ 89.875	\$ 820	7	0	7	0,01
UAG	07/2018	£ 2.914	3.854	6	0	6	0,01
	08/2018	\$ 3.859	£ 2.914	0	(6)	(6)	(0,01)
				\$ 77	\$ (92)	\$ (15)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (153) (0,15)

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Fannie Mae, TBA			
3,000 % fällig am 01.08.2048	\$ 1.100	\$ (1.065)	(1,05)
Summe leerverkaufte Wertpapiere		\$ (1.065)	(1,05)
Summe Anlagen		\$ 143.491	141,46
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (42.052)	(41,46)
Nettovermögen		\$ 101.439	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) Nullkuponwertpapier.

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

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 29.456 als Sicherheiten verpfändet.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 623 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 2.659 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 480 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(h) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 590	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 16.11.2009	\$ (605)	\$ 590	\$ 590	0,58
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (605)	\$ 590	\$ 590	0,58

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

**Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 3.108	\$ 142.829	\$ 0	\$ 145.937
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(167)	(1.214)	0	(1.381)
Leerverkäufe	0	(1.065)	0	(1.065)
<b>Summen</b>	<b>\$ 2.941</b>	<b>\$ 140.550</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 143.491</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 305	\$ 178.045	\$ 0	\$ 178.350
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	39	(1.089)	0	(1.050)
Leerverkäufe	0	(2.397)	0	(2.397)
<b>Summen</b>	<b>\$ 344</b>	<b>\$ 174.559</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 174.903</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 der Wertpapieranlagen.

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:**

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	1,980 %	01.05.2018	02.07.2018	\$ (2.236)	\$ (2.243)	(2,21)
	2,000	22.06.2018	09.07.2018	(2.575)	(2.576)	(2,54)
BPS	(0,450)	19.04.2018	19.07.2018	€ (110)	(128)	(0,12)
	(0,380)	24.04.2018	25.07.2018	(1.565)	(1.826)	(1,80)
GRE	1,950	23.04.2018	23.07.2018	\$ (143)	(144)	(0,14)
	2,040	10.05.2018	17.07.2018	(1.326)	(1.330)	(1,31)
	2,130	11.06.2018	11.07.2018	(2.951)	(2.955)	(2,91)
IND	1,980	03.05.2018	03.07.2018	(3.628)	(3.640)	(3,59)
	2,010	09.05.2018	09.07.2018	(3.000)	(3.009)	(2,97)
	2,040	11.05.2018	11.07.2018	(1.434)	(1.438)	(1,42)
SCX	0,640	26.04.2018	26.07.2018	£ (2.892)	(3.823)	(3,77)
	0,640	23.05.2018	26.07.2018	(4.660)	(6.156)	(6,07)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (29.268)</b>	<b>(28,85)</b>

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2018:**

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkaufgeschäfte	% des Nettovermögens
TDM	1,900 %	11.04.2018	11.07.2018	\$ (620)	\$ (622)	(0,61)
<b>Summe Rückkaufgeschäfte</b>					<b>\$ (622)</b>	<b>(0,61)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (187)	\$ 0	\$ (187)
BPS	269	(30)	239
BRC	(1)	0	(1)
CBK	(52)	40	(12)
CKL	(8)	0	(8)
DUB	(168)	(180)	(348)
FBF	(20)	0	(20)
GLM	4	0	4
GST	4	0	4
HUS	(216)	290	74
IND	1	0	1
JPM	324	(300)	24
MEI	6	0	6
MSB	(159)	30	(129)
MYC	54	0	54
NGF	2	0	2
RYL	13	0	13

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
SCX	\$ 11	\$ 0	\$ 11
SOG	(13)	0	(13)
SSB	21	0	21
TOR	1	0	1
UAG	(39)	120	81

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	113,72	102,14
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,85	37,92
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	5,30	0,99
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,16)	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,05)	(0,26)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,15)	(0,60)
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,05)	(1,90)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(28,85)	(35,77)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,61)	(1,87)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Advantage Real Return Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
Pimco Funds Ireland p.l.c - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	2.577.350	\$ 25.805	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	2.297.228	\$ 23.000
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£ 2.864	4.648	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 8.582	9.527
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 3.571	3.957	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£ 5.875	9.326
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	3.914	3.830	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2024	\$ 7.890	7.760
South Africa Government International Bond 2,750 % fällig am 31.01.2022	ZAR 39.314	3.389	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b)	4.037	4.385
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 2.291	2.232	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.09.2024	JPY 371.480	3.553
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b)	2.018	2.192	France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2021	€ 2.180	2.672
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 01.05.2018	JPY 230.000	2.117	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.02.2040 (b)	\$ 2.071	2.573
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2024	\$ 2.100	2.107	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2024	2.500	2.508
Japan Treasury Bills 0 % fällig am 30.07.2018	JPY 230.000	2.104	South Africa Government International Bond 5,500 % fällig am 07.12.2023	ZAR 25.024	2.479
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€ 1.384	1.966	South Africa Government International Bond 2,750 % fällig am 31.01.2022	30.456	2.466
U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.12.2024	\$ 1.800	1.777	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.07.2018 (b)	\$ 1.959	1.966
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	JPY 180.000	1.695	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2046	£ 862	1.872
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	143.400	1.352	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2022	€ 1.464	1.786
United Kingdom Gilt 4,500 % fällig am 07.12.2042	£ 630	1.313	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.12.2024	\$ 1.800	1.778
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2023	€ 1.012	1.289	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€ 1.257	1.695
U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.05.2048	\$ 1.200	1.207	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 1.680	1.638
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2025	€ 713	943	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2027	JPY 151.203	1.466
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)	\$ 907	908	Bonos de la Tesoreria de la Republica 3,000 % fällig am 01.01.2044	CLP 757.607	1.360
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b)	868	867	United Kingdom Gilt 4,500 % fällig am 07.12.2042	£ 630	1.325
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£ 361	811	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2023	€ 1.017	1.243
			U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.05.2048	\$ 1.200	1.207
			Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 15.11.2040	MXN 21.044	1.093

(a) Der Global Advantage Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.







BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
(0,180)% fällig am 23.07.2018 (b)(c)	¥ 200.000	\$ 1.806	0,41
(0,169)% fällig am 17.07.2018 (b)(c)	130.000	1.174	0,27
(0,156)% fällig am 30.07.2018 (b)(c)	180.000	1.625	0,37
(0,148)% fällig am 03.09.2018 (b)(c)	1.350.000	12.190	2,76
(0,139)% fällig am 02.07.2018 (b)(c)	70.000	632	0,14
(0,139)% fällig am 20.08.2018 (b)(c)	1.320.000	11.919	2,70
(0,136)% fällig am 09.07.2018 (b)(c)	390.000	3.521	0,80
(0,130)% fällig am 10.09.2018 (b)(c)	550.000	4.967	1,13
(0,123)% fällig am 06.08.2018 (b)(c)	2.600.000	23.476	5,32
		61.310	13,90
Summe kurzfristige Instrumente		141.332	32,05
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt	\$ 539.455		122,34

#### 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 Nettover- mögens
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2019	522	\$ (70)	(0,02)
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2020	522	(30)	(0,01)
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2019	845	(273)	(0,06)
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03/2020	845	152	0,04
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2018	44	(28)	(0,01)
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09/2019	44	42	0,01
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 133,000 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	59	1	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 152,000 EUR auf Euro-BTP 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	23	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 160,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	27	(71)	(0,02)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 160,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	7	(15)	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	9	(26)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Long	09/2018	418	203	0,05
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	23	22	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	30	45	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	7	36	0,01
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	221	(356)	(0,08)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	10	19	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 131,250 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Short	08/2018	59	1	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 156,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	7	3	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	258	46	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	160	80	0,02
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09/2018	152	469	0,11
United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate December Futures	Long	12/2018	440	17	0,00
United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate December Futures	Short	12/2019	440	(7)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	41	(95)	(0,02)
				\$ 165	0,04

#### OPTIONSKAUF

##### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Mark- twert	% des Nettover- mögens
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	\$ 107,750	24.08.2018	84	\$ 1	\$ 1	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note October 2018 Futures	106,000	21.09.2018	129	1	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note October 2018 Futures	107,000	21.09.2018	21	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	109,000	24.08.2018	33	0	0	0,00
				\$ 2	\$ 1	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettover-mögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 119,000	27.07.2018	26	\$ (8)	\$ (2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	120,500	27.07.2018	26	(6)	(9)	0,00
				\$ (14)	\$ (11)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 155	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>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettover-mögens
Tesco PLC	1,000 %	20.06.2022	€ 100	\$ 3	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2025	300	(3)	0,00
				\$ 0	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettover-mögens
CDX.IG-29 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2022	\$ 14.400	\$ 35	0,01
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	€ 6.000	46	0,01
				\$ 81	0,02

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettover-mögens
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,673 %	30.04.2025	\$ 900	\$ (10)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,683	30.04.2025	2.800	(35)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,684	30.04.2025	900	(11)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,696	30.04.2025	900	(12)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,710	30.04.2025	1.000	(14)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,714	30.04.2025	1.900	(27)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,880	04.01.2021	BRL 16.600	(24)	(0,01)
Erhalt	3-Month CAD Bank Bill	1,850	15.09.2027	CAD 4.700	(6)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD Bank Bill	2,300	16.07.2020	28.300	48	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month NZD-BBR	2,500	14.02.2020	NZD 58.500	71	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,000	02.03.2020	\$ 92.400	(3)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,000	26.04.2022	21.400	(4)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,000	27.04.2023	13.700	(3)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,750	01.04.2019	175.000	(501)	(0,11)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	20.06.2020	12.000	17	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.12.2019	700	11	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,000	01.04.2020	175.000	639	0,14
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	10.100	(21)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	3.000	(16)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	7.000	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,326	12.06.2022	2.400	2	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,326	19.06.2022	5.300	4	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	5.400	(40)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	11.900	790	0,18
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	20.06.2023	ZAR 118.300	(219)	(0,05)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	19.09.2020	€ 11.350	35	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	19.12.2020	4.400	11	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	20.300	325	0,07
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.12.2023	16.300	165	0,04
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	5.700	93	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.12.2028	21.100	278	0,06
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.09.2048	2.525	(86)	(0,02)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.12.2048	400	(11)	0,00
Zahlung	6-Month GBP-LIBOR	0,500	15.03.2019	£ 2.475	(4)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	19.09.2019	33.200	42	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	18.09.2020	33.200	(45)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.12.2019	30.300	67	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.09.2020	1.100	(5)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	18.12.2020	30.300	(73)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	1.150	(12)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	600	(1)	0,00
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.12.2028	1.300	(9)	0,00
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,500	21.03.2068	100	4	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	1.200	16	0,00

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,100 %	20.03.2024	¥ 3.200.000	\$ 26	0,01
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	20.000	(2)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	390.000	(30)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,380	18.06.2028	90.000	(9)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,399	18.06.2028	90.000	(9)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	2.025.000	(47)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,500	20.09.2046	50.000	(24)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,825	12.01.2023	MXN 2.500	1	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,730	25.02.2027	8.000	(23)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,005	21.12.2027	5.000	(4)	0,00
					\$ 1.301	0,29
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 1.382</b>	<b>0,31</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

#### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

#### OPTIONSKAUF

##### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus JPY	¥ 120.000	17.04.2020	\$ 558	\$ 10	\$ 3	0,00
CBK	Call - OTC USD versus CAD	CAD 1,370	17.08.2018	2.255	4	3	0,00
GLM	Call - OTC USD versus JPY	¥ 120.000	20.04.2020	378	7	2	0,00
HUS	Put - OTC EUR versus USD	\$ 1,140	24.05.2019	€ 2.100	27	31	0,01
MSB	Call - OTC EUR versus USD	1,291	24.06.2021	345	21	21	0,00
	Put - OTC EUR versus USD	1,291	24.06.2021	345	25	24	0,01
SCX	Put - OTC USD versus INR	INR 69,220	25.10.2018	\$ 1.244	18	16	0,00
					\$ 112	£ 100	0,02

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC USD versus KRW	KRW 1.200.000	25.10.2018	\$ 1.244	\$ (5)	\$ (5)	0,00
CBK	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,315	14.06.2019	£ 1.302	(41)	(40)	(0,01)
	Call - OTC GBP versus USD	1,440	14.06.2019	1.351	(19)	(15)	0,00
	Put - OTC USD versus CAD	CAD 1,305	17.08.2018	\$ 1.503	(12)	(12)	0,00
HUS	Call - OTC EUR versus USD	\$ 1,270	24.05.2019	€ 2.100	(29)	(22)	(0,01)
					\$ (106)	\$ (94)	(0,02)

#### 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	Japan Government International Bond	(1,000) %	20.06.2022	\$ 100	(4)	\$ 1	\$ (3)	0,00
BPS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	100	(3)	0	(3)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.500	(37)	2	(35)	(0,01)
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	600	(11)	2	(9)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	300	(10)	1	(9)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	500	(12)	0	(12)	0,00
CBK	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	800	(29)	4	(25)	(0,01)
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.300	(25)	6	(19)	(0,01)
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	500	(17)	1	(16)	0,00
HUS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	600	(15)	1	(14)	0,00
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	900	(22)	1	(21)	(0,01)
					\$ (185)	\$ 19	\$ (166)	(0,04)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds 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
BPS	Variable Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,362 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	26.09.2027	AUD 800	\$ 634	\$ 4	\$ (47)	\$ (43)	(0,01)
	Variable Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,368 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	05.10.2027	500	394	(1)	(24)	(25)	(0,01)
CBK	Variable Zinssatz entspricht 3-Month GBP-LIBOR abzgl. 0,055 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	13.10.2026	200	244	6	11	17	0,01
MYC	Variable Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,368 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	06.10.2027	616	482	1	(28)	(27)	(0,01)
						\$ 10	\$ (88)	\$ (78)	(0,02)

### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(2,030) %	10.07.2027	KRW 1.000.000	\$ 13	\$ (1)	\$ 12	0,00
CBK	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(2,013)	10.07.2027	4.536.700	(11)	74	63	0,02
						\$ 2	\$ 73	\$ 75	0,02

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07/2018	ARS 8.516	\$ 309	\$ 14	\$ 0	\$ 14	0,00
	07/2018	AUD 1.481	1.119	24	0	24	0,01
	07/2018	¥ 148.900	1.387	42	0	42	0,01
	07/2018	KRW 248.854	229	5	0	5	0,00
	07/2018	NOK 25.275	3.101	0	0	0	0,00
	07/2018	TRY 14.416	3.092	0	(31)	(31)	(0,01)
	07/2018	\$ 257	ARS 7.251	0	(10)	(10)	0,00
	07/2018	10.842	AUD 14.687	10	0	10	0,00
	07/2018	484	€ 411	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	273	INR 18.660	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	AUD 14.687	\$ 10.843	0	(10)	(10)	0,00
	08/2018	¥ 260.000	2.386	33	0	33	0,01
	08/2018	\$ 28	BRL 107	0	0	0	0,00
	08/2018	1.056	CZK 22.143	0	(60)	(60)	(0,01)
	08/2018	330	MXN 6.313	0	(12)	(12)	0,00
	08/2018	ZAR 1.786	\$ 141	11	0	11	0,00
	09/2018	SGD 7.425	5.592	137	0	137	0,03
	09/2018	\$ 226	INR 15.600	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	1.249	RUB 78.226	0	(11)	(11)	0,00
	BPS	07/2018	ARS 3.850	\$ 145	14	0	14
07/2018		€ 53.735	62.377	0	(361)	(361)	(0,08)
07/2018		¥ 567.737	5.227	102	0	102	0,02
07/2018		KRW 496.344	448	2	0	2	0,00
07/2018		PEN 10	3	0	0	0	0,00
07/2018		\$ 264	ARS 7.423	0	(6)	(6)	0,00
07/2018		60.654	€ 52.131	211	0	211	0,05
07/2018		455	£ 342	0	(4)	(4)	0,00
08/2018		ARS 150	\$ 7	2	0	2	0,00
08/2018		€ 52.131	60.789	0	(208)	(208)	(0,05)
08/2018		\$ 434	AUD 556	0	(23)	(23)	(0,01)
08/2018		196	MXN 3.726	0	(8)	(8)	0,00
09/2018		TWD 165.225	\$ 5.623	175	0	175	0,04
09/2018		\$ 251	CNH 1.633	0	(5)	(5)	0,00
09/2018		480	IDR 6.753.118	0	(14)	(14)	0,00
09/2018		3	PEN 10	0	0	0	0,00
10/2018	KRW 138.303	\$ 124	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
BRC	07/2018	ARS 9.267	\$ 340	\$ 24	\$ 0	\$ 24	0,01
	07/2018	\$ 32.187	£ 24.614	310	0	310	0,07
	08/2018	£ 24.614	\$ 32.232	0	(309)	(309)	(0,07)
	09/2018	\$ 827	ARS 22.981	0	(90)	(90)	(0,02)
	09/2018	1.085	INR 75.006	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2018	ARS 1.922	\$ 67	2	0	2	0,00
	07/2018	CAD 18.677	14.346	148	0	148	0,03
	07/2018	COP 3.080.670	1.046	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	DKK 56.150	9.355	556	0	556	0,13
	07/2018	£ 19.687	26.131	139	0	139	0,03
	07/2018	¥ 590.000	5.542	211	0	211	0,05
	07/2018	\$ 294	COP 840.840	0	(8)	(8)	0,00
	07/2018	1.061	£ 805	3	0	3	0,00
	07/2018	2.051	RUB 129.730	16	0	16	0,00
	07/2018	308	TRY 1.413	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	CZK 22.311	\$ 1.020	16	0	16	0,00
	08/2018	¥ 130.000	1.179	1	0	1	0,00
	08/2018	MXN 27.727	1.423	24	0	24	0,01
	08/2018	RON 2.686	676	5	0	5	0,00
	08/2018	\$ 28	ARS 578	0	(9)	(9)	0,00
	08/2018	812	CAD 1.070	2	0	2	0,00
	08/2018	6.495	MXN 124.694	0	(205)	(205)	(0,05)
	08/2018	2.562	TRY 11.339	0	(132)	(132)	(0,03)
	09/2018	353	CNH 2.349	0	0	0	0,00
	09/2018	1.043	COP 3.080.670	2	0	2	0,00
	04/2019	SEK 1.771	€ 172	3	0	3	0,00
	06/2019	£ 458	\$ 614	0	(1)	(1)	0,00
FBF	07/2018	COP 741.064	272	20	0	20	0,01
	07/2018	KRW 841.338	774	18	0	18	0,00
	04/2019	€ 335	SEK 3.436	0	(7)	(7)	0,00
GLM	07/2018	ARS 686	\$ 24	1	0	1	0,00
	07/2018	AUD 13.811	10.382	178	0	178	0,04
	07/2018	CAD 445	AUD 460	2	0	2	0,00
	07/2018	315	\$ 237	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	€ 2.532	2.946	0	(10)	(10)	0,00
	07/2018	KRW 938.730	847	3	0	3	0,00
	07/2018	SEK 28.715	3.279	70	0	70	0,02
	07/2018	\$ 258	€ 219	0	(3)	(3)	0,00
	09/2018	RON 2.709	576	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 300	CNY 1.973	0	(4)	(4)	0,00
	10/2018	DKK 13.812	\$ 2.140	0	(39)	(39)	(0,01)
HUS	07/2018	ARS 3.248	124	14	0	14	0,00
	07/2018	KRW 686.875	622	5	0	5	0,00
	07/2018	RUB 264.820	4.201	0	(19)	(19)	0,00
	07/2018	\$ 13.694	CAD 18.220	158	0	158	0,04
	08/2018	CAD 18.220	\$ 13.702	0	(156)	(156)	(0,03)
	08/2018	RON 2.641	669	9	0	9	0,00
	08/2018	\$ 4.182	RUB 264.820	19	0	19	0,00
	01/2019	€ 678	\$ 815	10	0	10	0,00
	05/2019	\$ 1.052	€ 871	0	(7)	(7)	0,00
JPM	07/2018	ARS 548	\$ 21	2	0	2	0,00
	07/2018	AUD 153	112	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	CAD 1.329	996	0	(14)	(14)	0,00
	07/2018	£ 2.604	3.447	14	(5)	9	0,00
	07/2018	¥ 120.000	1.104	19	0	19	0,00
	07/2018	SEK 123.970	13.991	134	0	134	0,03
	07/2018	\$ 1.491	CAD 1.978	13	0	13	0,00
	07/2018	1.041	COP 2.980.894	0	(27)	(27)	(0,01)
	07/2018	4.985	€ 4.244	0	(30)	(30)	(0,01)
	07/2018	3.031	NOK 25.125	52	0	52	0,01
	07/2018	2.112	RUB 135.090	41	0	41	0,01
	08/2018	¥ 3.120.000	\$ 28.529	291	0	291	0,07
	08/2018	RUB 13.136	209	1	0	1	0,00
	08/2018	\$ 484	TRY 2.019	0	(51)	(51)	(0,01)
	09/2018	¥ 1.900.000	\$ 17.500	271	0	271	0,06
	09/2018	RON 466	€ 99	0	0	0	0,00
	01/2019	\$ 695	553	0	(39)	(39)	(0,01)
MSB	07/2018	CAD 1.206	\$ 930	13	0	13	0,00
	07/2018	€ 738	852	0	(10)	(10)	0,00
	07/2018	¥ 190.000	1.776	59	0	59	0,01
	07/2018	PLN 1.400	412	38	0	38	0,01
	07/2018	\$ 5.860	¥ 646.637	0	(22)	(22)	(0,01)
	07/2018	3	PEN 10	0	0	0	0,00
	08/2018	¥ 1.056.637	\$ 9.589	26	0	26	0,01
	08/2018	\$ 21	ARS 444	0	(7)	(7)	0,00
	06/2021	29	€ 23	0	0	0	0,00
NGF	07/2018	KRW 217.090	\$ 196	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 1.024	INR 70.036	0	(4)	(4)	0,00
	09/2018	10.527	CNH 67.213	0	(413)	(413)	(0,09)
	09/2018	844	INR 57.227	0	(17)	(17)	0,00
RBC	07/2018	£ 279	\$ 369	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 561	AUD 758	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	CNH 2.203	\$ 343	12	0	12	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
RYL	04/2019	SEK 2.411	€ 232	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
SCX	07/2018	£ 2.339	\$ 3.131	43	0	43	0,01
	07/2018	\$ 8.757	DKK 55.872	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	17.147	SEK 152.685	0	(79)	(79)	(0,02)
	08/2018	RUB 61.785	\$ 986	6	0	6	0,00
	08/2018	SEK 152.685	17.186	81	0	81	0,02
	08/2018	\$ 441	AUD 566	0	(23)	(23)	(0,01)
	08/2018	ZAR 1.412	\$ 107	4	0	4	0,00
	09/2018	IDR 6.522.198	456	5	0	5	0,00
	09/2018	KRW 188.771	176	6	0	6	0,00
	09/2018	TWD 7.060	232	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	\$ 310	CNH 1.983	0	(11)	(11)	0,00
	09/2018	166	TWD 4.932	0	(3)	(3)	0,00
	10/2018	DKK 55.872	\$ 8.821	3	0	3	0,00
	10/2018	INR 47.533	687	3	0	3	0,00
				\$ 3.891	\$ (2.537)	\$ 1.354	0,31

### ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Class Z AUD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	07/2018	\$ 1.433	AUD 1.904	\$ 0	\$ (26)	\$ (26)	(0,01)
BOA	07/2018	AUD 2.872	\$ 2.120	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	\$ 2.121	AUD 2.872	1	0	1	0,00
BRC	07/2018	28	36	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07/2018	AUD 2.893	\$ 2.125	0	(12)	(12)	0,00
	07/2018	\$ 1.529	AUD 2.037	0	(24)	(24)	(0,01)
	08/2018	2.125	2.893	12	0	12	0,01
HUS	07/2018	1.535	2.040	0	(28)	(28)	(0,01)
JPM	07/2018	AUD 45	\$ 34	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 1.430	AUD 1.886	0	(37)	(37)	(0,01)
RBC	07/2018	32	44	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	AUD 2	\$ 2	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	\$ 551	AUD 743	1	(3)	(2)	0,00
				\$ 15	\$ (133)	\$ (118)	(0,03)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutionell CHF (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07/2018	\$ 508	CHF 500	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
CBK	07/2018	510	504	0	(3)	(3)	0,00
GLM	07/2018	CHF 506	\$ 507	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	\$ 507	CHF 502	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	507	505	3	0	3	0,00
JPM	07/2018	CHF 504	\$ 509	1	0	1	0,00
	08/2018	\$ 510	CHF 504	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07/2018	6	6	0	0	0	0,00
				\$ 4	\$ (13)	\$ (9)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutionell EUR (Hegend) Class und Class E EUR (Hegend) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07/2018	\$ 48.823	€ 41.592	\$ 0	\$ (262)	\$ (262)	(0,06)
BPS	07/2018	€ 45.908	\$ 53.414	0	(186)	(186)	(0,04)
	07/2018	\$ 48.212	€ 41.567	320	0	320	0,07
	08/2018	53.533	45.908	183	0	183	0,04
BRC	07/2018	328	278	0	(3)	(3)	0,00
CBK	07/2018	508	433	2	(4)	(2)	0,00
GLM	07/2018	488	419	2	(1)	1	0,00
HUS	07/2018	12.845	10.999	0	(3)	(3)	0,00
MSB	07/2018	€ 45.954	\$ 53.077	0	(577)	(577)	(0,13)
	07/2018	\$ 48.703	€ 41.744	35	0	35	0,01
	08/2018	53.194	45.954	576	0	576	0,13
RBC	07/2018	128	110	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	437	374	1	(1)	0	0,00
SCX	07/2018	€ 2	\$ 3	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 245	€ 208	1	(2)	(1)	0,00
				\$ 1.120	\$ (1.039)	\$ 81	0,02

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (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
AZD	07/2018	\$ 3	£ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	07/2018	\$ 306	\$ 229	0	(4)	(4)	0,00
BRC	07/2018	£ 232	\$ 304	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	\$ 304	£ 232	3	0	3	0,00
CBK	07/2018	\$ 305	\$ 231	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07/2018	£ 1	\$ 1	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	\$ 1	£ 1	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	£ 232	\$ 305	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 310	£ 233	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	\$ 305	\$ 232	1	0	1	0,00
				\$ 4	\$ (11)	\$ (7)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional NOK (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	07/2018	NOK 632.834	\$ 77.111	\$ 0	\$ (534)	\$ (534)	(0,12)
	07/2018	\$ 76.493	NOK 623.476	4	0	4	0,00
	08/2018	\$ 77.204	\$ 632.834	533	0	533	0,12
HUS	07/2018	\$ 195	\$ 1.600	1	0	1	0,00
JPM	07/2018	\$ 75.461	\$ 625.592	1.295	0	1.295	0,29
SCX	07/2018	NOK 632.216	\$ 77.534	0	(34)	(34)	(0,01)
	07/2018	\$ 78.066	NOK 642.539	770	(1)	769	0,18
	08/2018	\$ 77.629	\$ 632.216	33	0	33	0,01
				\$ 2.636	\$ (569)	\$ 2.067	0,47

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional NZD (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
AZD	07/2018	\$ 9.486	NZD 13.696	\$ 0	\$ (213)	\$ (213)	(0,05)
BOA	07/2018	NZD 13.763	\$ 9.309	0	(9)	(9)	0,00
	07/2018	\$ 9.540	NZD 13.636	0	(307)	(307)	(0,07)
	08/2018	\$ 9.310	\$ 13.763	9	0	9	0,00
SCX	07/2018	NZD 13.737	\$ 9.369	68	0	68	0,02
	07/2018	\$ 9.622	NZD 13.846	0	(248)	(248)	(0,06)
	08/2018	\$ 9.369	\$ 13.737	0	(69)	(69)	(0,02)
				\$ 77	\$ (846)	\$ (769)	(0,18)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 2.436	0,55

#### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKTWERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Fannie Mae, TBA			
4,000 % fällig am 01.07.2048	\$ 4.500	\$ (4.588)	(1,04)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (4.588)	(1,04)
Summe Anlagen		\$ 538.840	122,20
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (97.878)	(22,20)
Nettovermögen		\$ 440.962	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) Wertpapier per Emissionstermin.

(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.

Barmittel in Höhe von USD 3.504 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 1.310 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

### (g) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	2,220 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 8.600	Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.12.2045	\$ (8.900)	\$ 8.600	\$ 8.601	1,95
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	963	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	(987)	963	963	0,22
TDM	2,220	29.06.2018	02.07.2018	57.800	U.S. Treasury Bonds 3,750 % fällig am 15.11.2043	(59.016)	57.800	57.807	13,11
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (68.903)	\$ 67.363	\$ 67.371	15,28

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 539.261	\$ 194	\$ 539.455
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	155	3.818	0	3.973
Leerverkäufe	0	(4.588)	0	(4.588)
<b>Summen</b>	<b>\$ 155</b>	<b>\$ 538.491</b>	<b>\$ 194</b>	<b>\$ 538.840</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 328.836	\$ 0	\$ 328.836
Einlagen bei Kreditinstituten	0	601	0	601
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(356)	1.890	0	1.534
<b>Summen</b>	<b>\$ (356)</b>	<b>\$ 331.327</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 330.971</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (239)	\$ 0	\$ (239)
BOA	(440)	930	490
BPS	95	(260)	(165)
BRC	(100)	0	(100)
CBK	754	(900)	(146)
FBF	31	0	31
GLM	172	(280)	(108)
GST	(35)	0	(35)
HUS	(2)	0	(2)
JPM	1.909	(1.310)	599
MSB	176	80	256
MYC	(27)	0	(27)
NGF	(433)	300	(133)
RBC	12	0	12
RYL	1	0	1
SCX	562	(170)	392

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	69,86	66,94
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,64	45,71
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	27,84	2,29
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	(0,12)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,31	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,55	0,68
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,04)	0,00
Einlagezertifikate	0,00	0,21

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond ESG Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 06.08.2018	JPY 2.600.000	\$ 23.725	U.S. Treasury Notes 0,000 % fällig am 15.02.2028	\$ 7.700	\$ 7.603
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 14.05.2018	2.340.000	21.438	Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 31.10.2027	€ 3.000	3.674
Freddie Mac Gold Pool 4,000 % fällig am 01.06.2048	\$ 17.733	18.071	Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0,625 % fällig am 21.02.2023	1.900	2.334
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 04.06.2018	1.350.000	12.616	Province of Ontario 2,400 % fällig am 02.06.2026	CAD 2.500	1.977
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 21.05.2018	1.320.000	12.428	Bank Nederlandse Gemeenten NV 0,500 % fällig am 16.04.2025	1.400	1.728
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 03.09.2018	1.350.000	12.325	Province of Ontario 2,600 % fällig am 02.06.2025	1.700	1.373
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 20.08.2018	1.320.000	11.929	Nykredit Realkredit A/S 2,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 7.898	1.274
U.S. Treasury Notes 0,000 % fällig am 30.04.2025	\$ 8.500	8.412	Enel Finance International NV 1,000 % fällig am 16.09.2024	1.000	1.227
Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.09.2047	8.265	8.211	Enel Finance International NV 1,125 % fällig am 16.09.2026	1.000	1.199
U.S. Treasury Notes 0,000 % fällig am 15.02.2028	7.700	7.601	Province of Ontario 3,150 % fällig am 02.06.2022	CAD 1.300	1.091
Province of Ontario Canada 2,650 % fällig am 05.02.2025	CAD 8.000	6.465	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,450 % fällig am 01.03.2048	800	1.024
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (a)	6.131	5.968	Spain Government International Bond 1,500 % fällig am 30.04.2027	800	995
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 11.06.2018	JPY 550.000	5.187	Province of Ontario Canada 2,600 % fällig am 02.06.2027	1.200	958
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 10.09.2018	550.000	5.031	Ireland Government International Bond 1,000 % fällig am 15.05.2026	700	877
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 09.04.2018	390.000	3.677	Intesa Sanpaolo SpA 0,875 % fällig am 27.06.2022	700	867
Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.03.2047	\$ 3.659	3.635	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,950 % fällig am 14.02.2028	700	861
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 09.07.2018	390.000	3.630	SSE PLC 0,875 % fällig am 06.09.2025	700	847
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a)	3.436	3.359	TenneT Holding BV 1,875 % fällig am 13.06.2036	600	752
United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 22.07.2047	GBP 2.500	3.061	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,000 % fällig am 15.01.2023 (a)	\$ 760	743
International Bank for Reconstruction & Development 2,250 % fällig am 17.01.2023	CAD 3.700	2.953	Iberdrola International BV 1,125 % fällig am 21.04.2026	600	734
			Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,450 % fällig am 05.09.2040	600	730
			Slovenia Government International Bonds 1,000 % fällig am 06.03.2028	600	729
			Mizuho Financial Group, Inc. 2,632 % fällig am 12.04.2021	\$ 700	683
			Europäische Union 0,500 % fällig am 04.04.2025	500	614
			Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,375 % fällig am 23.04.2025	500	602
			innogy Finance BV 5,500 % fällig am 06.07.2022	GBP 350	566
			ING Groep NV 3,484 % fällig am 29.03.2022	\$ 500	510
			Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN 1.300	503

(a) Der Nennbetrag des Wertpapiers wurde 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global 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>ARGENTINIEN</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>DÄNEMARK</b>						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
HSBC Bank Argentina S.A. 25,250 % fällig am 27.09.2019	ARS	52.085	1.546	0,01	Canada Housing Trust 3,150 % fällig am 15.09.2023				JMP Credit Advisors CLO Ltd. 3,203 % fällig am 17.01.2028	\$	18.100	18.103	0,17	
					Royal Bank of Canada 2,300 % fällig am 22.03.2021	\$	22.400	21.974	0,21	KVK CLO Ltd. 3,498 % fällig am 15.01.2026		19.464	19.475	0,18
					Toronto-Dominion Bank 2,250 % fällig am 15.03.2021		200	196	0,00	Mountain Hawk CLO Ltd. 2,902 % fällig am 15.10.2026		2.800	2.797	0,03
					2,500 % fällig am 18.01.2022	41.300	40.451	0,38	3,555 % fällig am 18.04.2025		24.100	24.126	0,23	
									Oak Hill Credit Partners Ltd. 3,489 % fällig am 20.07.2026		4.500	4.507	0,04	
									OCF CLO Ltd. 3,148 % fällig am 15.07.2027		2.700	2.698	0,03	
									OHA Credit Partners Ltd. 3,369 % fällig am 20.10.2025		9.714	9.721	0,09	
									Seneca Park CLO Ltd. 3,473 % fällig am 17.07.2026		13.600	13.605	0,13	
									Symphony CLO LP 3,431 % fällig am 09.01.2023		954	955	0,01	
									Symphony CLO Ltd. 3,378 % fällig am 15.10.2025		18.792	18.802	0,18	
									Telos CLO Ltd. 3,623 % fällig am 17.01.2027		6.400	6.406	0,06	
									Venture CLO Ltd. 3,198 % fällig am 15.01.2028		15.300	15.319	0,14	
									3,228 % fällig am 15.04.2027		3.000	2.994	0,03	
									3,718 % fällig am 15.01.2027		9.800	9.801	0,09	
									WhiteHorse Ltd. 3,010 % fällig am 17.04.2027		5.600	5.590	0,05	
													318.446	3,00
									<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
									Ambac LSNi LLC 7,337 % fällig am 12.02.2023		703	714	0,01	
									KSA Sukuk Ltd. 2,894 % fällig am 20.04.2022		7.700	7.498	0,07	
									QNB Finance Ltd. 3,657 % fällig am 31.05.2021		35.200	35.530	0,34	
									3,705 % fällig am 12.02.2020		50.200	50.436	0,48	
									3,713 % fällig am 07.02.2020		47.800	48.158	0,45	
									Tencent Holdings Ltd. 3,595 % fällig am 19.01.2028		2.700	2.557	0,02	
									3,925 % fällig am 19.01.2038		1.100	1.005	0,01	
													145.898	1,38
													464.344	4,38
									Summe Cayman Inseln					
									<b>STAAITSEMISSIONEN</b>					
									Denmark Government International Bond 3,000 % fällig am 15.11.2021		3.100	543	0,01	
									4,500 % fällig am 15.11.2039		200	54	0,00	
													597	0,01
									Summe Dänemark					
													326.774	3,09

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>FINNLAND</b>				<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>SumitG Guaranteed Secured Obligation Issuer DAC</b>					
Finnvera Oyj				Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.				2,251 % fällig am 02.11.2020	\$	1.200	1.173	0,01	
0,625 % fällig am 22.09.2022	€	5.600	6.727	0,06	3,800 % fällig am 09.06.2023	\$	13.340	0,13					
<b>FRANKREICH</b>				<b>HONGKONG</b>				<b>AKTIEN</b>					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>					
Alice France S.A.				AIA Group Ltd.				PIMCO Fixed Income Source					
5,625 % fällig am 15.05.2024		6.000	7.280	0,07	3,900 % fällig am 06.04.2028	5.940	5.940	0,06	ETFs plc - PIMCO Euro				
7,375 % fällig am 01.05.2026	\$	8.500	8.342	0,08	Eastern Creation Investment Holdings Ltd.				Short Maturity Source				
Credit Agricole S.A.				2,750 % fällig am 26.09.2020	5.900	5.777	0,05	UCITS ETF (h)	3.455.880	406.300	3,84		
8,125 % fällig am 19.09.2033 (i)		29.245	29.551	0,28	Horse Gallop Finance Ltd.				PIMCO Fixed Income Source				
Dexia Credit Local S.A.				3,516 % fällig am 28.06.2021	5.700	5.704	0,05	ETFs plc - PIMCO US					
0,500 % fällig am 17.01.2025	€	15.100	17.680	0,16	Poly Real Estate Finance Ltd.				Dollar Short Maturity				
0,750 % fällig am 25.01.2023		24.800	29.781	0,28	3,950 % fällig am 05.02.2023	6.100	5.932	0,06	Source UCITS ETF (h)	893.540	90.658	0,85	
1,875 % fällig am 28.03.2019	\$	17.850	17.776	0,17	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.						496.958	4,69	
1,875 % fällig am 29.01.2020		250	246	0,00	3,880 % fällig am 25.05.2023	6.900	6.869	0,07					
1,875 % fällig am 15.09.2021		18.550	17.888	0,17	Summe Hongkong		30.222	0,29					
2,000 % fällig am 22.01.2021	€	21.200	26.159	0,24									
2,250 % fällig am 18.02.2020	\$	16.800	16.635	0,16	<b>INDIEN</b>								
2,375 % fällig am 20.09.2022		11.800	11.443	0,11	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								
Electricite de France S.A.				ICICI Bank Ltd.									
3,625 % fällig am 13.10.2025		600	588	0,01	3,441 % fällig am 04.12.2018	5.800	5.801	0,05					
6,000 % fällig am 22.01.2114		850	888	0,01	Indian Railway Finance Corp. Ltd.								
Teleperformance				3,835 % fällig am 13.12.2027	6.300	5.871	0,06						
1,875 % fällig am 02.07.2025 (b)	€	3.200	3.709	0,03	Summe Indien		11.672	0,11					
			187.966	1,77									
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>INDONESIEN</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>					
<b>France Government International Bond</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Bluestep Mortgage Securities DAC</b>					
2,000 % fällig am 25.05.2048 (j)	71.881	93.203	0,88	Indonesia Government International Bond				1,136 % fällig am 10.05.2063	SEK	96.980	10.935	0,10	
5,275 % fällig am 25.05.2045 (j)	19.200	31.487	0,30	5,375 % fällig am 17.10.2023	950	999	0,00	Summe Irland			618.701	5,84	
			124.690	1,18	5,875 % fällig am 13.03.2020	1.000	1.043	0,01					
			312.656	2,95	7,750 % fällig am 17.01.2038	500	644	0,01					
Summe Frankreich				Summe Indonesien		2.686	0,02						
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>IRLAND</b>				<b>ISRAEL</b>					
<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
Driver Multi-Compartment S.A.				Aurium CLO DAC				Israel Government International Bond					
0,030 % fällig am 21.02.2026	7.484	8.765	0,08	0,000 % fällig am 13.10.2029 (b)	€	1.500	1.752	0,02	3,250 % fällig am 17.01.2028	\$	9.500	9.193	0,08
Red & Black Auto Germany UG				Black Diamond CLO Designated Activity Co.				4,125 % fällig am 17.01.2048		7.600	7.204	0,07	
0,130 % fällig am 15.09.2025	15.799	18.525	0,18	0,650 % fällig am 03.10.2029	3.000	3.500	0,03	Summe Israel			16.397	0,15	
			27.290	0,26	3,358 % fällig am 03.10.2029	\$	3.900	3,908	0,04				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ITALIEN</b>					
Aareal Bank AG				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
1,875 % fällig am 15.09.2020	\$	26.200	25.531	0,24	0,780 % fällig am 16.04.2029	€	7.900	9.257	0,09	Banca Carige SpA			
Deutsche Bank AG				1,200 % fällig am 16.04.2029	800	935	0,01	3,875 % fällig am 24.10.2018	€	13.600	16.036	0,15	
3,150 % fällig am 22.01.2021	2.100	2.033	0,02	Castle Park CLO Designated Activity Co.				Intesa Sanpaolo SpA					
3,177 % fällig am 22.01.2021	9.500	9.328	0,09	0,671 % fällig am 15.01.2028	1.300	1.526	0,01	6,250 % fällig am 16.05.2024 (g)(i)	9.100	10.495	0,10		
4,250 % fällig am 14.10.2021	40.400	39.859	0,38	CVC Cordatus Loan Fund Ltd.				7,000 % fällig am 19.01.2021 (g)(i)	3.300	3.944	0,04		
Deutsche Pfandbriefbank AG				0,780 % fällig am 24.01.2028	8.400	9.821	0,09	7,750 % fällig am 11.01.2027 (g)(i)	17.525	22.120	0,21		
2,250 % fällig am 04.05.2020	39.400	38.826	0,37	Elm Park CLO DAC				UniCredit SpA					
IHO Verwaltungs GmbH (2,750 % bar oder 3,500 % PIK)				0,620 % fällig am 16.04.2029	10.650	12.419	0,12	6,625 % fällig am 03.06.2023 (g)(i)	400	464	0,00		
2,750 % fällig am 15.09.2021 (c)	€	21.400	25.271	0,24	Holland Park CLO Ltd.						53.059	0,50	
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				0,604 % fällig am 14.05.2027	18.200	21.273	0,20	<b>NON-AGENCY-MBS</b>					
3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)	11.800	14.052	0,13	Phoenix Park CLO DAC				Berica ABS SRL					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				0,772 % fällig am 29.07.2027	4.700	5.492	0,05	0,000 % fällig am 31.12.2055	539	628	0,01		
5,000 % fällig am 19.03.2024	AUD	1.500	1.237	0,01	Sorrento Park CLO DAC			Claris Abs SRL					
Landwirtschaftliche Rentenbank				0,624 % fällig am 16.11.2027	15.400	17.981	0,17	0,081 % fällig am 31.10.2060	7.543	8.780	0,08		
4,750 % fällig am 12.03.2019	NZD	26.800	18.470	0,17	1,200 % fällig am 16.11.2027	800	939	0,01	Mars SRL				
Volkswagen Bank GmbH								0,972 % fällig am 25.10.2050	261	307	0,00		
0,379 % fällig am 08.12.2021	€	6.900	8.070	0,08	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Taurus IT SRL				
			182.677	1,73	AerCap Ireland Capital DAC			1,174 % fällig am 18.02.2027	191	223	0,00		
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
<b>Techem GmbH</b>				<b>AerCap Ireland Capital DAC</b>				<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>					
3,000 % fällig am 02.10.2024	2.160	2.521	0,02	4,250 % fällig am 01.07.2020	\$	1.600	1.618	0,01	1,450 % fällig am 15.11.2024	110.400	123.438	1,17	
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Bank of Ireland</b>				<b>2,350 % fällig am 15.09.2024 (f)</b>					
State of Berlin Germany				7,375 % fällig am 18.06.2020 (g)(i)	€	1.500	1.883	0,02	2,700 % fällig am 01.03.2047	1.200	1.254	0,01	
4,250 % fällig am 25.04.2022	119	162	0,00	German Postal Pensions Securitisation PLC				2,800 % fällig am 01.03.2067	23.900	24.227	0,23		
Summe Deutschland			212.650	2,01	4,375 % fällig am 18.01.2022	200	269	0,00	3,250 % fällig am 01.09.2046	1.500	1.731	0,02	
				Shire Acquisitions Investments Ireland DAC				3,450 % fällig am 01.03.2048	38.100	44.754	0,42		
				1,900 % fällig am 23.09.2019	\$	3.900	3.840	0,04	Italy Government International Bond				
				2,400 % fällig am 23.09.2021	5.600	5.365	0,05	6,000 % fällig am 04.08.2028	£	8.584	13.538	0,13	
				SMBC Aviation Capital Finance DAC							212.604	2,01	
				3,000 % fällig am 15.07.2022	900	869	0,01	Summe Italien			275.601	2,60	

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global 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
<b>JAPAN</b>				<b>SILBER ARROW S.A.</b>				<b>MYLAN NV</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,080 % fällig am 17.03.2025				3,750 % fällig am 15.12.2020			
Central Nippon Expressway Co. Ltd.				€	12.095	\$ 14.174	0,14	\$	300	\$ 302	0,00
2,091 % fällig am 14.09.2021	\$ 14.700	\$ 14.093	0,13			49.245	0,47		€ 3.164	4.389	0,04
2,362 % fällig am 28.05.2021	700	679	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STICHTING AK Rabobank Certificaten</b>			
2,567 % fällig am 02.11.2021	70.700	68.681	0,65	<b>Allergan Funding SCS</b>				6,500 % (g)			
2,903 % fällig am 04.08.2020	200	201	0,00	3,000 % fällig am 12.03.2020				\$ 700			
				1,500 % fällig am 15.07.2024				€ 4.900			
				2,000 % fällig am 02.11.2026				€ 3.700			
<b>Chugoku Electric Power Co., Inc.</b>				<b>Arroundtown S.A.</b>				<b>Volkswagen International Finance NV</b>			
2,701 % fällig am 16.03.2020	500	497	0,01	1,500 % fällig am 16.02.2021				1,125 % fällig am 02.10.2023			
<b>Meiji Yasuda Life Insurance Co.</b>				<b>Emerald Bay S.A.</b>							
5,100 % fällig am 26.04.2048	3.900	3.944	0,04	0,000 % fällig am 08.10.2020 (d)							
<b>Mitsubishi Corp.</b>				7,850				8,581			
2,625 % fällig am 14.07.2022	400	388	0,00	<b>Europäische Finanzstabilisierungsfazilität</b>							
<b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b>				1,250 % fällig am 24.05.2033							
3,455 % fällig am 02.03.2023	24.400	24.206	0,23	1,375 % fällig am 31.05.2047							
<b>Mitsubishi UFJ Trust &amp; Banking Corp.</b>				<b>NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank</b>							
2,450 % fällig am 16.10.2019	1.100	1.091	0,01	2,875 % fällig am 16.02.2021							
<b>Mizuho Financial Group, Inc.</b>				<b>Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.</b>							
3,549 % fällig am 05.03.2023	20.400	20.257	0,19	€ 8.800				10.411			
<b>NTT Finance Corp.</b>				88.274				0,83			
1,900 % fällig am 21.07.2021	400	384	0,00	137.519				1,30			
<b>ORIX Corp.</b>				<b>MEXIKO</b>							
3,250 % fällig am 04.12.2024	4.300	4.112	0,04	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>				<b>Petroleos Mexicanos</b>							
2,450 % fällig am 16.01.2020	500	494	0,00	3,750 % fällig am 16.04.2026				8,900			
2,703 % fällig am 17.01.2020	15.500	15.503	0,15					10.235			
		154.530	1,46	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
				<b>Mexico Government International Bond</b>							
				3,600 % fällig am 30.01.2025				\$ 2.440			
				4,000 % fällig am 15.03.2115				€ 100			
				4,150 % fällig am 28.03.2027				\$ 200			
				10,000 % fällig am 05.12.2024				MXN 99.573			
								8.360			
								18.595			
				<b>MAROKKO</b>							
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
				<b>Morocco Government International Bond</b>							
				4,500 % fällig am 05.10.2020				€ 9.100			
								11.587			
				<b>MULTINATIONAL</b>							
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
				<b>Preferred Term Securities Ltd.</b>							
				2,651 % fällig am 22.12.2036				\$ 14.389			
				2,741 % fällig am 22.03.2038				5.246			
				2,841 % fällig am 23.03.2035				7.083			
								6.729			
								25.330			
				<b>NIEDERLANDE</b>							
				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>							
				<b>Barings Euro CLO BV</b>							
				0,000 % fällig am 27.07.2030 (b)				€ 1.500			
				1,050 % fällig am 27.07.2030 (b)				500			
				<b>Dryden Euro CLO BV</b>							
				0,659 % fällig am 23.08.2026				7.900			
				1,250 % fällig am 23.08.2026				550			
								12.208			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
				<b>Bank Nederlandse Gemeenten NV</b>							
				4,375 % fällig am 16.02.2021				\$ 5.900			
				<b>Coöperatieve Rabobank UA</b>							
				5,500 % fällig am 29.06.2020				€ 600			
				(g)(i)				750			
				6,625 % fällig am 29.06.2021 (g)(i)				2.000			
				6,875 % fällig am 19.03.2020 (i)				15.400			
				<b>Deutsche Telekom International Finance BV</b>							
				1,950 % fällig am 19.09.2021				\$ 400			
				<b>ING Bank NV</b>							
				2,625 % fällig am 05.12.2022				28.900			
				<b>ING Groep NV</b>							
				4,700 % fällig am 22.03.2028				13.700			
								13.589			
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
				<b>Qatar Government International Bond</b>							
				3,875 % fällig am 23.04.2023				6.950			
								6.958			
								0,07			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
4,500 % fällig am 23.04.2028	\$ 23.800	\$ 24.064	0,23	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>			
		31.022	0,30	<b>Autonomous Community of Catalonia</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Summe Katar		40.860	0,39	4,220 % fällig am 26.04.2035	€ 3.900	\$ 4.835	0,05	First Abu Dhabi Bank PJSC			
				4,900 % fällig am 15.09.2021	28.500	36.170	0,34	2,250 % fällig am 11.02.2020	\$ 10.600	\$ 10.416	0,10
				4,950 % fällig am 11.02.2020	19.200	23.726	0,22				
				<b>Autonomous Community of Madrid</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				0,747 % fällig am 30.04.2022	15.700	18.692	0,18	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond			
				Instituto de Crédito Oficial				2,500 % fällig am 11.10.2022	21.300	20.434	0,19
				5,000 % fällig am 31.03.2020	CAD 2.000	1.570	0,01	3,125 % fällig am 11.10.2027	20.300	18.936	0,18
				<b>Spain Government International Bond</b>							
				1,600 % fällig am 30.04.2025	€ 1.835	2.262	0,02				
				2,900 % fällig am 31.10.2046	26.400	33.659	0,32	Summe Vereinigte Arabische Emirate			
				5,250 % fällig am 06.04.2029	£ 800	1.240	0,01				
				Summe Spanien		122.154	1,15				
						205.260	1,94	<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
				<b>ÜBERNATIONAL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				<b>Asian Development Bank</b>				Barclays Bank PLC			
				0,500 % fällig am 24.03.2020	AUD 1.000	712	0,01	7,625 % fällig am 21.11.2022 (i)	55.279	59.611	0,56
				<b>EUROFIMA</b>				Barclays PLC			
				5,500 % fällig am 30.06.2020	1.440	1.128	0,01	3,200 % fällig am 10.08.2021	2.600	2.550	0,02
				<b>Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung</b>				3,650 % fällig am 16.03.2025	4.100	3.849	0,04
				0,500 % fällig am 01.09.2023	5.400	3.509	0,03	4,463 % fällig am 10.08.2021	8.300	8.618	0,08
				0,500 % fällig am 21.12.2023	4.800	3.092	0,03	6,500 % fällig am 15.09.2019 (g)(i)	€ 5.100	6.143	0,06
				<b>Europäische Investitionsbank</b>				7,000 % fällig am 15.09.2019 (g)(i)	£ 1.300	1.757	0,02
				0,500 % fällig am 10.08.2023	10.200	6.649	0,06	7,875 % fällig am 15.09.2022 (g)(i)	£ 1.200	1.684	0,02
				6,000 % fällig am 07.12.2028	£ 53	99	0,00	8,000 % fällig am 15.12.2020 (g)(i)	€ 1.900	2.462	0,02
				Summe übernational		15.189	0,14	8,250 % fällig am 15.12.2018 (g)(i)	\$ 19.196	19.538	0,19
				<b>SCHWEDEN</b>				<b>British Telecommunications PLC</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				9,625 % fällig am 15.12.2030	648	928	0,01
				<b>Danske Hypotek AB</b>				<b>Co-operative Group Holdings Ltd.</b>	£ 8.220	11.787	0,11
				1,000 % fällig am 21.12.2022	SEK 100.000	11.420	0,11	<b>FCE Bank PLC</b>			
				<b>Landshypotek Bank AB</b>				1,875 % fällig am 24.06.2021	€ 500	607	0,01
				0,700 % fällig am 09.05.2022	465.000	52.558	0,50	<b>Frontier Finance PLC</b>			
				<b>Lansforsakringar Hypotek AB</b>				8,000 % fällig am 23.03.2022	£ 14.700	19.403	0,18
				1,250 % fällig am 20.09.2023	208.200	23.927	0,22	<b>Grainger PLC</b>			
				2,250 % fällig am 21.09.2022	62.500	7.504	0,07	3,375 % fällig am 24.04.2028	1.400	1.853	0,02
				<b>Nordea Hypotek AB</b>				<b>HSBC Holdings PLC</b>			
				1,000 % fällig am 08.04.2022	563.300	64.632	0,61	2,926 % fällig am 18.05.2021	\$ 12.600	12.622	0,12
				1,250 % fällig am 20.09.2023	100.000	11.506	0,11	3,326 % fällig am 18.05.2024	6.600	6.585	0,06
				<b>Skandinaviska Enskilda Banken AB</b>				3,950 % fällig am 18.05.2024	2.900	2.892	0,03
				1,500 % fällig am 15.12.2021	538.000	62.850	0,59	6,250 % fällig am 23.03.2023 (g)(i)	4.800	4.716	0,04
				<b>Stadshypotek AB</b>				6,500 % fällig am 23.03.2028 (g)(i)	7.100	6.825	0,06
				1,500 % fällig am 15.12.2021	227.000	26.514	0,25	<b>Imperial Brands Finance PLC</b>			
				2,500 % fällig am 18.09.2019	127.000	14.702	0,14	3,750 % fällig am 21.07.2022	700	695	0,01
				2,500 % fällig am 05.04.2022	\$ 29.550	28.858	0,27	<b>Lloyds Bank PLC</b>			
				4,500 % fällig am 21.09.2022	SEK 361.000	47.245	0,45	2,700 % fällig am 17.08.2020	400	395	0,00
				<b>Sveriges Sakerstald Obligationer AB</b>				4,875 % fällig am 30.03.2027	£ 17.900	29.260	0,28
				1,250 % fällig am 15.06.2022	360.000	41.649	0,39	5,800 % fällig am 13.01.2020	\$ 3.070	3.187	0,03
				2,000 % fällig am 17.06.2026	53.000	6.254	0,06	6,000 % fällig am 08.02.2029	£ 150	272	0,00
				<b>Swedbank Hypotek AB</b>				<b>Lloyds Banking Group PLC</b>			
				1,000 % fällig am 15.09.2021	591.300	67.994	0,64	6,375 % fällig am 27.06.2020 (g)(i)	€ 1.500	1.867	0,02
				1,000 % fällig am 15.06.2022	463.000	53.067	0,50	7,000 % fällig am 27.06.2019 (g)(i)	£ 16.300	21.973	0,21
				1,000 % fällig am 15.03.2023	100.000	11.410	0,11	7,625 % fällig am 27.06.2023 (g)(i)	300	434	0,00
				Summe Schweden		532.090	5,02	7,875 % fällig am 27.06.2029 (g)(i)	4.680	7.191	0,07
				<b>SCHWEIZ</b>				<b>Nationwide Building Society</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,875 % fällig am 20.06.2019 (g)(i)	1.000	1.351	0,01
				<b>Credit Suisse AG</b>				10,250 % (g)	33	6.684	0,06
				6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)	\$ 15.906	16.955	0,16	<b>Network Rail Infrastructure Finance PLC</b>			
				3,869 % fällig am 12.01.2029	2.600	2.450	0,02	4,750 % fällig am 29.11.2035	62	117	0,00
				<b>UBS AG</b>				<b>RAC Bond Co. PLC</b>			
				2,200 % fällig am 08.06.2020	19.100	18.726	0,18	4,565 % fällig am 06.05.2046	5.190	7.151	0,07
				2,450 % fällig am 01.12.2020	10.600	10.375	0,10	<b>Reckitt Benckiser Treasury Services PLC</b>			
				2,780 % fällig am 01.12.2020	14.000	14.008	0,13	2,375 % fällig am 24.06.2022	\$ 11.200	10.714	0,10
				2,901 % fällig am 08.06.2020	32.100	32.205	0,30	2,895 % fällig am 24.06.2022	400	399	0,00
				5,125 % fällig am 15.05.2024 (i)	3.350	3.347	0,03	<b>Royal Bank of Scotland Group PLC</b>			
				7,625 % fällig am 17.08.2022 (i)	1.625	1.798	0,02	2,000 % fällig am 08.03.2023	€ 6.400	7.698	0,07
				<b>UBS Group Funding Switzerland AG</b>				3,498 % fällig am 15.05.2023	\$ 8.700	8.435	0,08
				2,950 % fällig am 24.09.2020	8.000	7.918	0,08	3,813 % fällig am 15.05.2023	9.700	9.753	0,09
				Summe Schweiz		107.782	1,02	4,519 % fällig am 25.06.2024	200	200	0,00
								7,500 % fällig am 10.08.2020 (g)(i)	2.700	2.759	0,03
								8,625 % fällig am 15.08.2021 (g)(i)	2.300	2.450	0,02
								<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>			
								7,375 % fällig am 24.06.2022 (g)(i)	£ 2.100	2.892	0,03
								<b>Santander UK PLC</b>			
								3,816 % fällig am 14.03.2019	\$ 11.900	11.999	0,11
								<b>Sky PLC</b>			
								6,000 % fällig am 21.05.2027	£ 2.700	4.512	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
Rockwell Collins, Inc.				Nutrien Ltd.				(0,139)% fällig am 20.08.2018 (d)(e)	¥ 23.470.000	\$	2,00
2,350 % fällig am 17.07.2018	\$	2.400	2,397	0,02	6.750	4.081	0,04	(0,136)% fällig am 09.07.2018 (d)(e)	10.436.000		0,89
Schlumberger Holdings						8.370	0,08	(0,130)% fällig am 10.09.2018 (d)(e)	15.860.000		1,35
2,650 % fällig am 03.07.2018	1.400	1.400	0,01					(0,126)% fällig am 18.09.2018 (d)(e)	20.410.000		1,74
Southern Co.								(0,125)% fällig am 06.08.2018 (d)(e)	28.310.000		2,42
2,420 % fällig am 09.07.2018	1.900	1.899	0,02								
Spectra Energy Partners				<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>							
2,750 % fällig am 09.07.2018	3.800	3.798	0,04	(14,311)% fällig am 14.09.2018 (d)(e) ARS	780	28	0,00				1,18
Thomson Reuters Corp.				(12,971)% fällig am 14.09.2018 (d)(e)	1.002	37	0,00				
2,400 % fällig am 10.07.2018	1.600	1.599	0,01	(3,247)% fällig am 12.10.2018 (d)(e)	1.560	55	0,00				
UDR, Inc.				2,121 % fällig am 14.12.2018 (d)(e)	\$	29.900	29,381	0,28			
2,400 % fällig am 13.07.2018	2.300	2.298	0,02	2,830 % fällig am 13.07.2018 (d)(e)	13.200	13.184	0,12				
Virginia Electric & Power Co.				25,450 % fällig am 14.09.2018 (d)(e) ARS	11.400	365	0,00				
2,580 % fällig am 23.07.2018	3.900	3.894	0,04	25,601 % fällig am 14.09.2018 (d)(e)	199.300	6.385	0,06				
VW CR, Inc.				25,800 % fällig am 19.09.2018 (d)(e)	52.269	1.662	0,02				
2,550 % fällig am 15.08.2018	13.500	13.458	0,13			51.097	0,48				
		134.218	1,27	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>							
				(0,148)% fällig am 03.09.2018 (d)(e) ¥	31.330.000	282.914	2,67				
				(0,139)% fällig am 02.07.2018 (d)(e)	1.290.000	11.646	0,11				
<b>PENSIONSGESCHÄFTE (k)</b>											
		9.798	0,09								
<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>											
Letras del Banco Central de la Republica Argentina											
25,600 % fällig am 18.07.2018	ARS	52.664	1,790	0,02							
25,800 % fällig am 18.07.2018		2.664	90	0,00							
37,800 % fällig am 21.11.2018		1.110	33	0,00							
38,000 % fällig am 17.10.2018		22.850	708	0,01							
40,700 % fällig am 18.07.2018		49.080	1.668	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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2019	7.067	\$ (1.559)	(0,02)
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2020	7.067	148	0,00
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2019	19.534	(5.486)	(0,05)
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03/2020	19.534	2.555	0,02
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2018	1.086	(1.078)	(0,01)
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09/2019	1.086	1.645	0,02
Australia Government 3-Year Note September Futures	Long	09/2018	331	109	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	375	533	0,01
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 133,000 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	1.491	16	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 152,000 EUR auf Euro-BTP 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	1.236	(1)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 160,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	730	(1.927)	(0,02)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 160,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	201	(425)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09/2018	11.134	5.325	0,05
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	1.320	(4.124)	(0,04)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	259	207	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	236	1.195	0,01
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	5.780	(12.512)	(0,12)
Euro-Schatz September Futures	Long	09/2018	1.112	119	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	280	574	0,01
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 124,000 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Long	08/2018	345	0	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 131,250 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Short	08/2018	1.491	38	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 156,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	201	87	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	3.982	(818)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	6.821	6.067	0,06
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09/2018	3.084	(1.281)	(0,01)
United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate December Futures	Long	12/2018	10.387	453	0,00
United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate December Futures	Short	12/2019	10.387	250	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	1.407	(2.146)	(0,02)
				\$ (12.036)	(0,12)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

### OPTIONSKAUF

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	\$ 105,750	24.08.2018	1.236	\$ 11	\$ 1	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	106,250	24.08.2018	1.576	14	2	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	106,750	24.08.2018	236	2	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	107,000	24.08.2018	35	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	108,000	24.08.2018	534	5	4	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note October 2018 Futures	107,500	21.09.2018	752	7	1	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	106,000	24.08.2018	2.001	17	2	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	106,500	24.08.2018	2.957	24	3	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	107,500	24.08.2018	40	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	108,000	24.08.2018	6	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	108,500	24.08.2018	375	3	1	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	109,000	24.08.2018	1.184	10	1	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	171,000	24.08.2018	248	2	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	174,000	24.08.2018	143	1	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	175,000	24.08.2018	833	7	1	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2018 Futures	115,000	24.08.2018	500	4	1	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2018 Futures	117,000	24.08.2018	42	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2018 Futures	120,000	24.08.2018	1.102	9	1	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2018 Futures	125,000	24.08.2018	81	1	0	0,00
				\$ 117	\$ 18	0,00

### VERKAUFSoPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 119,000	27.07.2018	661	\$ (199)	\$ (62)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	120,500	27.07.2018	661	(150)	(217)	0,00
				\$ (349)	\$ (279)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (12.297)	(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 – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Altria Group, Inc.	(1,000) %	20.12.2020	\$ 21.200	\$ 120	0,00
BASF SE	(1,000)	20.12.2020	€ 5.700	43	0,00
Bayer AG	(1,000)	20.12.2020	3.800	27	0,00
Fortum Oyj	(1,000)	20.12.2020	800	4	0,00
Koninklijke DSM NV	(1,000)	20.12.2020	12.100	79	0,00
Pfizer, Inc.	(1,000)	20.12.2020	\$ 17.000	103	0,00
Reynolds American, Inc.	(1,000)	20.12.2020	16.900	127	0,01
Telia Co. AB	(1,000)	20.12.2020	€ 5.200	30	0,00
United Utilities PLC	(1,000)	20.12.2020	2.200	15	0,00
UnitedHealth Group, Inc.	(1,000)	20.12.2020	\$ 8.800	52	0,00
				\$ 600	0,01

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Daimler AG	1,000 %	20.12.2020	€ 3.800	\$ (3)	0,00
Ryder System, Inc.	1,000	20.06.2022	\$ 1.800	(16)	0,00
Shell International Finance BV	1,000	20.12.2026	€ 8.900	(43)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2022	26.350	196	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2025	2.900	(29)	0,00
				\$ 105	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2022	€ 291.000	\$ 3.516	0,03

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettöver- mögens
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 18.460	\$ (390)	0,00
CDX.IG-30 5-Year Index	1,000	20.06.2023	10.000	(12)	0,00
				\$ (402)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettöver- mögens
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,673 %	30.04.2025	\$ 21.400	\$ (241)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,683	30.04.2025	69.700	(872)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,684	30.04.2025	32.200	(385)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,696	30.04.2025	22.100	(286)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,710	30.04.2025	26.100	(361)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,714	30.04.2025	35.400	(494)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,880	04.01.2021	BRL 453.000	(668)	(0,01)
Erhalt	3-Month CAD Bank Bill	1,850	15.09.2027	CAD 57.400	(159)	0,00
Erhalt	3-Month CAD Bank Bill	2,200	16.06.2026	46.600	752	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD Bank Bill	2,300	16.07.2020	643.000	1.145	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month NZD-BBR	2,500	14.02.2020	NZD 1.521.600	1.838	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,000	02.03.2020	\$ 852.500	(30)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,000	26.04.2022	538.800	(95)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,000	27.04.2023	339.800	(62)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,750	01.04.2019	4.839.600	(14.839)	(0,14)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	20.06.2020	748.300	419	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,000	01.04.2020	4.839.600	19.441	0,18
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	34.700	(252)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	66.200	(651)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	410.000	(1.408)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,326	12.06.2022	168.300	138	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,326	19.06.2022	405.400	423	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	73.000	(941)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.09.2019	151.300	(46)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	252.400	18.093	0,17
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,955	12.11.2049	60.300	3.558	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	20.09.2020	151.300	61	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	20.06.2023	ZAR 2.838.300	(5.277)	(0,05)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	15.03.2027	134.000	223	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	19.09.2020	€ 189.100	584	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	625.500	9.182	0,09
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.12.2023	242.300	2.448	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	467.469	9.995	0,09
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.12.2028	451.700	6.394	0,06
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.09.2048	144.250	(3.911)	(0,04)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	19.09.2019	£ 931.100	911	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	18.09.2020	931.100	(843)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.12.2019	775.600	1.730	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.09.2020	210.700	961	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	18.12.2020	775.600	(1.887)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	76.200	(724)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	18.200	(11)	0,00
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,500	21.03.2068	4.250	165	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	31.200	318	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,100	20.03.2024	¥30.050.000	643	0,01
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	7.460.000	(93)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	9.700.000	(909)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,380	18.06.2028	2.420.000	(243)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,399	18.06.2028	2.420.000	(243)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	51.038.000	(1.168)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,500	17.09.2021	16.320.000	133	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	1,000	21.03.2048	800.000	(117)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	1,500	19.06.2033	3.000	0	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,500	21.12.2045	3.600.000	(643)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,825	12.01.2023	MXN 306.900	111	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,740	22.02.2027	163.500	(259)	0,00
					\$ 41.548	0,39
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 45.367</b>	<b>0,43</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds 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.

### FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

#### OPTIONSKAUF

#### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus JPY	¥ 120,000	17.04.2020	\$ 58.185	\$ 1.071	\$ 346	0,00
CBK	Put - OTC EUR versus USD	\$ 1,140	24.05.2019	€ 2.500	33	36	0,00
	Call - OTC EUR versus USD	1,291	24.06.2021	400	25	25	0,00
	Put - OTC EUR versus USD	1,291	24.06.2021	373	27	26	0,00
	Call - OTC USD versus CAD	CAD 1,370	17.03.2018	\$ 56.128	106	75	0,00
GLM	Call - OTC USD versus JPY	¥ 120,000	20.04.2020	39.962	742	239	0,00
HUS	Put - OTC AUD versus USD	\$ 0,735	05.02.2019	AUD 113.100	1.122	2.100	0,02
	Put - OTC EUR versus USD	1,140	24.05.2019	€ 48.000	624	697	0,01
MSB	Call - OTC EUR versus USD	1,291	24.06.2021	8.572	522	524	0,01
	Put - OTC EUR versus USD	1,291	24.06.2021	8.572	620	606	0,01
SCX	Put - OTC USD versus INR	INR 69,220	25.10.2018	\$ 30.018	417	372	0,00
					\$ 5.309	\$ 5.046	0,05

#### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.07.2018	\$ 27.000	\$ (35)	\$ (9)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	48.500	(46)	(16)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	22.900	(28)	(25)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	12.600	(22)	(2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Kauf	0,475	19.09.2018	€ 245.100	(124)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,750	19.09.2018	245.100	(488)	(1.143)	(0,01)
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	\$ 18.200	(19)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	21.600	(31)	(24)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	14.300	(24)	(2)	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	20.000	(18)	(8)	0,00
						\$ (835)	\$ (1.239)	(0,01)

#### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC USD versus KRW	KRW 1.200,000	25.10.2018	\$ 30.018	\$ (119)	\$ (130)	0,00
CBK	Call - OTC EUR versus USD	\$ 1,270	24.05.2019	€ 2.500	(35)	(26)	0,00
	Put - OTC GBP versus USD	1,315	14.06.2019	£ 32.453	(1.030)	(994)	(0,01)
	Call - OTC GBP versus USD	1,440	14.06.2019	33.407	(483)	(375)	0,00
	Put - OTC USD versus CAD	CAD 1,305	17.08.2018	\$ 37.423	(288)	(286)	0,00
HUS	Call - OTC AUD versus USD	\$ 0,825	04.12.2018	AUD 113.100	(1.481)	(78)	0,00
	Call - OTC EUR versus USD	1,270	24.05.2019	€ 48.000	(663)	(511)	(0,01)
					\$ (4.099)	\$ (2.400)	(0,02)

#### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Floor - OTC CPURNSA	\$ 217,965	Maximal [(1 + 0,000 %) <sup>10</sup> - (Index Final/Index Initial)] oder 0	29.09.2020	\$ 10.700	\$ (138)	\$ 0	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(4)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Agrium, Inc.	(1,250) %	20.03.2019	\$ 4.000	\$ 0	\$ (35)	\$ (35)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	5.400	(187)	16	(171)	0,00
BPS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	31.100	(1.113)	131	(982)	(0,01)
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	22.300	(544)	22	(522)	0,00
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	37.000	(706)	173	(533)	(0,01)
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	14.100	(487)	42	(445)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	13.200	(310)	1	(309)	0,00
CBK	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	21.200	(751)	82	(669)	(0,01)
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	10.700	(207)	53	(154)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	28.800	(1.019)	110	(909)	(0,01)
HUS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	31.800	(1.077)	73	(1.004)	(0,01)
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	34.100	(851)	52	(799)	(0,01)
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	11.200	(268)	6	(262)	0,00
					\$ (7.520)	\$ 726	\$ (6.794)	(0,06)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	iTraxx Europe Subordinated 27 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2022	€ 19.000	\$ 995	\$ (651)	\$ 344	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds 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
BPS	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,362 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	26.09.2027	AUD 52.600	\$ 41.696	\$ 271	\$ (3.133)	\$ (2.862)	(0,03)
	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,368 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	05.10.2027	31.700	24.970	(46)	(1.515)	(1.561)	(0,01)
DUB	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month GBP-LIBOR abzgl. 0,055 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	13.10.2026	GBP 9.800	11.956	(7)	843	836	0,01
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,368 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	06.10.2027	AUD 11.463	8.965	16	(516)	(500)	(0,01)
RYL	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month GBP-LIBOR abzgl. 0,055 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	13.10.2026	GBP 27.400	33.433	753	1.577	2.330	0,02
						\$ 987	\$ (2.744)	\$ (1.757)	(0,02)

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(2,040) %	10.07.2027	KRW 18.702.800	\$ 0	\$ 216	\$ 216	0,00
CBK	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(2,000)	10.07.2027	62.500.000	0	922	922	0,01
DUB	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(2,013)	10.07.2027	52.260.700	0	719	719	0,01
GLM	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(2,010)	10.07.2027	29.961.900	0	418	418	0,00
JPM	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(1,993)	10.07.2027	5.892.900	0	90	90	0,00
SOG	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(2,015)	10.07.2027	52.326.400	0	710	710	0,01
						\$ 0	\$ 3.075	\$ 3.075	0,03

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07/2018	AUD 6.709	\$ 5.090	\$ 134	\$ 0	\$ 134	0,00
	09/2018	\$ 396	THB 12.602	0	(15)	(15)	0,00
BOA	07/2018	ARS 259.560	\$ 9.337	341	0	341	0,00
	07/2018	BRL 98.927	26.164	452	0	452	0,00
	07/2018	DKK 942.632	157.211	9.498	0	9.498	0,09
	07/2018	£ 53.523	71.465	802	0	802	0,01
	07/2018	¥ 1.290.000	12.253	608	0	608	0,01
	07/2018	NOK 647.460	79.435	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	TRY 351.661	75.424	0	(758)	(758)	(0,01)
	07/2018	\$ 24.019	ARS 644.094	0	(1.816)	(1.816)	(0,02)
	07/2018	134.639	AUD 182.389	119	0	119	0,00
	07/2018	1.558	CAD 1.998	0	(39)	(39)	0,00
	07/2018	102.776	€ 87.529	0	(581)	(581)	(0,01)
	07/2018	28.934	INR 1.977.639	0	(131)	(131)	0,00
	08/2018	ARS 106.550	\$ 4.945	1.407	0	1.407	0,01
	08/2018	AUD 182.389	134.652	0	(120)	(120)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	08/2018	CZK 570.567	\$ 26.077	\$ 420	\$ 0	\$ 420	0,00
	08/2018	¥ 5.070.000	46.519	643	0	643	0,01
	08/2018	\$ 39.260	BRL 149.403	0	(565)	(565)	(0,01)
	08/2018	575	ILS 2.046	0	(15)	(15)	0,00
	08/2018	725	ZAR 9.109	0	(64)	(64)	0,00
	08/2018	ZAR 41.192	\$ 3.119	127	0	127	0,00
	09/2018	ARS 52.269	2.374	688	0	688	0,01
	09/2018	SGD 183.949	138.526	3.392	0	3.392	0,03
	09/2018	\$ 123.442	CNH 791.879	0	(4.292)	(4.292)	(0,04)
	09/2018	22.834	RUB 1.429.853	0	(200)	(200)	0,00
	10/2018	DKK 1.102.725	\$ 172.314	0	(1.720)	(1.720)	(0,02)
BPS	07/2018	ARS 503.076	18.566	1.225	0	1.225	0,01
	07/2018	¥ 24.308.000	223.810	4.355	0	4.355	0,04
	07/2018	\$ 10.793	ARS 298.850	0	(533)	(533)	(0,01)
	07/2018	11.244	£ 8.450	0	(87)	(87)	0,00
	08/2018	ARS 57.660	\$ 2.678	764	0	764	0,01
	08/2018	RON 67.441	17.069	221	0	221	0,00
	08/2018	\$ 4.039	AUD 5.173	0	(217)	(217)	0,00
	09/2018	INR 24.861	\$ 363	4	0	4	0,00
	09/2018	TWD 773.033	26.309	820	0	820	0,01
	09/2018	\$ 523	IDR 7.355.142	0	(15)	(15)	0,00
	10/2018	KRW 3.322.050	\$ 2.988	0	(8)	(8)	0,00
BRC	07/2018	ARS 254.922	9.451	734	0	734	0,01
	07/2018	\$ 790.302	£ 604.365	7.611	0	7.611	0,07
	08/2018	£ 604.365	\$ 791.403	0	(7.591)	(7.591)	(0,07)
	08/2018	RON 21.171	£ 4.495	0	(22)	(22)	0,00
CBK	09/2018	\$ 4.595	INR 317.564	0	(7)	(7)	0,00
	07/2018	ARS 12.963	\$ 452	12	0	12	0,00
	07/2018	BRL 18.529	4.862	49	(3)	46	0,00
	07/2018	CAD 381.735	293.223	3.029	0	3.029	0,03
	07/2018	DKK 620.414	103.870	6.649	0	6.649	0,06
	07/2018	€ 14.062	16.585	167	0	167	0,00
	07/2018	£ 67.283	90.404	1.570	0	1.570	0,01
	07/2018	SEK 27.045	3.061	38	0	38	0,00
	07/2018	TRY 93.603	20.916	638	0	638	0,01
	07/2018	\$ 492	ARS 12.844	0	(54)	(54)	0,00
	07/2018	2.457	BRL 9.264	0	(49)	(49)	0,00
	07/2018	7.093	€ 5.991	0	(98)	(98)	0,00
	07/2018	26.448	£ 20.075	65	0	65	0,00
	07/2018	1.062	SEK 9.130	0	(41)	(41)	0,00
	07/2018	3.016	TRY 13.803	0	(26)	(26)	0,00
	08/2018	¥ 2.340.000	\$ 21.220	27	0	27	0,00
	08/2018	MXN 89.800	4.449	0	(80)	(80)	0,00
	08/2018	\$ 1.032	ARS 21.311	0	(331)	(331)	0,00
	08/2018	20.201	CAD 26.605	40	0	40	0,00
	08/2018	94.461	MXN 1.858.459	14	(734)	(720)	(0,01)
	09/2018	¥ 20.410.000	\$ 186.154	910	0	910	0,01
	09/2018	KRW 3.953.820	3.697	137	0	137	0,00
	09/2018	TWD 11.989	404	9	0	9	0,00
	09/2018	\$ 7.172	CNH 47.728	10	0	10	0,00
	09/2018	3.207	CNY 20.667	0	(101)	(101)	0,00
	10/2018	1.463	ARS 43.920	0	(77)	(77)	0,00
	02/2019	€ 40.374	\$ 51.102	3.126	0	3.126	0,03
	04/2019	SEK 89.700	€ 8.648	71	0	71	0,00
	05/2019	\$ 1.207	1.000	0	(7)	(7)	0,00
	06/2019	£ 11.412	\$ 15.294	0	(25)	(25)	0,00
DUB	07/2018	ARS 32.000	1.134	43	0	43	0,00
	07/2018	BRL 70.722	20.063	1.681	0	1.681	0,02
	07/2018	COP 12.328.767	4.521	326	0	326	0,00
	07/2018	\$ 6.110	ARS 170.398	0	(203)	(203)	0,00
	07/2018	75.716	BRL 280.957	22	(2.713)	(2.691)	(0,03)
	07/2018	3.273	COP 9.363.588	0	(87)	(87)	0,00
	12/2018	1.002	€ 795	0	(62)	(62)	0,00
	01/2019	21.130	16.800	0	(1.190)	(1.190)	(0,01)
	03/2019	BRL 48.534	\$ 12.683	359	0	359	0,00
	03/2019	\$ 10.794	MXN 231.569	533	0	533	0,01
FBF	04/2019	SEK 27.797	€ 2.699	45	0	45	0,00
	07/2018	KRW 55.615.525	\$ 50.717	744	0	744	0,01
	07/2018	\$ 25.349	COP 72.559.754	0	(660)	(660)	(0,01)
	04/2019	€ 9.329	SEK 95.687	0	(201)	(201)	0,00
GLM	07/2018	ARS 47.613	\$ 1.663	47	0	47	0,00
	07/2018	AUD 114.494	86.071	1.476	0	1.476	0,01
	07/2018	BRL 40.586	10.647	98	0	98	0,00
	07/2018	CAD 15.330	AUD 15.859	63	0	63	0,00
	07/2018	7.683	\$ 5.771	0	(69)	(69)	0,00
	07/2018	€ 12.480	14.536	0	(35)	(35)	0,00
	07/2018	¥ 736.500	6.728	79	0	79	0,00
	07/2018	KRW 15.049.606	13.579	55	0	55	0,00
	07/2018	SEK 1.106.081	126.314	2.674	0	2.674	0,03
	07/2018	\$ 18.387	BRL 70.503	0	(67)	(67)	0,00
	07/2018	1.150	COP 3.144.491	0	(80)	(80)	0,00
	07/2018	1.171	DKK 7.395	0	(12)	(12)	0,00
	07/2018	57.811	€ 49.384	62	(214)	(152)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	07/2018	\$ 9.364	£ 6.962	\$ 0	\$ (172)	\$ (172)	0,00
	08/2018	BRL 70.503	\$ 18.338	78	0	78	0,00
	08/2018	RON 62.072	\$ 15.630	123	0	123	0,00
	08/2018	\$ 618	ZAR 8.402	0	(8)	(8)	0,00
	09/2018	RON 77.444	€ 16.463	0	(2)	(2)	0,00
	09/2018	\$ 140.466	CNH 898.015	0	(5.346)	(5.346)	(0,05)
	09/2018	46.273	RUB 2.902.369	0	(327)	(327)	0,00
HUS	07/2018	ARS 164.326	\$ 6.950	1.333	0	1.333	0,01
	07/2018	BRL 122.914	32.418	490	(19)	471	0,00
	07/2018	DKK 26.570	4.437	274	0	274	0,00
	07/2018	€ 769	892	0	(6)	(6)	0,00
	07/2018	£ 57	75	0	0	0	0,00
	07/2018	KRW 260.615	236	2	0	2	0,00
	07/2018	RUB 6.359.823	100.534	0	(819)	(819)	(0,01)
	07/2018	\$ 427	ARS 11.142	0	(47)	(47)	0,00
	07/2018	16.466	BRL 61.457	0	(493)	(493)	0,00
	07/2018	284.082	CAD 377.971	3.250	0	3.250	0,03
	07/2018	16	CHF 16	0	0	0	0,00
	07/2018	134.219	DKK 859.137	410	0	410	0,00
	07/2018	10.254	€ 8.784	2	0	2	0,00
	07/2018	37	£ 28	0	0	0	0,00
	07/2018	126.137	RUB 8.062.823	2.356	0	2.356	0,02
	08/2018	ARS 27.070	\$ 1.254	355	0	355	0,00
	08/2018	CAD 377.971	284.240	0	(3.237)	(3.237)	(0,03)
	08/2018	MXN 115.949	5.753	0	(95)	(95)	0,00
	08/2018	RUB 6.724.187	107.584	928	0	928	0,01
	08/2018	\$ 474	ARS 9.807	0	(152)	(152)	0,00
	08/2018	503	ZAR 6.403	0	(38)	(38)	0,00
	08/2018	ZAR 37.866	\$ 2.925	175	0	175	0,00
	09/2018	\$ 6.443	CNH 41.507	0	(197)	(197)	0,00
	10/2018	DKK 859.137	\$ 135.205	0	(386)	(386)	0,00
	10/2018	\$ 206	ARS 6.220	0	(10)	(10)	0,00
	10/2018	99.540	RUB 6.359.823	840	0	840	0,01
	12/2018	€ 31.753	\$ 39.733	2.174	0	2.174	0,02
	12/2018	\$ 28.220	AUD 35.510	0	(1.961)	(1.961)	(0,02)
	01/2019	€ 27.879	\$ 33.512	422	0	422	0,00
	02/2019	\$ 14.922	AUD 18.770	0	(1.033)	(1.033)	(0,01)
	03/2019	BRL 18.090	\$ 5.360	766	0	766	0,01
	03/2019	\$ 5.360	MXN 105.565	0	(196)	(196)	0,00
IND	05/2019	24.022	€ 19.897	0	(154)	(154)	0,00
	07/2018	224.375	SEK 2.023.562	1.823	0	1.823	0,02
JPM	08/2018	SEK 2.023.562	\$ 224.877	0	(1.821)	(1.821)	(0,02)
	07/2018	ARS 62.567	2.387	239	0	239	0,00
	07/2018	BRL 82.390	22.104	695	0	695	0,01
	07/2018	CAD 32.675	24.493	0	(346)	(346)	0,00
	07/2018	£ 72.984	96.643	425	(139)	286	0,00
	07/2018	SEK 205.470	23.318	350	0	350	0,00
	07/2018	\$ 1.854	AUD 2.522	9	0	9	0,00
	07/2018	18.816	CAD 24.916	150	(25)	125	0,00
	07/2018	4.168	€ 3.591	25	0	25	0,00
	07/2018	54.245	NOK 449.712	931	0	931	0,01
	08/2018	¥ 37.140.000	\$ 339.133	2.951	0	2.951	0,03
	08/2018	RUB 308.028	4.901	15	0	15	0,00
	08/2018	\$ 26.984	CZK 566.131	0	(1.526)	(1.526)	(0,01)
	08/2018	63.716	MXN 1.242.648	0	(1.036)	(1.036)	(0,01)
	08/2018	5.891	ZAR 81.375	19	0	19	0,00
	08/2018	ZAR 30.013	\$ 2.352	172	0	172	0,00
	09/2018	¥ 47.190.000	434.500	6.591	0	6.591	0,06
	09/2018	RON 5.676	€ 1.205	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	\$ 22.477	INR 1.553.835	0	(27)	(27)	0,00
MSB	01/2019	10.263	€ 8.160	0	(578)	(578)	(0,01)
	07/2018	AUD 37.780	\$ 28.535	622	0	622	0,01
	07/2018	CAD 44.245	34.107	472	0	472	0,00
	07/2018	€ 1.573.413	1.835.435	0	(1.604)	(1.604)	(0,01)
	07/2018	¥ 1.321.500	11.974	43	0	43	0,00
	07/2018	PLN 28.480	8.381	773	0	773	0,01
	07/2018	SEK 150.000	17.085	318	0	318	0,00
	07/2018	\$ 38.903	SEK 350.000	220	0	220	0,00
	08/2018	¥ 7.230.000	\$ 65.553	70	0	70	0,00
	08/2018	SEK 350.000	38.990	0	(220)	(220)	0,00
	08/2018	\$ 584	ARS 12.116	0	(184)	(184)	0,00
	09/2018	MYR 1.688	\$ 422	5	0	5	0,00
	04/2019	DKK 99.081	16.878	987	0	987	0,01
NGF	06/2021	\$ 919	€ 719	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	ARS 17.080	\$ 601	18	0	18	0,00
	07/2018	KRW 13.601.328	12.280	57	0	57	0,00
	07/2018	\$ 8.250	INR 564.300	0	(31)	(31)	0,00
	09/2018	TWD 3.319.033	\$ 112.708	3.270	0	3.270	0,03
	09/2018	\$ 22.052	INR 1.495.236	0	(448)	(448)	0,00
RBC	07/2018	5.238	SEK 45.110	0	(195)	(195)	0,00
	09/2018	CNH 36.941	\$ 5.753	194	0	194	0,00
RYL	08/2018	MXN 693.013	35.579	623	0	623	0,01
	08/2018	\$ 8.412	AUD 10.722	0	(489)	(489)	0,00
	09/2018	3.349	SGD 4.488	0	(52)	(52)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens	
SCX	07/2018	£ 428.554	\$ 569.714	\$ 3.915	\$ 0	\$ 3.915	0,04	
	07/2018	NZD 132.541	92.104	2.367	0	2.367	0,02	
	07/2018	\$ 6.663	AUD 9.036	14	0	14	0,00	
	07/2018	21.618	CAD 28.778	259	0	259	0,00	
	07/2018	4.943	£ 3.699	0	(59)	(59)	0,00	
	07/2018	24.252	NOK 197.748	11	0	11	0,00	
	07/2018	85.578	NZD 125.472	0	(628)	(628)	(0,01)	
	07/2018	12.073	SEK 107.500	0	(56)	(56)	0,00	
	08/2018	NOK 197.748	\$ 24.281	0	(10)	(10)	0,00	
	08/2018	NZD 125.472	85.582	630	0	630	0,01	
	08/2018	SEK 107.500	12.100	57	0	57	0,00	
	08/2018	\$ 6.774	AUD 8.693	0	(351)	(351)	0,00	
	09/2018	CNH 37.261	\$ 5.822	215	0	215	0,00	
	09/2018	IDR 101.128.635	7.049	65	0	65	0,00	
	09/2018	KRW 3.363.068	3.129	101	0	101	0,00	
	09/2018	\$ 4.440	TWD 131.912	0	(90)	(90)	0,00	
	10/2018	INR 1.148.123	\$ 16.587	84	0	84	0,00	
	12/2018	€ 1.111	1.400	86	0	86	0,00	
	SOG	07/2018	AUD 34.964	26.325	492	0	492	0,00
		07/2018	SEK 3.179.034	356.806	1.448	0	1.448	0,01
07/2018		\$ 93.670	TRY 432.184	0	(44)	(44)	0,00	
08/2018		237	ARS 4.916	0	(75)	(75)	0,00	
SSB	12/2018	18.657	€ 14.805	0	(1.146)	(1.146)	(0,01)	
	07/2018	DKK 443.862	\$ 74.305	4.751	0	4.751	0,05	
	07/2018	\$ 1.673.372	€ 1.444.680	13.364	0	13.364	0,13	
	07/2018	315	HKD 2.474	0	0	0	0,00	
TOR	08/2018	€ 1.444.680	\$ 1.677.074	0	(13.324)	(13.324)	(0,13)	
	09/2018	\$ 7.098	IDR 99.606.730	0	(219)	(219)	0,00	
	07/2018	239.975	¥ 26.366.000	0	(1.939)	(1.939)	(0,02)	
	08/2018	¥ 26.366.000	\$ 240.467	1.957	0	1.957	0,02	
UAG	07/2018	10.436.000	\$ 98.174	3.919	0	3.919	0,04	
	07/2018	PLN 3.704	1.106	116	0	116	0,00	
	07/2018	\$ 3.078	BRL 11.887	11	0	11	0,00	
	07/2018	24.593	CAD 32.675	246	0	246	0,00	
	07/2018	8.997	DKK 54.205	0	(502)	(502)	0,00	
	07/2018	4.783	NZD 7.069	3	0	3	0,00	
	08/2018	BRL 11.887	\$ 3.069	0	(9)	(9)	0,00	
	08/2018	CAD 32.675	24.606	0	(246)	(246)	0,00	
	08/2018	NZD 7.069	4.783	0	(3)	(3)	0,00	
	09/2018	\$ 19.712	RUB 1.239.157	0	(96)	(96)	0,00	
	12/2018	€ 542	\$ 674	33	0	33	0,00	
					\$ 129.422	\$ (68.239)	\$ 61.183	0,58

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CHF (Hedged) Class, Investor CHF (Hedged) Class und Class E CHF (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07/2018	\$ 234.618	CHF 231.055	\$ 0	\$ (1.922)	\$ (1.922)	(0,02)
BPS	07/2018	CHF 50	\$ 50	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 1.195	CHF 1.181	0	(6)	(6)	0,00
BRC	07/2018	12.996	12.785	0	(120)	(120)	0,00
CBK	07/2018	235.806	232.917	3	(1.238)	(1.235)	(0,01)
GLM	07/2018	CHF 239.662	\$ 240.118	1	(1.247)	(1.246)	(0,01)
	07/2018	\$ 233.909	CHF 231.471	0	(795)	(795)	(0,01)
JPM	08/2018	240.476	239.415	1.242	0	1.242	0,01
	07/2018	CHF 239.697	\$ 241.910	511	0	511	0,00
	07/2018	\$ 1.393	CHF 1.373	0	(10)	(10)	0,00
RBC	08/2018	242.523	239.697	0	(521)	(521)	0,00
	07/2018	528	519	0	(5)	(5)	0,00
SSB	07/2018	CHF 1.747	\$ 1.753	0	(7)	(7)	0,00
	07/2018	\$ 8.037	CHF 7.929	5	(56)	(51)	0,00
				\$ 1.762	\$ (5.927)	\$ (4.165)	(0,04)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional EUR (Currency Exposure) Class, Institutional GBP (Currency Exposure) Class, Institutional USD (Currency Exposure) Class, Investor USD (Currency Exposure) Class, Class E USD (Currency Exposure) und Class R USD (Currency Exposure) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07/2018	AUD 7.684	\$ 5.672	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	07/2018	\$ 1.212.397	€ 1.035.387	0	(3.530)	(3.530)	(0,03)
	07/2018	246	¥ 26.930	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	HUF 266	\$ 1	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 5.673	AUD 7.684	5	0	5	0,00
	09/2018	880	SGD 1.169	0	(22)	(22)	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
BPS	07/2018	€ 586.856	\$ 682.807	\$ 0	\$ (2.377)	\$ (2.377)	(0,02)
	07/2018	\$ 96.674	€ 83.350	641	0	641	0,01
	07/2018	33.204	¥ 3.606.306	0	(646)	(646)	(0,01)
	08/2018	684.327	€ 586.856	2.344	0	2.344	0,02
BRC	08/2018	372	HUF 96.441	0	(29)	(29)	0,00
	07/2018	€ 461	\$ 533	0	(5)	(5)	0,00
CBK	07/2018	\$ 23.446	€ 19.872	0	(245)	(245)	0,00
	07/2018	€ 5.707	\$ 6.676	30	(18)	12	0,00
GLM	07/2018	\$ 9.349	CAD 12.171	0	(97)	(97)	0,00
	07/2018	1.382	DKK 8.295	0	(82)	(82)	0,00
	07/2018	881	€ 745	1	(12)	(11)	0,00
	07/2018	19.682	£ 14.855	0	(69)	(69)	0,00
	07/2018	360	¥ 39.401	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	MXN 1.147	\$ 58	0	0	0	0,00
HUS	08/2018	\$ 1.079	MXN 21.066	0	(17)	(17)	0,00
	07/2018	€ 3.145	\$ 3.673	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 5.111	AUD 6.799	0	(88)	(88)	0,00
	07/2018	2.693	CHF 2.660	0	(14)	(14)	0,00
	07/2018	3.586	€ 3.047	6	(33)	(27)	0,00
	07/2018	2.587	£ 1.940	0	(26)	(26)	0,00
RBC	07/2018	244	SEK 2.147	0	(4)	(4)	0,00
	09/2018	KRW 1.324	\$ 1	0	0	0	0,00
IND	07/2018	CAD 13.748	10.333	0	(118)	(118)	0,00
	08/2018	\$ 10.339	CAD 13.748	118	0	118	0,00
MSB	08/2018	56	ZAR 707	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	1.204.316	€ 1.032.228	862	0	862	0,01
RBC	07/2018	8.687	¥ 942.547	0	(178)	(178)	0,00
	07/2018	724	PLN 2.461	0	(67)	(67)	0,00
	07/2018	34.353	€ 29.637	249	0	249	0,00
RYL	07/2018	€ 4.083	\$ 4.783	16	0	16	0,00
	07/2018	\$ 4.520	€ 3.845	0	(30)	(30)	0,00
SCX	08/2018	0	HUF 6	0	0	0	0,00
	09/2018	0	KRW 350	0	0	0	0,00
	07/2018	DKK 8.295	\$ 1.300	0	0	0	0,00
	07/2018	€ 589	688	1	0	1	0,00
	07/2018	¥ 26.791	244	2	0	2	0,00
	07/2018	SEK 17.995	2.021	9	0	9	0,00
	07/2018	\$ 1.217	CAD 1.577	0	(18)	(18)	0,00
	07/2018	36.423	€ 30.904	5	(346)	(341)	(0,01)
	07/2018	620	NZD 880	0	(24)	(24)	0,00
	08/2018	2.025	SEK 17.995	0	(10)	(10)	0,00
SOG	09/2018	5.613	KRW 6.036.619	0	(177)	(177)	0,00
	10/2018	1.310	DKK 8.295	0	0	0	0,00
	07/2018	1.779	SEK 15.848	0	(7)	(7)	0,00
	08/2018	545	ILS 1.967	0	(6)	(6)	0,00
SSB	07/2018	€ 1.149.302	\$ 1.331.786	0	(10.082)	(10.082)	(0,09)
	07/2018	\$ 1.194.255	€ 1.031.437	10.000	0	10.000	0,09
	07/2018	34.248	¥ 3.716.677	0	(694)	(694)	(0,01)
	07/2018	573	NOK 4.680	1	0	1	0,00
TOR	08/2018	1.334.732	€ 1.149.302	10.048	0	10.048	0,09
	09/2018	1.358	MYR 5.435	0	(16)	(16)	0,00
	07/2018	¥ 8.305.070	\$ 75.590	611	0	611	0,01
UAG	07/2018	\$ 666	AUD 885	0	(13)	(13)	0,00
	08/2018	75.745	¥ 8.305.070	0	(617)	(617)	(0,01)
	07/2018	€ 1.044.448	\$ 1.212.761	0	(6.685)	(6.685)	(0,06)
	07/2018	£ 16.795	22.208	34	0	34	0,00
UAG	08/2018	\$ 1.215.471	€ 1.044.448	6.622	0	6.622	0,06
	08/2018	22.239	£ 16.795	0	(35)	(35)	0,00
				\$ 31.606	\$ (26.453)	\$ 5.153	0,05

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Hedged) Class, Investor GBP (Hedged) Class, Administrative GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged) und Class R GBP (Hedged) 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	07/2018	\$ 192	£ 143	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
BOA	07/2018	226.110	£ 169.342	0	(2.536)	(2.536)	(0,02)
BPS	07/2018	£ 50	\$ 66	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 1.430	£ 1.086	4	0	4	0,00
BRC	07/2018	£ 172.801	\$ 225.964	0	(2.176)	(2.176)	(0,02)
	07/2018	\$ 4.639	£ 3.470	0	(58)	(58)	0,00
CBK	08/2018	226.279	£ 172.801	2.170	0	2.170	0,02
	07/2018	£48	\$ 64	1	0	1	0,00
GLM	07/2018	\$ 226.014	£ 170.593	0	(789)	(789)	(0,01)
	07/2018	1.541	£ 1.163	3	(8)	(5)	0,00
SCX	07/2018	£96	\$ 128	2	0	2	0,00
SSB	07/2018	\$ 227.457	£ 171.099	0	(1.563)	(1.563)	(0,02)
	07/2018	£169	\$ 224	2	0	2	0,00
UAG	07/2018	\$ 355	£ 268	1	(3)	(2)	0,00
	07/2018	£ 172.632	\$ 228.263	346	0	346	0,00
	08/2018	\$ 228.566	£ 172.632	0	(360)	(360)	0,00
				\$ 2.529	\$ (7.496)	\$ (4.967)	(0,05)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional ILS (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 Nettover- mögens
BOA	08/2018	\$ 157	ILS 562	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
GLM	08/2018	ILS 277	\$ 76	1	0	1	0,00
JPM	08/2018	\$ 155	ILS 560	0	(3)	(3)	0,00
SCX	08/2018	ILS 277	\$ 76	1	0	1	0,00
SOG	08/2018	\$ 155	ILS 560	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 2	\$ (8)	\$ (6)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional NOK (Hedged) Class und Investor NOK (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 Nettover- mögens
BOA	07/2018	NOK 1.548.026	\$ 188.627	\$ 0	\$ (1.305)	\$ (1.305)	(0,01)
	07/2018	\$ 199.561	NOK 1.626.577	9	0	9	0,00
	08/2018	188.855	1.548.026	1.304	0	1.304	0,01
BRC	07/2018	39	312	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	251	2.041	0	0	0	0,00
DUB	07/2018	NOK 197	\$ 24	0	0	0	0,00
GLM	07/2018	327	40	0	0	0	0,00
HUS	07/2018	208	26	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 205.175	NOK 1.679.973	946	0	946	0,01
IND	07/2018	34.279	279.876	60	0	60	0,00
JPM	07/2018	35.442	293.827	608	0	608	0,01
SCX	07/2018	NOK 1.465.063	\$ 179.673	0	(80)	(80)	0,00
	07/2018	\$ 140.136	NOK 1.153.621	1.406	0	1.406	0,01
	08/2018	179.892	1.465.063	75	0	75	0,00
SSB	07/2018	358	2.917	0	0	0	0,00
UAG	07/2018	1.810	14.635	0	(15)	(15)	0,00
				\$ 4.408	\$ (1.400)	\$ 3.008	0,03

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional NZD (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 Nettover- mögens
BOA	07/2018	\$ 26.677	NZD 38.132	\$ 0	\$ (860)	\$ (860)	(0,01)
HUS	07/2018	NZD 514	\$ 354	6	0	6	0,00
	07/2018	\$ 103	NZD 150	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07/2018	26.463	38.273	0	(550)	(550)	(0,01)
RYL	07/2018	35	50	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2018	NZD 38.290	\$ 26.116	192	0	192	0,01
	07/2018	\$ 26.858	NZD 38.647	0	(693)	(693)	(0,01)
	08/2018	26.117	38.290	0	(192)	(192)	0,00
UAG	07/2018	NZD 38.334	\$ 25.936	0	(18)	(18)	0,00
	08/2018	\$ 25.936	NZD 38.334	18	0	18	0,00
				\$ 216	\$ (2.316)	\$ (2.100)	(0,02)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional SEK (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 Nettover- mögens
GLM	07/2018	\$ 30.686	SEK 268.706	\$ 0	\$ (650)	\$ (650)	(0,01)
IND	07/2018	SEK 271.043	\$ 30.053	0	(244)	(244)	0,00
	08/2018	\$ 30.121	SEK 271.043	244	0	244	0,00
JPM	07/2018	30.647	271.550	0	(293)	(293)	0,00
SCX	07/2018	SEK 270.765	\$ 30.408	141	0	141	0,00
	08/2018	\$ 30.477	SEK 270.765	0	(143)	(143)	0,00
SOG	07/2018	30.386	270.732	0	(123)	(123)	0,00
				\$ 385	\$ (1.453)	\$ (1.068)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional SGD (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 Nettover- mögens
BOA	09/2018	\$ 25.511	SGD 33.876	\$ 0	\$ (625)	\$ (625)	(0,01)
CBK	09/2018	21.413	28.669	0	(352)	(352)	0,00
SCX	09/2018	6.257	8.388	0	(94)	(94)	0,00
SSB	09/2018	385	513	0	(8)	(8)	0,00
				\$ 0	\$ (1.079)	\$ (1.079)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 52.234 0,49

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARK- TWER- (000S)	% DES NETT- OVER- MÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Freddie Mac, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 1.200	\$ (1.249)	(0,01)
Ginnie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	1.500	(1.504)	(0,02)
		(2.753)	(0,03)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere	\$	(2.753)	(0,03)
Summe Anlagen	\$	13.341.779	125,99
Sonstige Aktiva und Passiva	\$	(2.753.133)	(25,99)
Nettovermögen	\$	10.588.646	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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Nullkuponwertpapier.

(d) 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.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 391.200 und Barmittel in Höhe von USD 2.339 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 121.636 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 21.600 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettover- mögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 9.798	U.S. Treasury Notes 0,800 % fällig am 15.11.2021	\$ (9.998)	\$ 9.798	\$ 9.798	0,09
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (9.998)	\$ 9.798	\$ 9.798	0,09

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

Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 447.295	\$ 12.811.933	\$ 0	\$ 13.259.228
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(12.297)	97.601	0	85.304
Leerverkäufe	0	(2.753)	0	(2.753)
Summen	\$ 434.998	\$ 12.906.781	\$ 0	\$ 13.341.779

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 520.220	\$ 12.017.668	\$ 9.837	\$ 12.547.725
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(11.406)	41.719	(11)	30.302
Leerverkäufe	0	(1.276)	0	(1.276)
<b>Summen</b>	<b>\$ 508.814</b>	<b>\$ 12.058.111</b>	<b>\$ 9.826</b>	<b>\$ 12.576.751</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 der Wertpapieranlagen.

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BCY	2,180 %	13.06.2018	12.07.2018	\$ (90.316)	\$ (90.414)	(0,85)
BPS	(0,450)	19.04.2018	19.07.2018	€ (107.316)	(125.181)	(1,18)
SCX	0,600	02.05.2018	05.07.2018	£ (130.394)	(172.325)	(1,63)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (387.920)</b>	<b>(3,66)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 116	\$ 0	\$ 116
BOA	(1.170)	13.960	12.790
BPS	922	(3.820)	(2.898)
BRC	(2.147)	2.620	473
CBK	10.998	(10.120)	878
DUB	307	(1.900)	(1.593)
FBF	(117)	(280)	(397)
GLM	(2.531)	3.280	749
GST	(1.063)	970	(93)
HUS	6.289	(5.680)	609
IND	58	0	58
JPM	8.456	(7.310)	1.146
MSB	3.246	(8.970)	(5.724)
MYC	(500)	(255)	(755)
NGF	2.866	(3.290)	(424)
RBC	243	0	243
RYL	2.397	(858)	1.539
SCX	5.476	(7.060)	(1.584)
SOG	1.247	(3.510)	(2.263)
SSB	13.763	(2.770)	10.993
TOR	(1)	0	(1)
UAG	3.379	(2.650)	729

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,86	67,96
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	30,13	49,37
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	7,23	3,10
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,12)	(0,11)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,43	(0,07)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,49	0,47
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,03)	(0,01)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(3,66)	(2,97)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 23.04.2018	JPY 42.023.900	378.936	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	\$ 347.100	342.550
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	\$ 347.100	342.282	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 28.02.2023	267.600	267.767
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 21.04.2018	JPY 34.330.000	323.220	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b)	123.896	122.088
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 04.06.2018	31.330.000	292.780	Spain Government International Bond 1,500 % fällig am 30.04.2027	€ 65.250	80.965
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 03.09.2018	31.330.000	286.041	Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2047	DKK 367.600	60.397
U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 28.02.2023	\$ 267.600	266.931	Bank Nederlandse Gemeenten NV 0,500 % fällig am 16.04.2025	€ 35.800	44.179
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 06.08.2018	¥ 28.310.000	258.250	National Australia Bank Ltd. 2,400 % fällig am 07.12.2021	\$ 42.300	41.951
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 14.05.2018	23.240.400	213.047	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,450 % fällig am 01.03.2048	€ 31.600	40.441
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 20.08.2018	23.470.000	212.107	Ireland Government International Bond 1,000 % fällig am 15.05.2026	26.400	33.100
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 30.04.2025	\$ 212.500	210.332	JPMorgan Chase & Co. 3,260 % fällig am 25.04.2023	\$ 30.000	30.389
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 18.06.2018	¥ 20.410.000	192.503	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2023 (b)	29.842	29.198
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 18.09.2018	20.410.000	185.158	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,950 % fällig am 14.02.2028	€ 22.000	27.046
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 184.289	179.430	Europäische Union 0,500 % fällig am 04.04.2025	19.400	23.810
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 11.06.2018	¥ 15.860.000	149.570	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,450 % fällig am 05.09.2040	17.800	21.654
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 10.09.2018	15.860.000	145.079	Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2037	DKK 120.765	20.788
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 09.04.2018	10.436.300	98.382	Swedbank AB 2,200 % fällig am 04.03.2020	\$ 20.400	20.265
Japan Treasury Discount Bill 0,000 % fällig am 09.07.2018	10.436.000	97.148	Realkredit Danmark A/S 2,000 % fällig am 01.10.2037	DKK 115.473	19.743
United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 22.07.2047	£ 61.100	74.815	Southern Co. 2,950 % fällig am 01.07.2023	\$ 19.653	19.368
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)	\$ 69.477	70.806	Slovenia Government International Bonds 1,000 % fällig am 06.03.2028	€ 15.300	18.589

(a) Der Global Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



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>GUERNSEY, KANALINSELN</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>KUWAIT</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Berica ABS SRL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.				7,000 % fällig am 19.01.2021 (f)(h) €	200	\$ 239	0,02	Kuwait International Government Bond			
3,800 % fällig am 09.06.2023	\$ 1.800	\$ 1.779	0,18	7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h)	1.500	1.893	0,19	2,750 % fällig am 20.03.2022	\$ 1.600	\$ 1.561	0,16
								3,500 % fällig am 20.03.2027	6.700	6.534	0,65
<b>HONGKONG</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				Summe Kuwait			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>							
AIA Group Ltd.				1,450 % fällig am 15.11.2024	49	57	0,01				
3,900 % fällig am 06.04.2028	600	600	0,06	2,450 % fällig am 01.09.2033							
CNPC General Capital Ltd.				2,700 % fällig am 01.03.2047	560	652	0,07				
2,750 % fällig am 14.05.2019	900	897	0,09	2,800 % fällig am 01.03.2067	367	430	0,04				
Eastern Creation Investment Holdings Ltd.				2,950 % fällig am 01.09.2038							
2,750 % fällig am 26.09.2020	1.000	979	0,10	3,250 % fällig am 01.09.2046							
Horse Gallop Finance Ltd.				3,450 % fällig am 01.03.2048	98	115	0,01				
3,516 % fällig am 28.06.2021	1.000	1.001	0,10	6,000 % fällig am 04.08.2028 £							
Poly Real Estate Finance Ltd.											
3,950 % fällig am 05.02.2023	600	583	0,06								
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.											
3,880 % fällig am 25.05.2023	600	597	0,06								
Summe Hongkong		4.657	0,47								
<b>INDIEN</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				<b>LUXEMBURG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Italy Government International Bond</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Indian Railway Finance Corp. Ltd.				2,000 % fällig am 14.09.2021	13.100	14.647	1,47				
3,835 % fällig am 13.12.2027	600	559	0,06	2,362 % fällig am 28.05.2021	400	438	0,05				
				2,567 % fällig am 02.11.2021	600	627	0,06				
<b>IRLAND</b>				<b>Summe Italien</b>				<b>Bavarian Sky Europe S.A.</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>								0,030 % fällig am 15.07.2026 €			
Black Diamond CLO Designated Activity Co.											
0,650 % fällig am 03.10.2029	€ 2.000	2.334	0,24								
Harvest CLO DAC											
0,630 % fällig am 18.11.2029	2.400	2.806	0,28								
Sorrento Park CLO DAC											
0,624 % fällig am 16.11.2027	1.300	1.518	0,15								
		6.658	0,67								
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Summe Japan</b>				<b>Summe Luxemburg</b>			
AerCap Ireland Capital DAC											
3,750 % fällig am 15.05.2019	\$ 300	302	0,03								
4,625 % fällig am 30.10.2020	200	204	0,02								
Bank of Ireland											
7,375 % fällig am 18.06.2020 (f)(h) €	400	502	0,05								
PartnerRe Ireland Finance DAC											
1,250 % fällig am 15.09.2026	1.100	1.215	0,12								
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC											
1,900 % fällig am 23.09.2019	\$ 400	394	0,04								
2,400 % fällig am 23.09.2021	100	95	0,01								
		2.712	0,27								
<b>AKTIEN</b>				<b>Summe Japan</b>				<b>Summe Niederlande</b>			
<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>											
PIMCO Fixed Income Source											
ETFs plc - PIMCO Euro Short											
Maturity Source UCITS ETF (g)	57.650	6.778	0,68								
<b>INVESTMENTFONDS</b>				<b>Summe Japan</b>				<b>Summe Niederlande</b>			
PIMCO Specialty Funds Ireland											
p.l.c. - PIMCO China Bond											
Fund (g)	402.852	4.588	0,46								
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>Summe Japan</b>				<b>Summe Niederlande</b>			
<b>Bluestep Mortgage Securities DAC</b>											
1,136 % fällig am 10.05.2063	SEK 5.703	643	0,06								
Summe Irland		21.379	2,14								
<b>ITALIEN</b>				<b>Summe Japan</b>				<b>Summe Niederlande</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
Intesa Sanpaolo SpA											
6,250 % fällig am 16.05.2024 (f)(h) €	1.000	1.153	0,12								

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US 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>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Banco Santander S.A.</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
<b>Kommunalbanken A/S</b>				3,848 % fällig am 12.04.2023	\$	400	0,04	<b>Switzerland Government International Bond</b>					
6,500 % fällig am 12.04.2021	AUD	2.700	0,22	4,750 % fällig am 19.03.2025 (f)(h)	€	3.000	0,32	3,500 % fällig am 08.04.2033	CHF	3.200	0,48		
<b>Norway Government International Bond</b>				<b>Merlin Properties Socimi S.A.</b>				<b>Summe Schweiz</b>					
1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK	6.300	0,08	1,750 % fällig am 26.05.2025		1.600	0,19			19.990	2,00		
3,750 % fällig am 25.05.2021		3.700	0,05					<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>					
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
						6.702	0,67	<b>Emirate of Abu Dhabi Government International Bond</b>					
<b>Summe Norwegen</b>		7.383	0,74	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>2,500 % fällig am 11.10.2022</b>	\$	2.000	1,919	0,19	
				<b>Bancaja Fondo de Titulacion de Activos</b>				3,125 % fällig am 11.10.2027		1.700	1,586	0,16	
				0,000 % fällig am 20.02.2036		71	0,01	<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>					
										3.505	0,35		
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>GROSSBRITANNIEN</b>					
				<b>Autonomous Community of Andalusia</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
				4,850 % fällig am 17.03.2020		600	0,08	<b>Barclays Bank PLC</b>					
				<b>Autonomous Community of Catalonia</b>				7,625 % fällig am 21.11.2022 (h)		6.390	6,891	0,69	
				4,220 % fällig am 26.04.2035		400	0,05	<b>Barclays PLC</b>					
				4,900 % fällig am 15.09.2021		1.600	0,20	2,375 % fällig am 06.10.2023		€	1.800	2,336	0,23
				4,950 % fällig am 11.02.2020		2.700	0,34	6,500 % fällig am 15.09.2019 (f)(h)		€	500	602	0,06
				<b>Spain Government International Bond</b>				7,000 % fällig am 15.09.2019 (f)(h)		€	300	405	0,04
				1,500 % fällig am 30.04.2027		100	0,01	8,000 % fällig am 15.12.2020 (f)(h)		€	200	259	0,03
				2,900 % fällig am 31.10.2046		6.500	0,83	8,250 % fällig am 15.12.2018 (f)(h)		\$	1.800	1,832	0,18
				5,250 % fällig am 06.04.2029		€	500	0,08	<b>Co-operative Group Holdings Ltd.</b>				
								6,875 % fällig am 08.07.2020		€	800	1,147	0,12
				<b>Summe Spanien</b>		24.114	2,42	<b>Frontier Finance PLC</b>					
								8,000 % fällig am 23.03.2022			2.800	3,696	0,37
				<b>ÜBERNATIONAL</b>				<b>HSBC Holdings PLC</b>					
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,926 % fällig am 18.05.2021					
				<b>Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung</b>				3,326 % fällig am 18.05.2024		\$	1.200	1,202	0,12
				0,500 % fällig am 21.12.2023	AUD	3.100	0,20	3,950 % fällig am 18.05.2024			1.000	998	0,10
				<b>Europäische Investitionsbank</b>				6,250 % fällig am 23.03.2023 (f)(h)			1.200	1,197	0,12
				0,500 % fällig am 21.07.2023		1.200	0,08	6,500 % fällig am 23.03.2028 (f)(h)			500	491	0,05
				<b>Nordic Investment Bank</b>				6,500 % fällig am 23.03.2028 (f)(h)			600	577	0,06
				5,000 % fällig am 19.04.2022		900	0,07	<b>Lloyds Bank PLC</b>					
				<b>Summe übernational</b>		3.505	0,35	3,300 % fällig am 07.05.2021			500	499	0,05
								4,875 % fällig am 30.03.2027		€	1.100	1,798	0,18
				<b>SCHWEDEN</b>				<b>Lloyds Banking Group PLC</b>					
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,000 % fällig am 27.06.2019 (f)(h)					
				<b>Danske Hypotek AB</b>				7,625 % fällig am 27.06.2023 (f)(h)		€	300	434	0,04
				1,000 % fällig am 21.12.2022	SEK	18.000	0,21	<b>Nationwide Building Society</b>					
				<b>Landshypotek Bank AB</b>				3,766 % fällig am 08.03.2024		\$	2.100	2,059	0,21
				0,700 % fällig am 09.05.2022		38.000	0,43	6,875 % fällig am 20.06.2019 (f)(h)		€	400	540	0,05
				<b>Lansforsakringar Hypotek AB</b>				10,250 % (f)			2	376	0,04
				1,250 % fällig am 20.09.2023		18.600	0,22	<b>RAC Bond Co. PLC</b>					
				2,250 % fällig am 21.09.2022		17.700	0,21	4,565 % fällig am 06.05.2046			1.600	2,205	0,22
				<b>Nordea Hypotek AB</b>				<b>Reckitt Benckiser Treasury Services PLC</b>					
				1,000 % fällig am 08.04.2022		55.100	0,63	2,375 % fällig am 24.06.2022		\$	1.100	1,052	0,11
				<b>Skandinaviska Enskilda Banken AB</b>				<b>Royal Bank of Scotland Group PLC</b>					
				1,500 % fällig am 15.12.2021		49.000	0,57	2,500 % fällig am 22.03.2023		€	2.100	2,584	0,26
				<b>Stadshypotek AB</b>				3,498 % fällig am 15.05.2023		\$	1.900	1,842	0,18
				1,500 % fällig am 15.12.2021		33.000	0,39	3,813 % fällig am 15.05.2023			1.900	1,910	0,19
				2,500 % fällig am 18.09.2019		6.000	0,07	4,700 % fällig am 03.07.2018			400	400	0,04
				2,500 % fällig am 05.04.2022		3.000	0,29	<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>					
				4,500 % fällig am 21.09.2022	SEK	46.000	0,60	3,373 % fällig am 05.01.2024			2.500	2,406	0,24
				<b>Sveriges Sakerställa Obligationer AB</b>				7,375 % fällig am 24.06.2022 (f)(h)		€	273	376	0,04
				1,250 % fällig am 15.06.2022		22.000	0,26	<b>Santander UK PLC</b>					
				2,000 % fällig am 17.06.2026		14.000	0,17	2,375 % fällig am 16.03.2020		\$	200	197	0,02
				<b>Swedbank Hypotek AB</b>				<b>Tesco PLC</b>					
				1,000 % fällig am 15.09.2021		56.300	0,65	6,125 % fällig am 24.02.2022		€	274	411	0,04
				1,000 % fällig am 15.06.2022		37.600	0,43	<b>Tesco Property Finance PLC</b>					
				<b>Summe Schweden</b>		51.139	5,13	5,744 % fällig am 13.04.2040			1.314	2,025	0,20
								7,623 % fällig am 13.07.2039			89	158	0,02
				<b>SCHWEIZ</b>				<b>University of Oxford</b>					
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,544 % fällig am 08.12.2117					
				<b>Credit Suisse Group AG</b>				<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b>					
				3,536 % fällig am 14.12.2023	\$	3.400	0,34	4,875 % fällig am 15.01.2027			1.300	1,674	0,17
				<b>UBS AG</b>				<b>Virgin Money PLC</b>					
				2,200 % fällig am 08.06.2020		1.900	0,19	2,250 % fällig am 21.04.2020			1.575	2,097	0,21
				2,780 % fällig am 01.12.2020		700	0,07	<b>Vodafone Group PLC</b>					
				2,901 % fällig am 08.06.2020		2.800	0,28	3,290 % fällig am 16.01.2024		\$	600	598	0,06
				5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)		600	0,06	3,750 % fällig am 16.01.2024			700	695	0,07
				7,625 % fällig am 17.08.2022 (h)		3.750	0,41	<b>Summe Schweiz</b>					
				<b>UBS Group Funding Switzerland AG</b>									
				2,950 % fällig am 24.09.2020		1.700	0,17						
								<b>NON-AGENCY-MBS</b>					
						15.224	1,52	<b>Aggregator of Loans Backed by Assets PLC</b>					
								1,748 % fällig am 24.04.2049	£	1.440	1,916	0,19	





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>Ginnie Mae</b>				<b>Energy Corp.</b>				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
3,125 % fällig am 20.11.2022	\$ 4	\$ 4	0,00	2,430 % fällig am 12.07.2018	\$ 400	\$ 400	0,04	<b>Harris Corp.</b>			
<b>NCUA Guaranteed Notes</b>				2,700 % fällig am 04.09.2018	1.500	1.493	0,15	2,794 % fällig am 27.02.2019	\$ 1.400	\$ 1.401	0,14
2,495 % fällig am 05.11.2020	1.132	1.137	0,11	<b>Enterprise Prods Oper LLC</b>				<b>Letras del Banco Central de la Republica Argentina</b>			
2,585 % fällig am 08.12.2020	1.292	1.299	0,13	2,320 % fällig am 06.07.2018	600	600	0,06	25,800 % fällig am 18.07.2018	ARS 1.632	55	0,01
		123.382	12,37	<b>Enterprise Products Operating LLC</b>				38,000 % fällig am 17.10.2018	2.410	75	0,01
				2,350 % fällig am 26.07.2018	1.100	1.098	0,11	40,700 % fällig am 18.07.2018	5.660	192	0,02
<b>US-SCHATZOBIGLATIONEN</b>				<b>Hewlett Packard Enterprise Co.</b>						1.723	0,18
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)</b>				2,340 % fällig am 10.07.2018	900	899	0,09	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
0,125 % fällig am 15.01.2022	775	762	0,08	<b>HP, Inc.</b>				(12,971) % fällig am 03.09.2018 (c)(d)	¥ 2.670.000	24.111	2,42
0,125 % fällig am 15.04.2022	5.047	4.944	0,50	2,460 % fällig am 23.07.2018	900	899	0,09	(0,139) % fällig am 02.07.2018 (c)(d)	150.000	1.354	0,13
0,125 % fällig am 15.01.2023 (i)	13.241	12.946	1,30	<b>Marriot International</b>				(0,136) % fällig am 09.07.2018 (c)(d)	540.000	4.875	0,49
0,375 % fällig am 15.07.2025	1.796	1.765	0,18	2,350 % fällig am 27.08.2018	500	498	0,05	25,800 % fällig am 19.09.2018 (c)(d)	4.595	146	0,01
0,500 % fällig am 15.01.2028	14.625	14.313	1,43	2,480 % fällig am 15.08.2018	300	299	0,03	40,000 % fällig am 19.09.2018 (c)(d)	2.600	83	0,01
0,625 % fällig am 15.01.2026	211	210	0,02	2,480 % fällig am 16.08.2018	1.400	1.396	0,14			296	0,03
1,000 % fällig am 15.02.2048	6.806	7.043	0,71	<b>Marriott International</b>				<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
1,375 % fällig am 15.02.2044	1.290	1.442	0,14	2,290 % fällig am 25.07.2018	300	300	0,03	(0,148) % fällig am 03.09.2018 (c)(d)			
1,750 % fällig am 15.01.2028	478	523	0,05	<b>McKesson Corp.</b>				(0,139) % fällig am 02.07.2018 (c)(d)			
2,000 % fällig am 15.01.2026	568	622	0,06	2,390 % fällig am 23.07.2018	1.500	1.498	0,15	(0,136) % fällig am 09.07.2018 (c)(d)			
2,375 % fällig am 15.01.2025	66	74	0,01	2,400 % fällig am 17.07.2018	600	599	0,06	(0,130) % fällig am 10.09.2018 (c)(d)	1.510.000	13.636	1,37
2,375 % fällig am 15.01.2027	621	707	0,07	2,400 % fällig am 19.07.2018	400	399	0,04	(0,126) % fällig am 18.09.2018 (c)(d)	1.240.000	11.198	1,12
2,500 % fällig am 15.01.2029	2.334	2.745	0,27	2,240 % fällig am 11.07.2018	900	899	0,09			55.174	5,53
3,875 % fällig am 15.04.2029	1.371	1.810	0,18	2,240 % fällig am 12.07.2018	1.500	1.499	0,15	Summe kurzfristige Instrumente		88.925	8,92
<b>U.S. Treasury Notes</b>				<b>NBCUniversal Enterprise, Inc.</b>							
2,000 % fällig am 15.08.2025 (i)	2.900	2.748	0,28	2,290 % fällig am 19.07.2018	400	399	0,04	<b>AKTIEN</b>			
2,250 % fällig am 15.11.2025	2.300	2.213	0,22	<b>Rockwell Collins, Inc.</b>				<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
2,875 % fällig am 30.04.2025 (i)	19.400	19.478	1,95	2,350 % fällig am 17.07.2018	300	300	0,03	<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. -</b>			
<b>U.S. Treasury STRIPS</b>				<b>Schlumberger Holdings</b>				<b>PIMCO US Dollar Short-Term</b>			
0,000 % fällig am 15.11.2023 (c)	300	258	0,03	2,620 % fällig am 03.10.2018	1.500	1.490	0,15	<b>Floating NAV Fund (g)</b>	1.347.044	13.488	1,35
		74.603	7,48	<b>Southern Co.</b>				Summe Übertragbare Wertpapiere und			
				2,400 % fällig am 16.07.2018	500	499	0,05	Geldmarktinstrumente – Amtliche			
Summe USA		361.627	36,25	<b>Syngenta Wilmington</b>				Börse/Regelgelder Markt		\$ 1.169.239	117,21
				2,950 % fällig am 27.07.2018	1.500	1.497	0,15				
<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>Thomson Reuters Corp.</b>							
<b>COMMERCIAL PAPER</b>				2,450 % fällig am 16.07.2018	1.500	1.498	0,15				
<b>American Electric Power, Inc.</b>				2,460 % fällig am 11.07.2018	900	899	0,09				
2,370 % fällig am 24.07.2018	800	799	0,08	<b>Walgreens Boots Alliance</b>							
<b>Boston Scientific Corp.</b>				2,630 % fällig am 25.07.2018	800	799	0,08				
2,400 % fällig am 12.07.2018	800	799	0,08	<b>WEC Energy Group, Inc.</b>							
2,430 % fällig am 11.07.2018	1.300	1.299	0,13	2,400 % fällig am 18.07.2018	1.000	999	0,10				
2,500 % fällig am 13.08.2018	400	399	0,04			29.248	2,93				
<b>Commonwealth Edison</b>				<b>PENSIONSGESCHÄFTE (j)</b>							
2,350 % fällig am 25.07.2018	400	399	0,04			2.484	0,25				
<b>Conagra Foods, Inc.</b>											
2,300 % fällig am 09.07.2018	300	300	0,03								
<b>Dominion Resources</b>											
2,370 % fällig am 16.07.2018	700	699	0,07								
<b>Duke Energy Corp.</b>											
2,300 % fällig am 01.08.2018	500	499	0,05								
<b>Energy Transfer Partners</b>											
2,800 % fällig am 03.07.2018	1.400	1.400	0,14								

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
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2019	16	\$ 1	0,00
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2020	16	(4)	0,00
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2019	1.949	(392)	(0,04)
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03/2020	1.949	120	0,01
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2018	101	(72)	(0,01)
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09/2019	101	119	0,01
Australia Government 3-Year Note September Futures	Long	09/2018	17	6	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	67	105	0,01
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 133,000 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	137	1	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 152,000 EUR auf Euro-BTP 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	146	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 160,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	72	(190)	(0,02)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 160,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	18	(38)	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	81	189	0,02
Euro-Bobl September Futures	Long	09/2018	825	396	0,04
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	146	(125)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	188	150	0,02
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	43	218	0,02
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	382	(604)	(0,06)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Schatz September Futures	Long	09/2018	415	\$ 44	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	57	111	0,01
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 131,250 EUR auf Euro-Bobl September 2018 Futures	Short	08/2018	137	3	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 156,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	18	8	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	35	7	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	178	43	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09/2018	219	676	0,07
United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate December Futures	Long	12/2018	1.000	(50)	(0,01)
United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate December Futures	Short	12/2019	1.000	49	0,01
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	13	(30)	0,00
				\$ 741	0,07

### VERKAUFSSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 119,000	27.07.2018	62	\$ (19)	\$ (6)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	120,500	27.07.2018	62	(14)	(20)	0,00
				\$ (33)	\$ (26)	0,00

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ 715 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 – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Altria Group, Inc.	(1,000) %	20.12.2020	\$ 1.700	\$ 15	0,00
BASF SE	(1,000)	20.12.2020	€ 500	2	0,00
Bayer AG	(1,000)	20.12.2020	300	0	0,00
Fortum Oyj	(1,000)	20.12.2020	100	0	0,00
Koninklijke DSM NV	(1,000)	20.12.2020	1.100	8	0,00
Pfizer, Inc.	(1,000)	20.12.2020	\$ 1.400	12	0,00
Reynolds American, Inc.	(1,000)	20.12.2020	1.700	17	0,01
Telia Co. AB	(1,000)	20.12.2020	€ 400	0	0,00
United Utilities PLC	(1,000)	20.12.2020	600	(2)	0,00
UnitedHealth Group, Inc.	(1,000)	20.12.2020	\$ 900	7	0,00
				\$ 59	0,01

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Enbridge, Inc.	1,000 %	20.12.2022	\$ 300	\$ 1	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.06.2022	1.900	74	0,01
Shell International Finance BV	1,000	20.12.2026	€ 900	50	0,01
Tesco PLC	1,000	20.06.2025	1.500	(15)	(0,01)
				\$ 110	0,01

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-29 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2022	\$ 11.900	\$ 152	0,01
CDX.IG-29 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	141.500	812	0,08
iTraxx Europe Main 26 5-Year Index	(1,000)	20.12.2021	€ 83.700	(529)	(0,05)
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	47.000	490	0,05
				\$ 925	0,09

#### 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.EM-29 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 1.700	\$ (36)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,673 %	30.04.2025	\$ 2.000	\$ (22)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,683	30.04.2025	6.300	(79)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,684	30.04.2025	1.900	(23)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,696	30.04.2025	2.000	(26)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,710	30.04.2025	2.100	(29)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,714	30.04.2025	4.500	(63)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,880	04.01.2021	BRL 37.300	(53)	(0,01)
Erhalt	3-Month CAD Bank Bill	1,850	15.09.2027	CAD 7.200	129	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CAD Bank Bill	2,300	16.07.2020	72.400	130	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month NZD-BBB	2,500	14.02.2020	NZD 134.300	168	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,750	01.04.2019	\$ 514.500	(1.732)	(0,17)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	20.06.2020	109.700	61	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.12.2026	600	28	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.12.2026	3.800	207	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,000	01.04.2020	514.500	2.178	0,22
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	47.100	96	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	9.600	(60)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	79.600	279	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	5.900	531	0,05
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,326	12.06.2022	23.800	11	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,326	19.06.2022	33.700	35	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027	1.900	96	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	10.700	(84)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.09.2019	6.300	(2)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	36.600	2.910	0,29
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,953	12.11.2049	1.600	11	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,955	12.11.2049	6.000	39	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	20.09.2020	6.300	3	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	20.06.2023	ZAR 234.800	(438)	(0,04)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	15.03.2027	20.000	28	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	19.09.2020	€ 28.700	89	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	19.12.2020	15.200	38	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	108.100	1.767	0,18
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.12.2023	37.500	379	0,04
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	33.400	702	0,07
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.12.2028	60.800	810	0,08
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.09.2048	18.300	(522)	(0,05)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	19.09.2019	£ 86.200	87	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	18.09.2020	86.200	(83)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.12.2019	68.900	132	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.09.2020	16.000	73	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	18.12.2020	68.900	(146)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	3.600	(36)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	4.600	(4)	0,00
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,500	21.03.2068	400	16	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	4.100	52	0,01
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,100	20.03.2024	¥ 7.460.000	60	0,01
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	780.000	(73)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,399	18.06.2028	210.000	(21)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	4.336.000	(100)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,000	21.03.2048	340.000	(60)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,500	21.12.2045	250.000	382	0,03
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,500	21.12.2045	110.000	(36)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,825	12.01.2023	MXN 29.700	11	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,730	25.02.2027	24.500	(21)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,740	22.02.2027	25.500	(17)	0,00
					\$ 7.808	0,78
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 8.866</b>	<b>0,89</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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 der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

## OPTIONSKAUF

### DEWISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus JPY	¥ 120,000	17.04.2020	\$ 3.148	\$ 58	\$ 19	0,00
CBK	Call - OTC USD versus CAD	CAD 1,370	17.08.2018	5.238	10	7	0,00
DUB	Call - OTC USD versus JPY	¥ 120,000	17.04.2020	1.839	33	11	0,00
GLM	Call - OTC USD versus JPY	120,000	20.04.2020	3.376	63	20	0,00
HUS	Put - OTC EUR versus USD	\$ 1,140	24.05.2019	€ 4.800	62	70	0,01
MSB	Call - OTC EUR versus USD	1,291	24.06.2021	800	49	49	0,01
	Put - OTC EUR versus USD	1,291	24.06.2021	800	58	56	0,01
SCX	Put - OTC USD versus INR	INR 69,220	25.10.2018	\$ 2.818	39	35	0,00
					\$ 372	\$ 267	0,03

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.07.2018	\$ 2.700	\$ (4)	\$ (1)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	4.700	(5)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	3.000	(4)	(3)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	1.100	(2)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Kauf	0,475	19.09.2018	€ 22.400	(11)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,750	19.09.2018	22.400	(44)	(104)	(0,01)
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	\$ 1.300	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	1.900	(3)	(2)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	1.300	(2)	0	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	1.400	(1)	(1)	0,00
					\$ (77)	\$ (114)	(0,01)	

## DEWISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC USD versus KRW	KRW 1.200,000	25.10.2018	\$ 2.818	\$ (11)	\$ (12)	0,00
CBK	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,315	14.06.2019	£ 3.039	(96)	(93)	(0,01)
	Call - OTC GBP versus USD	1,440	14.06.2019	3.080	(45)	(35)	(0,01)
	Put - OTC USD versus CAD	CAD 1,305	17.08.2018	\$ 3.492	(27)	(27)	0,00
HUS	Call - OTC EUR versus USD	\$ 1,270	24.05.2019	€ 4.800	(66)	(51)	(0,01)
JPM	Put - OTC AUD versus CAD	CAD 0,961	29.06.2018	AUD 513	0	0	0,00
					\$ (245)	\$ (218)	(0,03)

## INFLATIONSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Floor - OTC CPURNSA	\$ 217,965	Maximal [(1 + 0,000 %) <sup>10</sup> - (Index Final/Index Initial)] oder 0	29.09.2020	\$ 1.300	\$ (17)	\$ 0	0,00

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – 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	Japan Government International Bond	(1,000) %	20.06.2022	\$ 500	\$ (17)	\$ 1	\$ (16)	0,00
BPS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	1.900	(68)	8	(60)	(0,01)
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	3.100	(76)	3	(73)	(0,01)
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.600	(31)	8	(23)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	2.600	(91)	9	(82)	(0,01)
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.200	(28)	0	(28)	0,00
CBK	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	3.400	(121)	13	(108)	(0,01)
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.900	(56)	14	(42)	0,00
HUS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	3.300	(115)	11	(104)	(0,01)
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.500	(38)	3	(35)	0,00
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.100	(50)	1	(49)	(0,01)
					\$ (691)	\$ 71	\$ (620)	(0,06)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	iTraxx Europe Subordinated 27 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2022	€ 2.900	\$ 152	\$ (99)	\$ 53	0,01

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds 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
BPS	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,362 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	26.09.2027	AUD 5.100	\$ 4.043	\$ 26	\$ (303)	\$ (277)	(0,03)
	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,368 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	05.10.2027	3.000	2.363	(4)	(144)	(148)	(0,01)
DUB	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month GBP-LIBOR abzgl. 0,055 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	13.10.2026	GBP 1.700	2.074	(1)	146	145	0,01
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,368 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	06.10.2027	AUD 1.086	849	1	(48)	(47)	(0,01)
RYL	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month GBP-LIBOR abzgl. 0,055 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	13.10.2026	GBP 1.900	2.318	52	109	161	0,02
						\$ 74	\$ (240)	\$ (166)	(0,02)

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(2,030) %	10.07.2027	KRW 3.065.500	\$ 0	\$ 38	\$ 38	0,01
JPM	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	(2,005) %	10.07.2027	9.393.100	0	135	135	0,01
						\$ 0	\$ 173	\$ 173	0,02

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettoerwertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07/2018	ARS 16.041	\$ 577	\$ 21	\$ 0	\$ 21	0,00
	07/2018	DKK 151.498	25.267	1.527	0	1.527	0,15
	07/2018	£ 5.279	7.049	79	0	79	0,01
	07/2018	¥ 150.000	1.425	71	0	71	0,01
	07/2018	KRW 1.745.240	1.606	38	0	38	0,00
	07/2018	NOK 58.085	7.126	0	0	0	0,00
	07/2018	TRY 32.633	6.999	0	(70)	(70)	(0,01)
	07/2018	\$ 569	ARS 16.041	0	(21)	(21)	0,00
	07/2018	20.220	AUD 27.390	18	0	18	0,00
	07/2018	10.319	€ 8.785	0	(63)	(63)	(0,01)
	08/2018	ARS 9.370	\$ 435	124	0	124	0,01
	08/2018	AUD 27.390	20.221	0	(18)	(18)	0,00
	08/2018	\$ 640	AUD 816	0	(37)	(37)	0,00
	08/2018	1.568	BRL 6.010	0	(12)	(12)	0,00
	08/2018	2.437	CZK 51.110	0	(139)	(139)	(0,01)
	08/2018	ZAR 3.247	\$ 247	11	0	11	0,00
	09/2018	ARS 4.595	209	60	0	60	0,01
	09/2018	SGD 16.286	12.264	301	0	301	0,03
BPS	07/2018	ARS 8.889	336	32	0	32	0,00
	07/2018	¥ 8.274.073	76.182	1.482	0	1.482	0,15

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens		
	07/2018	\$	1.037	£	779	\$	0	(8)	0,00
	08/2018	RON	6.125	\$	1.550		20	0	0,00
	08/2018	\$	431	AUD	552		0	(23)	0,00
	09/2018	TWD	362.638	\$	12.342		385	0	0,04
	10/2018	KRW	313.294		282		0	(1)	0,00
BRC	07/2018	ARS	24.755		913		68	0	0,01
	09/2018	\$	2.456	INR	169.783		0	(3)	0,00
CBK	07/2018	ARS	4.445	\$	155		4	0	0,00
	07/2018	CAD	47.105		36.183		374	0	0,04
	07/2018	£	44.379		58.935		343	0	0,03
	07/2018	\$	15	ARS	379		0	(2)	0,00
	07/2018		691	CAD	900		0	(7)	0,00
	07/2018		2.404	COP	6.890.638		0	(60)	(0,01)
	07/2018		2.477	£	1.880		6	0	0,00
	07/2018		282	RUB	17.843		2	0	0,00
	07/2018		767	TRY	3.509		0	(7)	0,00
	08/2018	CZK	51.689	\$	2.362		38	0	0,00
	08/2018	\$	87	ARS	1.797		0	(28)	0,00
	08/2018		1.886	CAD	2.483		4	0	0,00
	08/2018		10.310	MXN	201.247		0	(159)	(0,02)
	09/2018	¥	1.240.000	\$	11.310		55	0	0,01
	09/2018	\$	811	CNH	5.398		1	0	0,00
	10/2018		154	ARS	4.630		0	(8)	0,00
	02/2019	€	3.388	\$	4.288		262	0	0,03
DUB	06/2019	£	1.069		1.433		0	(2)	0,00
	07/2018	BRL	5.980		1.696		142	0	0,01
	07/2018	COP	1.644.381		603		43	0	0,00
	07/2018	\$	575	ARS	16.041		0	(19)	0,00
	07/2018		1.552	BRL	5.980		2	0	0,00
	07/2018		539	COP	1.542.006		0	(14)	0,00
	01/2019		2.641	€	2.100		0	(149)	(0,01)
	03/2019	BRL	4.431	\$	1.158		33	0	0,00
	03/2019	\$	985	MXN	21.132		49	0	0,00
FBF	04/2019	SEK	4.017	€	390		6	0	0,00
	07/2018	COP	179.817	\$	66		5	0	0,00
GLM	07/2018	KRW	773.212		711		16	0	0,00
	07/2018	ARS	1.629		57		2	0	0,00
	07/2018	AUD	23.914		17.978		308	0	0,03
	07/2018	BRL	5.203		1.365		13	0	0,00
	07/2018	CAD	1.471	AUD	1.522		6	0	0,00
	07/2018		615	\$	462		0	(6)	0,00
	07/2018	CHF	5.048		5.101		17	0	0,00
	07/2018	€	2.116		2.498		27	0	0,00
	07/2018	¥	65.400		597		7	0	0,00
	07/2018	KRW	2.131.261		1.923		8	0	0,00
	07/2018	SEK	66.400		7.583		161	0	0,02
	07/2018	\$	2.263	BRL	8.677		0	(8)	0,00
	07/2018		1.535	€	1.314		0	(1)	0,00
	07/2018		490	SEK	4.290		0	(10)	0,00
	08/2018	BRL	8.677	\$	2.257		10	0	0,00
	08/2018	RON	6.239		1.571		12	0	0,00
	09/2018		6.845	€	1.455		0	0	0,00
	07/2018	ARS	9.464	\$	382		58	0	0,01
	07/2018	BRL	11.960		3.154		48	(2)	0,00
	07/2018	DKK	1.490		249		15	0	0,00
	07/2018	KRW	1.283.197		1.162		9	0	0,00
	07/2018	RUB	327.244		5.192		0	(23)	0,00
	07/2018	\$	13	ARS	329		0	(1)	0,00
	07/2018		6.878	BRL	25.627		0	(217)	(0,02)
	07/2018		34.458	CAD	45.847		394	0	0,04
	07/2018		1.380	€	1.182		0	0	0,00
	07/2018		535	£	400		0	(7)	0,00
	07/2018		4.840	RUB	309.401		90	0	0,01
	08/2018	ARS	2.380	\$	110		31	0	0,00
	08/2018	CAD	45.847		34.478		0	(393)	(0,04)
	08/2018	MXN	63.415		3.256		57	0	0,01
	08/2018	\$	180	ARS	3.724		0	(58)	(0,01)
	08/2018		9.786	RUB	615.910		23	(40)	0,00
	08/2018		317	ZAR	4.431		5	0	0,00
	09/2018	CNY	29.094	\$	4.542		169	0	0,02
	09/2018	\$	594	CNH	3.824		0	(18)	0,00
	10/2018		22	ARS	660		0	(1)	0,00
	12/2018	€	2.878	\$	3.601		197	0	0,02
	01/2019		2.190		2.632		33	0	0,00
	03/2019	BRL	1.485		440		63	0	0,01
	03/2019	\$	440	MXN	8.666		0	(16)	0,00
	05/2019		2.403	€	1.990		0	(15)	0,00
IND	08/2018	ZAR	4.443	\$	351		28	0	0,00
JPM	07/2018	ARS	8.127		309		30	0	0,00
	07/2018	BRL	8.677		2.328		73	0	0,01
	07/2018	CAD	3.051		2.287		0	(32)	0,00
	07/2018	£	6.841		9.062		42	(12)	0,00
	07/2018	NZD	1.183		833		32	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
	07/2018	\$ 3.730	CAD 4.949	\$ 33	\$ 0	\$ 33	0,00
	07/2018	5.095	CHF 5.048	0	(11)	(11)	0,00
	07/2018	5.717	NOK 47.395	98	0	98	0,01
	08/2018	CHF 5.048	\$ 5.108	11	0	11	0,00
	09/2018	¥ 4.180.000	38.481	577	0	577	0,06
	09/2018	RON 542	€ 115	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 2.740	ARS 73.661	0	(335)	(335)	(0,03)
	09/2018	1	INR 69	0	0	0	0,00
MSB	04/2019	€ 759	SEK 7.785	0	(16)	(16)	0,00
	07/2018	ARS 3.858	\$ 137	5	0	5	0,00
	07/2018	AUD 3.476	2.625	57	0	57	0,01
	07/2018	BRL 8.464	2.246	46	0	46	0,00
	07/2018	CAD 3.976	3.065	42	0	42	0,00
	07/2018	€ 2.004	2.314	0	(26)	(26)	0,00
	07/2018	PLN 12.428	3.657	337	0	337	0,03
	08/2018	\$ 112	ARS 2.330	0	(35)	(35)	0,00
	08/2018	2.240	BRL 8.464	0	(48)	(48)	0,00
	06/2021	69	€ 54	0	0	0	0,00
NGF	07/2018	ARS 1.802	\$ 63	2	0	2	0,00
	07/2018	KRW 1.927.832	1.741	9	0	9	0,00
	07/2018	\$ 3.110	INR 212.708	0	(12)	(12)	0,00
	09/2018	23.827	CNH 152.133	0	(936)	(936)	(0,09)
RYL	09/2018	2.432	INR 166.580	0	(25)	(25)	0,00
	07/2018	2.366	€ 2.000	0	(31)	(31)	0,00
SCX	04/2019	SEK 5.455	525	3	0	3	0,00
	07/2018	\$ 118	COP 337.480	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	28.474	DKK 181.675	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	1.311	NOK 10.690	1	0	1	0,00
	07/2018	49.357	SEK 439.498	0	(229)	(229)	(0,02)
	08/2018	NOK 10.690	\$ 1.313	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	SEK 439.498	49.469	233	0	233	0,02
	08/2018	\$ 618	AUD 793	0	(32)	(32)	0,00
	08/2018	6.706	TRY 29.951	0	(288)	(288)	(0,03)
	09/2018	IDR 12.832.164	\$ 895	9	0	9	0,00
	09/2018	KRW 472.035	439	14	0	14	0,00
	09/2018	TWD 17.284	568	0	(2)	(2)	0,00
	09/2018	\$ 299	CNH 1.912	0	(11)	(11)	0,00
	10/2018	DKK 181.675	\$ 28.682	9	0	9	0,00
SOG	10/2018	INR 107.672	1.556	8	0	8	0,00
	07/2018	SEK 377.388	42.357	172	0	172	0,02
	08/2018	\$ 126	ARS 2.621	0	(40)	(40)	0,00
SSB	12/2018	1.653	€ 1.311	0	(101)	(101)	(0,01)
TOR	09/2018	SGD 752	\$ 551	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 313	€ 270	2	0	2	0,00
	07/2018	¥ 75.903	8.339.473	0	(613)	(613)	(0,06)
UAG	08/2018	¥ 8.339.473	\$ 76.059	619	0	619	0,06
	07/2018	DKK 34.149	5.694	343	0	343	0,03
	07/2018	€ 146.740	169.962	0	(1.364)	(1.364)	(0,14)
	07/2018	¥ 540.000	5.080	203	0	203	0,02
	07/2018	PLN 662	198	21	0	21	0,00
	07/2018	\$ 751	DKK 4.525	0	(42)	(42)	0,00
	07/2018	159.436	€ 137.309	879	0	879	0,09
	07/2018	73.266	£ 55.410	0	(111)	(111)	(0,01)
	08/2018	€ 137.309	\$ 159.792	0	(871)	(871)	(0,09)
	08/2018	£ 55.410	73.370	115	0	115	0,01
	08/2018	\$ 4.248	MXN 83.118	0	(55)	(55)	(0,01)
	09/2018	938	IDR 13.359.907	0	(15)	(15)	0,00
				\$ 11.438	\$ (6.969)	\$ 4.469	0,45

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional EUR (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 21.287	€ 18.135	\$ 0	\$ (115)	\$ (115)	(0,01)
BPS	07/2018	18.535	15.980	123	0	123	0,01
BRC	07/2018	€ 4	\$ 5	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	17	20	0	0	0	0,00
GLM	07/2018	9	11	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 4.518	€ 3.892	26	0	26	0,00
MSB	07/2018	€ 20.941	\$ 24.186	0	(263)	(263)	(0,03)
	07/2018	\$ 2.400	€ 2.045	0	(13)	(13)	0,00
	08/2018	24.240	20.941	263	0	263	0,03
RBC	07/2018	292	251	1	0	1	0,00
RYL	07/2018	352	301	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2018	€ 2.096	\$ 2.472	25	0	25	0,00
	07/2018	\$ 219	€ 188	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	€ 20.919	\$ 24.351	0	(72)	(72)	(0,01)
	07/2018	\$ 21.059	€ 18.098	71	0	71	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	08/2018	\$ 24.405	€ 20.919	\$ 71	\$ 0	\$ 71	0,01
UAG	07/2018	6.975	5.973	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 80	\$ (466)	\$ 114	0,01

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Class E USD (Currency Exposure) 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	07/2018	AUD 2.333	\$ 1.722	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07/2018	€ 6.060	6.999	0	(76)	(76)	(0,01)
	07/2018	¥ 8.435	76	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 20.898	¥ 2.271.597	0	(389)	(389)	(0,04)
	08/2018	1.722	AUD 2.333	2	0	2	0,00
	08/2018	7.014	€ 6.060	76	0	76	0,01
	08/2018	114	ILS 411	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	18	ZAR 225	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	176	SGD 234	0	(4)	(4)	0,00
	BRC	07/2018	£ 4.880	\$ 6.381	0	(61)	(61)
07/2018		RUB 9.232	147	0	0	0	0,00
08/2018		\$ 6.390	£ 4.880	61	0	61	0,01
08/2018		146	RUB 9.232	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	€ 48	\$ 55	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 3.247	CAD 4.227	0	(34)	(34)	0,00
	07/2018	442	DKK 2.659	0	(26)	(26)	0,00
	07/2018	43	€ 37	1	0	1	0,00
GLM	07/2018	6.034	£ 4.555	0	(21)	(21)	0,00
	07/2018	793	¥ 87.030	0	(7)	(7)	0,00
	07/2018	146	RUB 9.232	1	0	1	0,00
	08/2018	370	MXN 7.112	0	(11)	(11)	0,00
	07/2018	CHF 784	\$ 785	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	\$ 1.754	AUD 2.333	0	(30)	(30)	0,00
	07/2018	792	CHF 784	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	62	€ 53	0	0	0	0,00
	07/2018	119	£ 89	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	521	SEK 4.591	0	(8)	(8)	0,00
MSB	08/2018	787	CHF 784	4	0	4	0,00
	08/2018	102	HUF 26.688	0	(7)	(7)	0,00
	07/2018	€ 893	\$ 1.031	0	(11)	(11)	0,00
	07/2018	¥ 2.345.995	21.260	80	0	80	0,01
	07/2018	\$ 301	PLN 1.022	0	(28)	(28)	0,00
	08/2018	1.034	€ 893	11	0	11	0,00
	08/2018	21.303	¥ 2.345.995	0	(81)	(81)	(0,01)
	09/2018	363	MYR 1.453	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	CAD 4.309	\$ 3.240	0	(36)	(36)	(0,01)
	08/2018	\$ 3.242	CAD 4.309	36	0	36	0,00
RYL	07/2018	€ 249	\$ 291	0	0	0	0,00
	07/2018	96	112	0	0	0	0,00
	07/2018	¥ 4.197	38	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 63	CAD 82	0	(1)	(1)	0,00
SSB	07/2018	22.937	€ 19.785	173	(10)	163	0,01
	07/2018	42	¥ 4.615	0	0	0	0,00
	07/2018	132	NZD 188	0	(5)	(5)	0,00
	09/2018	1.633	KRW 1.755.825	0	(54)	(54)	(0,01)
	07/2018	€ 19.870	\$ 23.130	0	(69)	(69)	(0,01)
	07/2018	\$ 8.499	€ 7.340	71	0	71	0,01
	07/2018	317	£ 236	0	(6)	(6)	0,00
	07/2018	95	NOK 777	0	0	0	0,00
	08/2018	23.182	€ 19.870	68	0	68	0,01
					\$ 584	\$ (992)	\$ (408)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ 3.550</b>	<b>0,36</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>\$ 1.182.370</b>	<b>118,53</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>\$ (184.835)</b>	<b>(18,53)</b>
<b>Nettovermogen</b>						<b>\$ 997.535</b>	<b>100,00</b>

### ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit 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) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 81.845 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 18.613 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 1.490 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 2.484	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.01.2022	\$ (2.536)	\$ 2.484	\$ 2.484	0,25
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (2.536)</b>	<b>\$ 2.484</b>	<b>\$ 2.484</b>	<b>0,25</b>

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

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 18.076	\$ 1.151.163	\$ 0	\$ 1.169.239
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	715	12.416	0	13.131
<b>Summen</b>	<b>\$ 18.791</b>	<b>\$ 1.163.579</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 1.182.370</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 32.858	\$ 1.053.607	\$ 834	\$ 1.087.299
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(823)	1.044	(1)	220
<b>Summen</b>	<b>\$ 32.035</b>	<b>\$ 1.054.651</b>	<b>\$ 833</b>	<b>\$ 1.087.519</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 der Wertpapieranlagen.

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:**

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	2,170 %	12.06.2018	12.07.2018	\$ (5.900)	\$ (5.907)	(0,59)
		20.06.2018	05.07.2018	(5.677)	(5.681)	(0,57)
		21.06.2018	05.07.2018	(2.403)	(2.404)	(0,24)
BPS	(0,450)	19.04.2018	19.07.2018	€ (13.159)	(15.349)	(1,54)
GRE	1,920	17.04.2018	17.07.2018	\$ (11.711)	(11.757)	(1,18)
	2,170	18.06.2018	18.07.2018	(8.231)	(8.237)	(0,83)
IND	0,650	02.05.2018	05.07.2018	£ (23.925)	(31.622)	(3,17)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (80.957)</b>	<b>(8,12)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 1.382	\$ (1.640)	\$ (258)
BPS	1.526	(1.400)	126
BRC	(173)	140	(33)
CBK	460	(850)	(390)
DUB	249	(70)	179
FBF	21	0	21
GLM	543	(660)	(117)
GST	(146)	0	(146)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
HUS	\$ 385	\$ (380)	\$ 5
IND	28	0	28
JPM	575	(510)	65
MSB	437	(300)	137
MYC	(47)	(185)	(232)
NGF	(962)	980	18
RBC	1	0	1
RYL	132	(15)	117
SCX	(134)	370	236
SOG	31	(400)	(369)
SSB	133	0	133
TOR	8	0	8
UAG	(899)	(640)	(1.539)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	83,59	79,11
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	25,68	36,12
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	7,94	1,53
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,07	(0,09)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,89	0,24
Freiverkehrsfinanzderivate	0,36	(0,13)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(8,12)	(9,45)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0,00	(0,25)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond Ex-US Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		
	15.965.054	\$ 159.842		16.749.855	\$ 167.700
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 23.04.2018	JPY 4.220.500	38.066	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b)	\$ 13.246	13.054
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.06.2018	2.670.000	24.951	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 28.02.2023	11.500	11.507
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.09.2018	2.670.000	24.377	Spain Government International Bond 1,500 % fällig am 30.04.2027	€ 8.900	11.062
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 30.04.2025	\$ 19.400	19.200	Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2047	DKK 42.900	7.050
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.06.2018	JPY 1.510.000	14.240	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2023 (b)	\$ 5.317	5.203
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 14.468	14.087	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,450 % fällig am 01.09.2033	€ 3.500	4.086
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 10.09.2018	JPY 1.510.000	13.813	Bank Nederlandse Gemeenten NV 0,500 % fällig am 16.04.2025	3.200	3.949
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 18.08.2018	1.240.000	11.695	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,450 % fällig am 01.03.2048	2.950	3.776
U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 28.02.2023	\$ 11.500	11.471	UnitedHealth Group, Inc. 3,750 % fällig am 15.07.2025	\$ 3.400	3.502
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 18.09.2018	JPY 1.240.000	11.249	Ireland Government International Bond 1,000 % fällig am 15.05.2026	€ 2.500	3.134
United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 22.07.2047	£ 6.900	8.448	Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN 6.100	2.414
United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 20.04.2018	5.100	7.111	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,950 % fällig am 14.02.2028	€ 1.800	2.213
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)	\$ 6.791	6.951	Canada Government International Bond 2,500 % fällig am 01.06.2024	CAD 2.700	2.177
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	JPY 540.000	5.091	Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2037	DKK 11.612	1.999
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.07.2018	540.000	5.027	Europäische Union 0,500 % fällig am 04.04.2025	€ 1.500	1.841
Saudi Government International Bond 4,500 % fällig am 17.04.2030	\$ 4.800	4.773	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,450 % fällig am 05.09.2040	1.500	1.825
QNB Finance Ltd. 3,713 % fällig am 07.02.2020	4.500	4.500	SSE PLC 0,875 % fällig am 06.09.2025	1.500	1.816
QNB Finance Ltd. 3,705 % fällig am 12.02.2020	4.300	4.300	Petrobras Global Finance BV 6,125 % fällig am 17.01.2022	\$ 1.700	1.811
Bank Nederlandse Gemeenten NV 0,500 % fällig am 16.04.2025	\$ 3.200	3.934	Slovenia Government International Bonds 1,000 % fällig am 06.03.2028	€ 1.400	1.701

(a) Der Global Bond Ex-US Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Nennbetrag des Wertpapiers wurde 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.











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>Wynn Las Vegas LLC</b>				<b>Downey Savings &amp; Loan Association Mortgage Loan Trust</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
4,250 % fällig am 30.05.2023	\$ 5.000	\$ 4.769	0,12	2,395 % fällig am 19.10.2036 ^	\$ 478	\$ 363	0,01	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (I)</b>			
5,250 % fällig am 15.05.2027	8.000	7.490	0,19	<b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>					3.785	0,09	
5,500 % fällig am 01.03.2025	7.000	6.895	0,17	2,215 % fällig am 19.03.2037	159	153	0,00	Summe kurzfristige Instrumente	3.785	0,09	
<b>XPO Logistics, Inc.</b>				<b>Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust</b>							
6,125 % fällig am 01.09.2023	3.000	3.090	0,08	4,178 % fällig am 25.02.2036 ^	253	234	0,01	<b>AKTIEN</b>			
6,500 % fällig am 15.06.2022	1.000	1.026	0,03	<b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>				<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
<b>Yum! Brands, Inc.</b>				2,328 % fällig am 25.04.2047 ^	13	0	0,00	<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. -</b>			
6,875 % fällig am 15.11.2037	2.000	1.980	0,05	2,398 % fällig am 25.05.2047 ^	77	20	0,00	<b>PIMCO US Dollar Short-Term</b>			
<b>Zayo Group LLC</b>				2,528 % fällig am 25.05.2046 ^	158	139	0,00	<b>Floating NAV Fund (e)</b>	19.532.788	195.582	4,86
5,750 % fällig am 15.01.2027	9.675	9.530	0,24					Summe Übertragbare Wertpapiere und			
6,375 % fällig am 15.05.2025	3.000	3.068	0,08			984	0,02	Geldmarktinstrumente – Amtliche			
		2.452.462	60,88					Börse/Geregelter Markt	\$ 4.006.473	99,45	
				<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>							
<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Pinnacle Agriculture Holdings LLC</b>							
<b>Illinois Finance Authority Revenue Notes, Series 2007</b>				3,000 (g)	885.169	415	0,01				
9,000 % fällig am 01.03.2014 ^	250	60	0,00	Summe USA		2.453.921	60,91				
<b>NON-AGENCY-MBS</b>											
<b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>											
3,785 % fällig am 25.03.2036 ^	87	75	0,00								

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.

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 119.000	27.07.2018	552	\$ (156)	\$ (52)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	120.500	27.07.2018	552	(170)	(181)	(0,01)
				\$ (326)	\$ (233)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (233)	(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 KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.HY-29 5-Year Index	5,000 %	20.12.2022	\$ 30.000	\$ (598)	(0,02)
CDX.HY-30 5-Year Index	5,000	20.06.2023	65.000	(499)	(0,01)
				\$ (1.097)	(0,03)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ (1.097)	(0,03)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

#### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend)

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

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950 %	18.07.2018	\$ 4.000	\$ (7)	\$ (1)	0,00
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	5.800	(6)	(1)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	5.400	(9)	(1)	0,00
JPM	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	103.000	18.07.2018	25.900	(149)	(35)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	2.300	(2)	(1)	0,00
						\$ (173)	\$ (39)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlt/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
BOA	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 10.000	20.12.2018	\$ (9)	\$ (156)	\$ (165)	0,00
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	20.000	20.03.2019	(105)	(117)	(222)	(0,01)
CBK	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	30.000	20.03.2019	(158)	(175)	(333)	(0,01)
GST	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	10.000	20.09.2018	(10)	131	121	0,00
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	25.000	20.12.2018	(2)	(133)	(135)	0,00
							\$ (284)	\$ (450)	\$ (734)	(0,02)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07/2018	\$ 15.195	€ 12.963	\$ 0	\$ (60)	\$ (60)	0,00
BPS	07/2018	€ 316.856	\$ 367.816	0	(2.129)	(2.129)	(0,05)
BRC	07/2018	2.989	3.454	0	(35)	(35)	0,00
CBK	07/2018	£ 96.910	128.394	448	0	448	0,01
GLM	07/2018	€ 480	566	6	0	6	0,00
	07/2018	\$ 1.778	CHF 1.756	0	(9)	(9)	0,00
	07/2018	10.083	€ 8.546	2	(108)	(106)	0,00
	07/2018	10.617	£ 7.989	0	(70)	(70)	0,00
HUS	07/2018	£ 68	\$ 89	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 1.390	€ 1.199	10	0	10	0,00
	07/2018	2.972	£ 2.248	2	(6)	(4)	0,00
JPM	07/2018	€ 2.781	\$ 3.292	45	0	45	0,00
	07/2018	\$ 4.499	€ 3.843	7	(20)	(13)	0,00
	07/2018	1.339	£ 1.006	0	(11)	(11)	0,00
MSB	07/2018	13.522	€ 11.712	153	0	153	0,00
SCX	07/2018	4.011	£ 2.999	0	(51)	(51)	0,00
TOR	07/2018	€ 99.868	\$ 115.733	0	(869)	(869)	(0,02)
UAG	07/2018	\$ 448.100	€ 385.911	2.470	0	2.470	0,06
	07/2018	109.864	£ 83.088	0	(166)	(166)	0,00
	08/2018	€ 385.911	\$ 449.102	0	(2.447)	(2.447)	(0,06)
	08/2018	£ 83.088	110.019	173	0	173	0,00
				\$ 3.316	\$ (5.981)	\$ (2.665)	(0,06)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07/2018	CHF 32	\$ 33	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2018	\$ 15.195	CHF 14.965	0	(124)	(124)	(0,01)
CBK	07/2018	CHF 90	\$ 90	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 15.230	CHF 15.043	0	(80)	(80)	0,00
GLM	07/2018	CHF 15.169	\$ 15.198	0	(79)	(79)	0,00
	07/2018	\$ 15.310	CHF 15.151	0	(52)	(52)	0,00
	08/2018	15.236	CHF 15.169	79	0	79	0,00
JPM	07/2018	CHF 15.095	\$ 15.234	32	0	32	0,00
	08/2018	\$ 15.273	CHF 15.095	0	(33)	(33)	0,00
				\$ 111	\$ (368)	\$ (257)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07/2018	\$ 509.484	€ 434.030	\$ 0	\$ (2.732)	\$ (2.732)	(0,07)
BRC	07/2018	€ 3.849	\$ 4.512	32	(14)	18	0,00
CBK	07/2018	2.219	2.603	19	(7)	12	0,00
	07/2018	\$ 2.721	€ 2.339	10	0	10	0,00
GLM	07/2018	€ 2.838	\$ 3.313	7	(8)	(1)	0,00
MSB	07/2018	490.118	€ 566.086	0	(6.151)	(6.151)	(0,15)
	08/2018	\$ 567.334	€ 490.118	6.146	0	6.146	0,15
RBC	07/2018	€ 6.506	\$ 7.545	0	(51)	(51)	0,00
RYL	07/2018	17.614	20.632	70	(4)	66	0,00
SCX	07/2018	12.767	14.923	18	(1)	17	0,00
	07/2018	\$ 514.629	€ 444.152	3.998	(57)	3.941	0,10
SSB	07/2018	€ 430.810	\$ 501.506	0	(1.486)	(1.486)	(0,04)
	07/2018	\$ 512.329	€ 440.276	1.715	0	1.715	0,04
	08/2018	502.619	430.810	1.466	0	1.466	0,04
				\$ 13.481	\$ (10.511)	\$ 2.970	0,07

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Administrative GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged) und Class R GBP (Hedged) 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	07/2018	£ 549	\$ 737	\$ 13	\$ 0	\$ 13	0,00
BOA	07/2018	\$ 275.302	£ 206.184	0	(3.087)	(3.087)	(0,07)
BPS	07/2018	£ 11.478	\$ 15.121	4	(37)	(33)	0,00
BRC	07/2018	202.330	264.602	6	(2.529)	(2.523)	(0,06)
	07/2018	\$ 127	£ 95	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	262.954	200.808	2.523	0	2.523	0,06
CBK	07/2018	274.313	207.048	0	(958)	(958)	(0,02)
GLM	07/2018	£ 10.809	\$ 14.389	124	(6)	118	0,00
RYL	07/2018	259	342	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	12	16	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 274.171	£ 206.239	0	(1.884)	(1.884)	(0,05)
SSB	07/2018	£ 737	\$ 983	11	0	11	0,00
	07/2018	£ 849	£ 634	0	(12)	(12)	0,00
UAG	07/2018	£ 199.510	\$ 263.803	399	0	399	0,01
	08/2018	\$ 264.177	£ 199.510	0	(416)	(416)	(0,01)
				\$ 3.080	\$ (8.931)	\$ (5.851)	(0,14)

Zum 30. Juni 2018 standen für die E SGD (Hedged) Class 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	09/2018	\$ 768	SGD 1.020	\$ 0	\$ (19)	\$ (19)	0,00
CBK	09/2018	SGD 11	\$ 8	0	0	0	0,00
GLM	09/2018	10	7	0	0	0	0,00
HUS	09/2018	2	2	0	0	0	0,00
NGF	09/2018	\$ 190	SGD 255	0	(3)	(3)	0,00
UAG	09/2018	638	850	0	(13)	(13)	0,00
				\$ 0	\$ (35)	\$ (35)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (6.611)	(0,16)
Summe Anlagen						\$ 3.998.532	99,25
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 30.090	0,75
Nettovermögen						\$ 4.028.622	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) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(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:

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Afren PLC 15,000 % fällig am 25.04.2049	30.04.2015	\$ 4.820	\$ 549	0,01
Bibby Offshore Services PLC	15.01.2018 - 17.01.2018	1.700	2.308	0,06
NVHL S.A. 'A' 15.03.2012	15.03.2012	161	60	0,01
NVHL S.A. 'B' 15.03.2012	15.03.2012	162	60	0,01
NVHL S.A. 'C' 15.03.2012	15.03.2012	162	60	0,00
NVHL S.A. 'D' 15.03.2012	15.03.2012	162	60	0,00
NVHL S.A. 'E' 15.03.2012	15.03.2012	162	60	0,00
NVHL S.A. 'F' 15.03.2012	15.03.2012	162	60	0,00
NVHL S.A. 'G' 15.03.2012	15.03.2012	162	60	0,00
NVHL S.A. 'H' 15.03.2012	15.03.2012	162	60	0,00
NVHL S.A. 'I' 15.03.2012	15.03.2012	162	60	0,00
NVHL S.A. 'J' 15.03.2012	15.03.2012	162	60	0,00
Pinnacle Agriculture Holdings LLC 3,000 %	10.03.2017	885	415	0,01
		\$ 9.024	\$ 3.872	0,10

(h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 40.594 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 5.324 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 24.300 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

### (i) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 3.785	U.S.Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	\$ (3.862)	\$ 3.785	\$ 3.785	0,09
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (3.862)</b>	<b>\$ 3.785</b>	<b>\$ 3.785</b>	<b>0,09</b>

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 360.252	\$ 3.642.147	\$ 4.074	\$ 4.006.473
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(233)	(7.708)	0	(7.941)
<b>Summen</b>	<b>\$ 360.019</b>	<b>\$ 3.634.439</b>	<b>\$ 4.074</b>	<b>\$ 3.998.532</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 431.467	\$ 4.848.959	\$ 1.191	\$ 5.281.617
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	26.228	0	26.228
<b>Summen</b>	<b>\$ 431.467</b>	<b>\$ 4.875.187</b>	<b>\$ 1.191</b>	<b>\$ 5.307.845</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 der Wertpapieranlagen.

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

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BCY	(0,250) %	01.02.2018	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (3.484)	\$ (3.480)	(0,09)
	(0,250)	23.03.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(597)	(597)	(0,01)
	(0,100)	31.01.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(3.664)	(3.662)	(0,09)
	0,000	18.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(3.971)	(3.973)	(0,10)
	0,250	25.05.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(4.629)	(4.630)	(0,11)
	0,375	28.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(1.550)	(1.550)	(0,04)
	0,750	28.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(2.301)	(2.301)	(0,06)
	0,850	15.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(2.393)	(2.394)	(0,06)
	0,950	18.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(2.498)	(2.499)	(0,06)
	0,950	25.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(3.801)	(3.802)	(0,09)
	1,550	18.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(3.447)	(3.449)	(0,09)
	2,000	12.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(2.712)	(2.709)	(0,07)
	1,150	19.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	€ (2.188)	(2.553)	(0,06)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (37.599)</b>	<b>(0,93)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 13	\$ 0	\$ 13
BOA	(6.409)	14.500	8.091
BPS	(2.162)	(680)	(2.842)
BRC	(20)	0	(20)
CBK	(902)	2.160	1.258
DUB	(1)	0	(1)
GLM	(114)	0	(114)
GST	(14)	(20)	(34)
HUS	6	0	6
JPM	(16)	0	(16)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
MSB	\$ 148	\$ 0	\$ 148
NGF	(3)	0	(3)
RBC	(51)	0	(51)
RYL	66	(250)	(184)
SCX	2.023	4.320	6.343
SSB	1.694	3.320	5.014
TOR	(869)	0	(869)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	44,48	55,34
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	49,80	40,40
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	5,17	2,98
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	0,08
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,16)	0,41
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,93)	(0,76)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global High Yield Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	101.674.417	\$ 1.017.976	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	125.230.528	\$ 1.253.800
PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)	1.623.000	164.997			
		<b>PARI (000S)</b>		<b>PARI (000S)</b>	
<b>Sunshine Mid BV</b>			<b>Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.</b>		
6,500 % fällig am 15.05.2026	€ 11.900	14.414	6,625 % fällig am 15.05.2022	\$ 20.000	19.794
<b>Japan Treasury Bills</b>			<b>ZF North America Capital, Inc.</b>		
0,000 % fällig am 23.04.2018	JPY 1.290.000	11.631	4,750 % fällig am 29.04.2025	13.700	13.879
<b>Sigma Holdco BV</b>			<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b>		
5,750 % fällig am 15.05.2026	€ 9.500	11.564	7,000 % fällig am 19.02.2019	€ 10.000	13.043
<b>CF Industries, Inc.</b>			<b>Unitymedia GmbH</b>		
5,150 % fällig am 15.03.2034	\$ 10.000	10.125	3,750 % fällig am 15.01.2027	10.000	12.665
<b>Pisces Midco Inc</b>			<b>SIG Combibloc Holdings S.C.A.</b>		
8,000 % fällig am 15.04.2026	9.500	9.500	7,750 % fällig am 15.02.2023	10.000	12.601
<b>Scientific Games International Inc</b>			<b>KLX, Inc.</b>		
3,375 % fällig am 15.02.2026	€ 6.750	8.391	5,875 % fällig am 01.12.2022	\$ 11.750	12.230
<b>Viking Cruises Ltd.</b>			<b>Verisure Holding AB</b>		
5,875 % fällig am 15.09.2027	\$ 7.350	7.524	6,000 % fällig am 01.11.2022	€ 9.000	11.503
<b>Jeld-Wen, Inc.</b>			<b>Intesa Sanpaolo SpA</b>		
4,875 % fällig am 15.12.2027	7.500	7.153	7,750 % fällig am 11.01.2027	7.000	10.282
<b>Valeant Pharmaceuticals International</b>			<b>Springs Industries, Inc.</b>		
9,250 % fällig am 01.04.2026	6.750	6.750	6,250 % fällig am 01.06.2021	\$ 10.000	10.163
<b>Jeld-Wen, Inc.</b>			<b>Auris Luxembourg S.A.</b>		
4,625 % fällig am 15.12.2025	7.000	6.710	8,000 % fällig am 15.01.2023	€ 6.750	8.469
<b>Hologic, Inc.</b>			<b>Hexion, Inc.</b>		
4,375 % fällig am 15.10.2025	6.325	6.325	6,625 % fällig am 15.04.2020	\$ 8.750	8.178
<b>Chemours Co.</b>			<b>ZF North America Capital, Inc.</b>		
4,000 % fällig am 15.05.2026	€ 5.250	6.181	2,750 % fällig am 27.04.2023	€ 5.900	7.822
<b>Nexi Capital SpA</b>			<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>		
4,125 % fällig am 01.11.2023	5.000	5.938	7,375 % fällig am 24.06.2022	£ 5.000	7.820
<b>La Financiere Atalian SASU</b>			<b>Sprint Communications, Inc.</b>		
6,625 % fällig am 15.05.2025	£ 4.250	5.921	6,000 % fällig am 15.11.2022	\$ 7.500	7.569
<b>T-Mobile USA, Inc.</b>			<b>INEOS Group Holdings S.A.</b>		
4,750 % fällig am 01.02.2028	\$ 5.625	5.625	5,375 % fällig am 01.08.2024	€ 6.000	7.554
<b>Hologic Inc</b>			<b>Arqiva Broadcast Finance PLC</b>		
4,625 % fällig am 01.02.2028	5.500	5.500	9,500 % fällig am 31.03.2020	£ 5.000	7.441
<b>Nabors Industries, Inc.</b>			<b>Royal Bank of Scotland Group PLC</b>		
5,750 % fällig am 01.02.2025	5.250	5.250	7,500 % fällig am 10.08.2020	\$ 7.000	7.219
<b>WildHorse Resource Development Corp.</b>			<b>Carrizo Oil &amp; Gas, Inc.</b>		
6,875 % fällig am 01.02.2025	5.000	5.198	6,250 % fällig am 15.04.2023	7.000	7.169
			<b>Continental Resources, Inc.</b>		
			5,000 % fällig am 15.09.2022	7.000	7.116

(a) Der Global High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund

30. Juni 2018

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 UND GELDDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>Woolworths Group Ltd.</b>				<b>Petrobras Global Finance BV</b>			
25,980 % fällig am 26.04.2020 ARS 377.000 \$ 10.801 0,06				4,550 % fällig am 12.04.2021 \$ 1.800 \$ 1.846 0,01				5,999 % fällig am 27.01.2028 \$ 53.205 \$ 48.244 0,25			
2,260 % fällig am 31.12.2038 € 14.200 9.823 0,05								6,125 % fällig am 17.01.2022 3.665 3.736 0,02			
5,250 % fällig am 15.01.2028 21.300 21.439 0,11								6,250 % fällig am 14.12.2026 £ 200 267 0,00			
5,875 % fällig am 11.01.2028 \$ 3.400 2.773 0,02								6,250 % fällig am 16.01.2034 \$ 150 193 0,00			
6,250 % fällig am 09.11.2047 € 5.000 4.569 0,02								7,375 % fällig am 17.01.2027 \$ 11.500 11.514 0,06			
6,875 % fällig am 26.01.2027 \$ 46.034 40.682 0,22								5,750 % fällig am 14.07.2026 5.000 5.070 0,03			
7,500 % fällig am 22.04.2026 ARS 15.250 14.125 0,08								7,000 % fällig am 16.03.2047 7.600 7.856 0,04			
21,200 % fällig am 19.09.2018 ARS 5.626 189 0,00								4,375 % fällig am 11.01.2022 6.468 6.562 0,04			
22,844 % fällig am 04.10.2022 7.500 397 0,00								6,250 % fällig am 10.08.2026 29.389 31.902 0,17			
34,188 % fällig am 03.04.2022 252.195 7.977 0,04								Summe Brasilien 214.012 1,13			
34,660 % fällig am 01.03.2020 8.200 278 0,00											
40,000 % fällig am 21.06.2020 733.147 26.495 0,14											
Summe Argentinien 174.667 0,92											
				<b>BELGIEN</b>							
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
				<b>Argentina Government International Bond</b>							
				0,010 % fällig am 15.08.2018 138.230 4.553 0,02							
				1,750 % fällig am 07.03.2025 £ 6.200 7.996 0,04							
				2,250 % fällig am 24.05.2029 10.500 13.308 0,07							
				<b>Groupe Bruxelles Lambert S.A.</b>							
				1,875 % fällig am 19.06.2025 € 6.500 7.623 0,04							
				<b>KBC Group NV</b>							
				4,250 % fällig am 24.10.2025 (g)(i) 69.600 74.560 0,40							
				Summe Belgien 103.487 0,55							
				<b>BERMUDAS</b>							
				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>							
				<b>MAPS Ltd.</b>							
				4,212 % fällig am 15.05.2043 \$ 11.254 11.313 0,06							
				<b>S-Jets Ltd.</b>							
				3,967 % fällig am 15.08.2042 20.731 20.704 0,11							
				Summe Bermudas 102.098 0,54							
				<b>BRASILIEN</b>							
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
				<b>Bacardi Ltd.</b>							
				2,750 % fällig am 03.07.2023 € 3.630 4.527 0,02							
				4,500 % fällig am 15.05.2025 \$ 21.800 21.757 0,11							
				4,500 % fällig am 15.01.2021 1.600 1.631 0,01							
				4,700 % fällig am 15.05.2028 32.000 31.534 0,17							
				<b>China Resources Gas Group Ltd.</b>							
				4,500 % fällig am 05.04.2022 1.600 1.633 0,01							
				<b>Cosan Ltd.</b>							
				5,950 % fällig am 20.09.2024 3.700 3.457 0,02							
				<b>Sompo International Holdings Ltd.</b>							
				4,700 % fällig am 15.10.2022 4.500 4.595 0,02							
				<b>Viking Cruises Ltd.</b>							
				5,875 % fällig am 15.09.2027 1.000 947 0,01							
				Summe Brasilien 130.798 0,69							
				<b>Canada Government International Bond</b>							
				2,750 % fällig am 01.12.2048 CAD 500 426 0,00							
				<b>Province of Ontario</b>							
				2,600 % fällig am 02.06.2025 161.500 122.115 0,64							
				3,150 % fällig am 02.06.2022 26.550 20.730 0,11							
				3,500 % fällig am 02.06.2024 11.400 9.082 0,05							
				<b>Province of Quebec</b>							
				3,500 % fällig am 01.12.2022 26.550 21.067 0,11							
				Summe Kanada 304.218 1,60							
				<b>CAYMAN INSELN</b>							
				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>							
				<b>Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd.</b>							
				4,213 % fällig am 16.12.2041 \$ 8.203 8.261 0,04							
				<b>Eagle Ltd.</b>							
				2,570 % fällig am 15.12.2039 797 793 0,00							
				<b>ECAF Ltd.</b>							
				4,947 % fällig am 15.06.2040 12.759 12.905 0,07							

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit 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>BESCHREIBUNG</b>				<b>CHILE</b>				<b>FINNLAND</b>			
KDAC Aviation Finance Ltd. 4,212 % fällig am 15.12.2042	\$ 8.430	\$ 8.367	0,04	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
METAL LLC 4,581 % fällig am 15.10.2042	23.268	23.686	0,13	Banco Santander Chile 3,160 % fällig am 25.07.2020	\$ 15.000	\$ 15.069	0,08	Ahlstrom-Munksjo Oyj 1,875 % fällig am 09.06.2022	€ 9.000	\$ 10.766	0,06
Sapphire Aviation Finance Ltd. 4,250 % fällig am 15.03.2040	18.115	18.290	0,10	Ceoteo Redes Operacion Chile S.A. 5,200 % fällig am 22.06.2047	3.600	3.542	0,02	Kemira Oyj 1,750 % fällig am 30.05.2024	2.300	2.772	0,01
Sprite Ltd. 4,250 % fällig am 15.12.2037	14.793	14.935	0,08	Corp. Nacional del Cobre de Chile 3,625 % fällig am 01.08.2027	16.900	16.140	0,08	Kojamo Oyj 1,500 % fällig am 19.06.2024	9.700	11.441	0,06
Thunderbolt Aircraft Lease Ltd. 4,212 % fällig am 17.05.2032	5.628	5.661	0,03	Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A. 4,875 % fällig am 30.10.2024	4.000	3.986	0,02	Stora Enso Oyj 2,500 % fällig am 21.03.2028	800	939	0,01
		92.898	0,49	Latam Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.08.2029	1.522	1.447	0,01	Teollisuuden Voima OYJ 2,000 % fällig am 08.05.2024	8.300	9.709	0,05
				Summe Chile		40.184	0,21	Summe Finnland		41.981	0,22
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>CHINA</b>				<b>FRANKREICH</b>			
ADCB Finance Cayman Ltd. 3,000 % fällig am 04.03.2019	2.300	2.300	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Alibaba Group Holding Ltd. 3,600 % fällig am 28.11.2024	500	492	0,00	Amber Circle Funding Ltd. 3,250 % fällig am 04.12.2022	35.825	35.108	0,18	Altea S.C.A. 2,250 % fällig am 05.07.2024	1.900	2.238	0,01
Alpha Star Holding Ltd. 4,970 % fällig am 09.04.2019	900	902	0,00	China Uranium Development Co. Ltd. 3,500 % fällig am 08.10.2018	9.400	9.413	0,05	Altareit S.C.A. 2,875 % fällig am 02.07.2025 (a)	23.100	26.837	0,14
3,000 % fällig am 30.06.2020	19.000	18.240	0,10	CNOOC Curtis Funding Pty. Ltd. 4,500 % fällig am 03.10.2023	1.800	1.857	0,01	Altice France S.A. 5,375 % fällig am 15.05.2022	22.550	27.102	0,14
Ambac LSNI LLC 7,337 % fällig am 12.02.2023	14.400	14.635	0,08	CSCEC Finance Cayman Ltd. 2,250 % fällig am 14.06.2019	1.400	1.380	0,01	6,000 % fällig am 15.05.2022	\$ 13.925	13.992	0,07
Baidu, Inc. 2,750 % fällig am 09.06.2019	5.300	5.280	0,03	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0,221 % fällig am 12.10.2020	€ 11.500	13.438	0,07	6,250 % fällig am 15.05.2024	500	487	0,00
3,625 % fällig am 30.06.2020	19.200	19.045	0,10	3,109 % fällig am 12.10.2020	\$ 7.700	7.706	0,04	7,375 % fällig am 01.05.2026	4.800	4.711	0,03
Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,250 % fällig am 25.07.2022	9.400	8.942	0,05	3,113 % fällig am 08.11.2020	16.650	16.664	0,09	BNP Paribas S.A. 2,950 % fällig am 23.05.2022	500	483	0,00
7,250 % fällig am 04.04.2021	4.800	4.816	0,03	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 1,750 % fällig am 29.09.2019	50.200	49.301	0,26	3,375 % fällig am 09.01.2025	9.700	9.177	0,05
7,500 % fällig am 09.03.2020	5.900	6.051	0,03	2,500 % fällig am 13.09.2022	61.300	58.411	0,31	3,500 % fällig am 16.11.2027 (k)	34.400	31.976	0,17
Dwr Cymru Financing Ltd. 3,514 % fällig am 31.03.2030 (f)	€ 24	47	0,00	3,900 % fällig am 17.05.2022	300	302	0,00	BPCE S.A. 2,500 % fällig am 10.12.2018	2.000	1.999	0,01
Geely Automobile Holdings Ltd. 3,625 % fällig am 25.01.2023	\$ 14.600	14.167	0,07	State Grid Overseas Investment 2016 Ltd. 2,125 % fällig am 02.05.2030	€ 8.100	9.580	0,05	2,750 % fällig am 02.12.2021	7.700	7.483	0,04
HPHT Finance Ltd. 2,750 % fällig am 11.09.2022	7.700	7.345	0,04	Summe China		203.160	1,07	3,549 % fällig am 22.05.2022	14.300	14.518	0,08
KSA Sukuk Ltd. 2,894 % fällig am 20.04.2022	19.100	18.599	0,10	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				5,700 % fällig am 22.10.2023	3.000	3.008	0,02
Longfor Properties Co. Ltd. 3,900 % fällig am 16.04.2023	9.700	9.297	0,05	China Development Bank 0,375 % fällig am 16.11.2021	14.100	16.436	0,09	Credit Agricole S.A. 3,750 % fällig am 24.04.2023	14.250	13.977	0,07
Lunar Funding Ltd. 6,125 % fällig am 09.06.2027	€ 50	83	0,00	Summe Kolumbien		3.901	0,02	7,500 % fällig am 23.06.2026 (g)(l)	€ 10.438	14.846	0,08
MAF Global Securities Ltd. 4,750 % fällig am 07.05.2024	\$ 8.100	8.191	0,04	<b>CURACAO</b>				8,125 % fällig am 19.09.2033 (i)	\$ 15.650	15.814	0,08
Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	43.250	40.978	0,22	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Danone S.A. 1,691 % fällig am 30.10.2019	7.295	7.173	0,04
Ooredoo Tamweel Ltd. 3,039 % fällig am 03.12.2018	2.700	2.701	0,01	Ecopetrol S.A. 7,625 % fällig am 23.07.2019	\$ 1.300	1.360	0,01	2,589 % fällig am 02.11.2023	10.000	9.430	0,05
Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.03.2023	27.100	25.807	0,14	SURA Asset Management S.A. 4,375 % fällig am 11.04.2027	2.650	2.541	0,01	Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 27.03.2037	€ 400	651	0,00
5,500 % fällig am 15.02.2024	2.250	2.227	0,01	Summe Curacao		17.378	0,09	5,500 % fällig am 17.10.2041	9.300	15.454	0,08
QNB Finance Ltd. 2,875 % fällig am 29.04.2020	3.000	2.964	0,02	<b>DANEMARK</b>				6,000 % fällig am 22.01.2114	\$ 200	209	0,00
3,657 % fällig am 31.05.2021	49.000	49.459	0,26	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Ingenico Group S.A. 1,625 % fällig am 13.09.2024	€ 10.000	11.527	0,06
3,705 % fällig am 12.02.2020	2.000	2.009	0,01	Teva Pharmaceutical Finance BV 3,650 % fällig am 10.11.2021	6.006	5.757	0,03	Pernod Ricard S.A. 4,450 % fällig am 15.01.2022	\$ 8.400	8.644	0,05
SMFG Preferred Capital Ltd. 10,231 % fällig am 25.01.2029 (g)	€ 2.500	5.264	0,03	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 2,950 % fällig am 18.12.2022	100	91	0,00	Peugeot S.A. 2,000 % fällig am 20.03.2025	€ 800	911	0,01
Tencent Holdings Ltd. 3,595 % fällig am 19.01.2028	\$ 13.000	12.313	0,06	3,650 % fällig am 10.11.2021	12.030	11.530	0,06	RCI Banque S.A. 0,375 % fällig am 10.07.2019	13.800	16.181	0,09
Trafford Centre Finance Ltd. 7,030 % fällig am 28.01.2029	€ 290	476	0,00	Summe Danemark		559	0,00	Safran S.A. 0,247 % fällig am 28.06.2021	10.900	12.778	0,07
Transocean Guardian Ltd. 5,875 % fällig am 15.01.2024 (a)	\$ 4.900	4.888	0,03	<b>DANEMARK</b>				SEB S.A. 1,500 % fällig am 31.05.2024	12.800	15.010	0,08
Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 01.10.2027	32.800	31.406	0,16	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,375 % fällig am 25.11.2022	2.800	3.473	0,02
XLIT Ltd. 4,450 % fällig am 31.03.2025	8.696	8.568	0,04	AP Moller - Maersk A/S 1,750 % fällig am 18.03.2021	€ 2.500	3.033	0,02	Societe Generale S.A. 6,750 % fällig am 06.04.2028 (g)(l)	\$ 900	827	0,00
5,750 % fällig am 01.10.2021	5.000	5.339	0,03	1,750 % fällig am 16.03.2026	11.000	12.629	0,07	TDF Infrastructure S.A.S. 2,500 % fällig am 07.04.2026	€ 21.900	26.395	0,14
Yingde Gases Investment Ltd. 6,250 % fällig am 19.01.2023	1.700	1.609	0,01	2,550 % fällig am 22.09.2019	\$ 6.529	6.463	0,03	2,875 % fällig am 19.10.2022	3.700	4.648	0,02
		334.440	1,76	3,750 % fällig am 22.09.2024	4.500	4.386	0,02	Teleperformance 1,875 % fällig am 02.07.2025 (a)	9.900	11.474	0,06
		427.338	2,25	3,875 % fällig am 28.09.2025	1.100	1.065	0,01	Ubisoft Entertainment S.A. 1,289 % fällig am 30.01.2023	6.500	7.609	0,04
				Danske Bank A/S 7,000 % fällig am 26.06.2025 (g)(l)	18.000	17.719	0,09	Summe Frankreich		341.356	1,80
				TDC A/S 5,625 % fällig am 23.02.2023	€ 559	785	0,00	<b>DEUTSCHLAND</b>			
				Summe Dänemark		46.080	0,24	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								Deutsche Bank AG 1,750 % fällig am 17.01.2028	14.900	16.052	0,08

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
1,875 % fällig am 28.02.2020	£ 9.800	\$ 12.794	0,07	Yanlord Land HK Co. Ltd.				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>		
3,150 % fällig am 22.01.2021	\$ 20.700	20.045	0,11	6,750 % fällig am 23.04.2023	\$ 13.300	\$ 13.282	0,07	<b>PIMCO Fixed Income Source</b>		
3,300 % fällig am 16.11.2022	5.700	5.345	0,03	Summe Hongkong		255.720	1,35	ETFs plc - PIMCO US		
3,520 % fällig am 16.11.2022	29.200	28.295	0,15	<b>INDIEN</b>				Dollar Short Maturity		
3,950 % fällig am 27.02.2023	3.040	2.922	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Source UCITS ETF (h)	2.587.040	\$ 262.481 1,38
4,250 % fällig am 14.10.2021	98.100	96.787	0,51	Axis Bank Ltd.						
4,263 % fällig am 10.05.2019	3.265	3.281	0,02	3,250 % fällig am 21.05.2020	11.600	11.446	0,06	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>		
<b>Hochtief AG</b>				GMR Hyderabad International Airport Ltd.	8.000	6.792	0,04	AWAS Aviation Capital Ltd.		
2,625 % fällig am 28.05.2019	€ 580	693	0,00	4,250 % fällig am 27.10.2027				4,870 % fällig am 03.10.2021 (j)	\$ 36.467	36.396 0,19
3,875 % fällig am 20.03.2020	1.200	1.489	0,01	ICICI Bank Ltd.						
<b>IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)</b>				3,500 % fällig am 18.03.2020	7.400	7.363	0,04	<b>AKTIEN</b>		
3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	40.000	47.633	0,25	Oil India Ltd.				<b>INVESTMENTFONDS</b>		
<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b>				3,875 % fällig am 17.04.2019	2.700	2.707	0,01	<b>PIMCO Specialty Funds Ireland</b>		
0,375 % fällig am 15.03.2023	4.900	5.841	0,03	ONGC Videsh Ltd.				p.l.c. - PIMCO China Bond		
<b>ONG Telefunica Deutschland Finanzierungs GmbH</b>				3,250 % fällig am 15.07.2019	8.100	8.085	0,04	Fund (h)	329.257	3.750 0,02
1,750 % fällig am 05.07.2025 (a)	16.600	19.448	0,10	<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
<b>ProSiebenSat.1 Media SE</b>				Export-Import Bank of India						
2,625 % fällig am 15.04.2021	8.700	10.640	0,06	3,875 % fällig am 01.02.2028	15.600	14.684	0,08	<b>NON-AGENCY-MBS</b>		
<b>Volkswagen Bank GmbH</b>				Summe Indien		51.077	0,27	Fastnet Securities DAC		
0,379 % fällig am 08.12.2021	13.000	15.205	0,08	<b>INDONESIEN</b>				1,322 % fällig am 10.08.2053	€ 7.326	8.617 0,05
<b>Volkswagen Leasing GmbH</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Lusitano Mortgages PLC		
0,250 % fällig am 05.10.2020	10.200	11.916	0,06	Pelabuhan Indonesia Persero PT				0,000 % fällig am 16.10.2047	351	397 0,00
1,125 % fällig am 04.04.2024	11.100	12.796	0,07	4,500 % fällig am 02.05.2023	9.100	9.044	0,05	Summe Irland		456.550 2,40
1,375 % fällig am 20.01.2025	4.600	5.312	0,03	Perusahaan Listrik Negara PT	8.600	7.961	0,04	<b>ITALIEN</b>		
		316.494	1,67	4,125 % fällig am 15.05.2027		17.005	0,09	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>		
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Intesa Sanpaolo SpA		
<b>PCF GmbH</b>				Indonesia Government International Bond				3,375 % fällig am 12.01.2023	\$ 4.400	4.049 0,02
4,000 % fällig am 01.08.2024	15.400	18.079	0,09	2,875 % fällig am 08.07.2021	€ 2.500	3.103	0,02	3,875 % fällig am 15.01.2019	3.016	3.022 0,02
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Indonesien		20.108	0,11	5,017 % fällig am 26.06.2024	5.600	5.089 0,03
Bundesrepublik Deutschland				<b>IRAK</b>				5,710 % fällig am 15.01.2026	17.429	15.960 0,08
0,000 % fällig am 13.12.2019 (d)	4.300	5.072	0,03	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				6,500 % fällig am 24.02.2021	800	829 0,00
Summe Deutschland		339.645	1,79	Iraq Government International Bond				7,750 % fällig am 11.01.2027 (g)(l)	€ 43.400	54.779 0,29
<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>				6,752 % fällig am 09.03.2023	\$ 2.750	2.649	0,01	Leonardo SpA		
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>IRLAND</b>				1,500 % fällig am 07.06.2024	5.000	5.508 0,03
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Telecom Italia SpA		
1,250 % fällig am 14.04.2022	2.200	2.614	0,01	ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC				6,375 % fällig am 24.06.2019	€ 5.500	7.574 0,04
2,750 % fällig am 26.03.2020	\$ 39.025	38.614	0,20	2,626 % fällig am 26.04.2020	€ 16.300	19.068	0,10	Wind Tre SpA		
3,125 % fällig am 10.12.2020	1.100	1.093	0,01	AerCap Ireland Capital DAC				2,625 % fällig am 20.01.2023	€ 10.800	10.639 0,06
3,750 % fällig am 26.03.2025	14.400	13.870	0,07	3,300 % fällig am 23.01.2023	\$ 5.000	4.811	0,02	2,750 % fällig am 20.01.2024	8.700	8.482 0,04
3,800 % fällig am 15.09.2022	29.225	29.125	0,15	3,500 % fällig am 15.01.2025	23.500	22.077	0,11	Summe Italien		115.931 0,61
4,645 % fällig am 16.04.2021	10.000	10.455	0,06	3,650 % fällig am 21.07.2027	1.335	1.218	0,01	<b>NON-AGENCY-MBS</b>		
<b>Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust</b>				3,750 % fällig am 15.05.2019	12.590	12.668	0,07	Berica ABS SRL		
5,125 % fällig am 30.11.2024	22.997	23.770	0,13	3,875 % fällig am 23.01.2028	1.925	1.776	0,01	0,000 % fällig am 31.12.2055	4.627	5.397 0,03
<b>Globalworth Real Estate Investments Ltd.</b>				4,500 % fällig am 15.05.2021	2.000	2.039	0,01	Berica Residential MBS SRL		
2,875 % fällig am 20.06.2022	€ 18.200	21.814	0,12	4,625 % fällig am 30.10.2020	25.226	25.715	0,13	0,000 % fällig am 31.03.2048	8.006	9.310 0,05
3,000 % fällig am 29.03.2025	1.800	2.091	0,01	5,000 % fällig am 01.10.2021	4.571	4.713	0,02	BP Mortgages SRL		
Summe Guernsey, Kanalinseln		143.446	0,76	<b>Bank of Ireland</b>				0,000 % fällig am 20.04.2043	37	44 0,00
<b>HONGKONG</b>				7,375 % fällig am 18.06.2020 (g)(l)	€ 2.700	3.389	0,02	Mars SRL	163	192 0,00
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.				0,972 % fällig am 25.10.2050		14.943 0,08
CNOOC Finance Australia Pty. Ltd.				2,342 % fällig am 15.11.2020	\$ 5.300	5.182	0,03	Summe Italien		130.874 0,69
CNOOC Finance Ltd.	\$ 27.110	26.784	0,14	4,418 % fällig am 15.11.2035	9.400	9.123	0,05	<b>JAPAN</b>		
4,250 % fällig am 26.01.2021	15.050	15.352	0,08	Iberdrola Finance Ireland DAC				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>		
<b>Eastern Creation Investment Holdings Ltd.</b>				5,000 % fällig am 11.09.2019	1.150	1.174	0,01	Chugoku Electric Power Co., Inc.		
2,750 % fällig am 26.09.2020	6.100	5.973	0,03	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC				2,701 % fällig am 16.03.2020	\$ 1.300	1.293 0,01
3,625 % fällig am 20.03.2019	1.400	1.395	0,01	1,900 % fällig am 23.09.2019	26.650	26.239	0,14	Japan Tobacco, Inc.		
<b>Franshion Brilliant Ltd.</b>				SMBC Aviation Capital Finance DAC				2,000 % fällig am 13.04.2021	6.100	5.899 0,03
5,750 % fällig am 19.03.2019	5.200	5.275	0,03	2,650 % fällig am 15.07.2021	4.400	4.269	0,02	2,100 % fällig am 23.07.2018	4.800	4.800 0,03
<b>HKCG Finance Ltd.</b>				3,000 % fällig am 15.07.2022	1.500	1.448	0,01	Meiji Yasuda Life Insurance Co.		
6,250 % fällig am 07.08.2018	2.500	2.507	0,01			144.909	0,76	5,100 % fällig am 26.04.2048	11.900	12.034 0,06
<b>Horse Gallop Finance Ltd.</b>								Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.		
3,516 % fällig am 28.06.2021	18.000	18.013	0,10					2,950 % fällig am 01.03.2021	13.452	13.312 0,07
<b>Poly Real Estate Finance Ltd.</b>								2,998 % fällig am 22.02.2022	8.300	8.153 0,04
3,950 % fällig am 05.02.2023	34.400	33.450	0,18					3,150 % fällig am 25.07.2022	24.500	24.619 0,13
5,250 % fällig am 25.04.2019	3.942	3.984	0,02					3,393 % fällig am 13.09.2021	34.700	35.212 0,19
<b>Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.</b>								3,455 % fällig am 02.03.2023	26.400	26.190 0,14
3,880 % fällig am 25.05.2023	200	199	0,00					4,160 % fällig am 01.03.2021	7.279	7.538 0,04
3,950 % fällig am 23.12.2019	31.426	31.516	0,17							
3,975 % fällig am 09.11.2027	64.500	59.150	0,31							
4,150 % fällig am 18.04.2023	39.600	38.840	0,20							

















# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit 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>Tyson Foods, Inc.</b>				<b>Welltower, Inc.</b>				<b>MH Sub LLC</b>			
2,650 % fällig am 15.08.2019	\$ 3.600	\$ 3.587	0,02	3,750 % fällig am 15.03.2023	\$ 300	\$ 297	0,00	5,835 % fällig am 13.09.2024	\$ 21.239	\$ 21.262	0,11
2,768 % fällig am 30.05.2019	1.100	1.102	0,01	4,250 % fällig am 01.04.2026	2.400	2.379	0,01	<b>Nielsen Finance LLC</b>			
2,781 % fällig am 21.08.2020	6.300	6.302	0,03	4,800 % fällig am 20.11.2028	£ 200	301	0,00	4,046 % fällig am 04.10.2023	2.276	2.277	0,01
2,871 % fällig am 02.06.2020	2.200	2.204	0,01	4,950 % fällig am 15.01.2021	\$ 1.200	1.235	0,01	<b>Ply Gem Industries, Inc.</b>			
<b>U.S. Airways Pass-Through Trust</b>				<b>Western Gas Partners LP</b>				6,089 % fällig am 12.04.2025	21.400	21.407	0,11
3,950 % fällig am 15.05.2027	335	333	0,00	2,600 % fällig am 15.08.2018	1.250	1.249	0,01	<b>RPI Finance Trust</b>			
5,375 % fällig am 15.05.2023	396	405	0,00	5,375 % fällig am 01.06.2021	200	207	0,00	4,334 % fällig am 27.03.2023	49.455	49.490	0,26
5,900 % fällig am 01.04.2026	8.602	9.225	0,05	<b>WestRock Co.</b>				<b>Sequa Mezzanine Holdings LLC</b>			
7,125 % fällig am 22.04.2025	3.365	3.754	0,02	3,000 % fällig am 15.09.2024	7.200	6.835	0,04	7,046 % fällig am 28.11.2021	10.593	10.623	0,06
<b>U.S. Bancorp</b>				3,750 % fällig am 15.03.2025	12.200	11.978	0,06	<b>Western Digital Corp.</b>			
0,850 % fällig am 07.06.2024	€ 9.000	10.515	0,06	4,000 % fällig am 15.03.2028	14.400	14.221	0,08	3,594 % fällig am 27.02.2023	2.700	2.707	0,02
<b>UDR, Inc.</b>				<b>Weyerhaeuser Co.</b>							
2,950 % fällig am 01.09.2026	\$ 1.200	1.102	0,01	7,125 % fällig am 15.07.2023	7.175	8.203	0,04				
4,000 % fällig am 01.10.2025	10.197	10.148	0,05	7,375 % fällig am 01.10.2019	6.321	6.644	0,04				
<b>United Airlines Pass-Through Trust</b>				7,375 % fällig am 15.03.2032	2.544	3.241	0,02				
2,875 % fällig am 07.04.2030	681	633	0,00	7,950 % fällig am 15.03.2025	9.200	11.078	0,06				
3,100 % fällig am 07.04.2030	6.328	5.936	0,03	8,500 % fällig am 15.01.2025	29.357	36.236	0,19				
3,500 % fällig am 01.09.2031	16.200	15.760	0,08	<b>Willamette Industries, Inc.</b>							
3,700 % fällig am 01.09.2031	6.950	6.796	0,04	7,350 % fällig am 01.07.2026	13.150	15.436	0,08				
<b>UnitedHealth Group, Inc.</b>				9,000 % fällig am 01.10.2021	10.150	11.680	0,06				
3,750 % fällig am 15.07.2025	800	801	0,00	<b>WP Carey, Inc.</b>							
<b>University of Southern California</b>				2,000 % fällig am 20.01.2023	€ 3.000	3.649	0,02				
3,028 % fällig am 01.10.2039	400	364	0,00	4,000 % fällig am 01.02.2025	\$ 8.050	7.822	0,04				
<b>Univision Communications, Inc.</b>				4,250 % fällig am 01.10.2026	1.200	1.174	0,01				
5,125 % fällig am 15.02.2025	10.228	9.474	0,05	4,600 % fällig am 01.04.2024	600	607	0,00				
<b>USAA Capital Corp.</b>				<b>Wyndham Destinations, Inc.</b>							
2,450 % fällig am 01.08.2020	3.500	3.455	0,02	4,500 % fällig am 01.04.2027	450	440	0,00				
<b>VEREIT Operating Partnership LP</b>				5,625 % fällig am 01.03.2021	1.000	1.027	0,01				
3,000 % fällig am 06.02.2019	1.900	1.899	0,01	<b>Wynn Las Vegas LLC</b>							
4,125 % fällig am 01.06.2021	5.200	5.274	0,03	4,250 % fällig am 30.05.2023	42.460	40.496	0,21				
4,875 % fällig am 01.06.2026	1.900	1.897	0,01	5,250 % fällig am 15.05.2027	23.700	22.189	0,12				
<b>Verizon Communications, Inc.</b>				5,500 % fällig am 01.03.2025	49.493	48.751	0,26				
0,875 % fällig am 02.04.2025	€ 3.100	3.561	0,02	<b>Yellowstone Energy LP</b>							
1,375 % fällig am 27.10.2026	7.400	8.560	0,05	5,750 % fällig am 31.12.2026	7.828	7.959	0,04				
3,375 % fällig am 27.10.2036	£ 14.800	19.141	0,10	<b>Zayo Group LLC</b>							
3,376 % fällig am 15.02.2025	\$ 49.695	47.641	0,25	5,750 % fällig am 15.01.2027	3.400	3.349	0,02				
3,443 % fällig am 15.05.2025	21.000	20.995	0,11	<b>ZF North America Capital, Inc.</b>							
4,272 % fällig am 15.01.2036	3.300	3.053	0,02	4,500 % fällig am 29.04.2022	5.153	5.251	0,03				
4,672 % fällig am 15.03.2055	14.750	13.154	0,07	4,750 % fällig am 29.04.2025	1.850	1.852	0,01				
5,012 % fällig am 21.08.2054	24.879	23.510	0,12	<b>Zimmer Biomet Holdings, Inc.</b>							
5,250 % fällig am 16.03.2037	500	515	0,00	1,414 % fällig am 13.12.2022	€ 13.900	16.623	0,09				
<b>Visa, Inc.</b>				2,700 % fällig am 01.04.2020	\$ 29.351	29.079	0,15				
2,800 % fällig am 14.12.2022	1.000	982	0,01	3,150 % fällig am 01.04.2022	14.697	14.441	0,08				
3,150 % fällig am 14.12.2025	4.600	4.454	0,02	3,375 % fällig am 30.11.2021	1.100	1.092	0,01				
<b>VMware, Inc.</b>				<b>Zoetis, Inc.</b>							
2,300 % fällig am 21.08.2020	800	784	0,00	3,250 % fällig am 01.02.2023	4.085	4.026	0,02				
2,950 % fällig am 21.08.2022	58.331	56.029	0,30	3,450 % fällig am 13.11.2020	3.900	3.912	0,02				
3,900 % fällig am 21.08.2027	16.300	15.079	0,08	4,500 % fällig am 13.11.2025	1.600	1.658	0,01				
<b>Volkswagen Group of America Finance LLC</b>											
2,125 % fällig am 23.05.2019	10.195	10.114	0,05								
2,450 % fällig am 20.11.2019	5.800	5.738	0,03								
<b>Vulcan Materials Co.</b>											
2,941 % fällig am 15.06.2020	3.430	3.426	0,02								
<b>Walgreens Boots Alliance, Inc.</b>											
2,875 % fällig am 20.11.2020	£ 4.500	6.119	0,03								
<b>Wand Merger Corp.</b>											
8,125 % fällig am 15.07.2023 (a)	\$ 14.350	14.601	0,08								
<b>Washington Prime Group LP</b>											
5,950 % fällig am 15.08.2024	35.500	34.259	0,18								
<b>WEA Finance LLC</b>											
2,700 % fällig am 17.09.2019	300	299	0,00								
3,150 % fällig am 05.04.2022	6.100	5.985	0,03								
3,750 % fällig am 17.09.2024	24.100	23.829	0,13								
4,750 % fällig am 17.09.2044	200	204	0,00								
<b>Wells Fargo &amp; Co.</b>											
2,550 % fällig am 07.12.2020	5.300	5.218	0,03								
2,600 % fällig am 22.07.2020	11.750	11.604	0,06								
2,625 % fällig am 22.07.2022	3.200	3.084	0,02								
3,000 % fällig am 19.02.2025	750	708	0,00								
3,286 % fällig am 11.02.2022	16.100	16.271	0,09								
3,300 % fällig am 09.09.2024	2.050	1.982	0,01								
3,469 % fällig am 24.01.2023	57.700	58.601	0,31								
3,550 % fällig am 29.09.2025	20.590	19.978	0,11								
3,584 % fällig am 22.05.2028	40.100	38.464	0,20								
3,661 % fällig am 04.03.2021	22.200	22.729	0,12								
<b>Wells Fargo Bank N.A.</b>											
2,964 % fällig am 06.12.2019	2.000	2.014	0,01								



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit 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					
												BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
33,500 % fällig am 18.07.2018	ARS	20.910	711	0,00	25,250 % fällig am 14.09.2018 (d)(e)	ARS	35.900	\$ 1.150	0,01	15,498 % fällig am 04.10.2018 (d)(e)	NGN	998.000	\$ 2.689	0,01		
37,800 % fällig am 21.11.2018		24.540	734	0,00	25,350 % fällig am 14.09.2018 (d)(e)		41.800	1.339	0,01	15,501 % fällig am 29.11.2018 (d)(e)		825.100	2.180	0,01		
<b>Nigeria Open Market Operation Bills</b>																
11,180 % fällig am 13.12.2018	NGN	1.615.731	4.222	0,02	25,601 % fällig am 14.09.2018 (d)(e)		230.727	7.392	0,03	15,504 % fällig am 29.11.2018 (d)(e)		845.000	2.232	0,01		
15,190 % fällig am 23.08.2018		536.000	1.457	0,01	25,801 % fällig am 19.09.2018 (d)(e)		46.346	1.474	0,01	15,542 % fällig am 11.10.2018 (d)(e)		177.400	477	0,00		
15,294 % fällig am 09.08.2018		1.300.000	3.555	0,02	39,900 % fällig am 19.09.2018 (d)(e)		156.060	4.963	0,02	15,566 % fällig am 29.11.2018 (d)(e)		275.700	728	0,00		
15,298 % fällig am 09.08.2018		116.000	317	0,00						15,603 % fällig am 04.10.2018 (d)(e)		995.000	2.681	0,01		
15,302 % fällig am 06.09.2018		505.000	1.366	0,01	<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>							15,646 % fällig am 01.11.2018 (d)(e)		750.000	1.989	0,01
15,398 % fällig am 06.09.2018		998.000	2.700	0,02						15,683 % fällig am 11.10.2018 (d)(e)		181.000	486	0,00		
15,432 % fällig am 25.10.2018		452.700	1.204	0,01	7,807 % fällig am 04.09.2018 (d)(e)	EGP	31.600	1.714	0,01	15,699 % fällig am 22.11.2018 (d)(e)		864.100	2.289	0,01		
15,696 % fällig am 08.11.2018		275.800	734	0,00	10,327 % fällig am 28.08.2018 (d)(e)		365.300	19.913	0,10	15,777 % fällig am 04.10.2018 (d)(e)		898.000	2.420	0,01		
15,716 % fällig am 08.11.2018		388.600	1.033	0,01	11,747 % fällig am 25.09.2018 (d)(e)		316.300	16.953	0,09	15,965 % fällig am 04.10.2018 (d)(e)		225.000	606	0,00		
15,737 % fällig am 08.11.2018		891.500	2.371	0,01						18,147 % fällig am 04.10.2018 (d)(e)		199.000	536	0,00		
15,798 % fällig am 08.11.2018		400.000	1.064	0,01	<b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>							18,882 % fällig am 19.07.2018 (d)(e)		804.000	2.215	0,01
15,805 % fällig am 25.10.2018		650.000	1.729	0,01	11,724 % fällig am 01.11.2018 (d)(e)	NGN	2.462.400	6.531	0,04				46.815	0,23		
16,686 % fällig am 09.08.2018		1.300.000	3.555	0,02	13,750 % fällig am 06.12.2018 (d)(e)		1.431.660	3.771	0,02	Summe kurzfristige Instrumente			173.798	0,90		
19,005 % fällig am 09.08.2018		804.000	2.199	0,01	15,056 % fällig am 29.11.2018 (d)(e)		881.100	2.327	0,01	<b>AKTIEN</b>						
					15,151 % fällig am 04.10.2018 (d)(e)		505.000	1.361	0,01	<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>						
					15,152 % fällig am 13.09.2018 (d)(e)		1.300.000	3.515	0,02	<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO</b>						
					15,284 % fällig am 04.10.2018 (d)(e)		273.300	736	0,01	<b>US Dollar Short-Term Floating</b>						
					15,380 % fällig am 20.09.2018 (d)(e)		626.000	1.692	0,01	<b>NAV Fund (h)</b>						
					15,400 % fällig am 04.10.2018 (d)(e)		614.000	1.655	0,01				19.640	197	0,00	
					15,448 % fällig am 20.09.2018 (d)(e)		614.000	1.659	0,01	Summe Übertragbare Wertpapiere						
					15,450 % fällig am 04.10.2018 (d)(e)		757.000	2.040	0,01	und Geldmarktinstrumente – Amtliche						
										Börse/Geregelter Markt				\$ 20.656.580	108,76	

## 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
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2019	6.121	\$ 17.626	0,09
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	1.020	1.316	0,01
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	91	212	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	9.023	6.535	0,03
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	14.172	(3.434)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	812	8	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	367	(560)	0,00
				\$ 21.703	0,11

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 117,500	27.07.2018	1.130	\$ (194)	\$ (18)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	120,500	27.07.2018	1.130	(280)	(370)	0,00
				\$ (474)	\$ (388)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 21.315	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-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Aetna, Inc.	(1,000) %	20.12.2020	\$ 26.400	\$ 194	0,00
Caterpillar, Inc.	(1,000)	20.12.2020	14.150	5	0,00
Deere & Co.	(1,000)	20.12.2020	8.500	20	0,00
Dominion Energy, Inc.	(1,000)	20.06.2019	2.700	14	0,00
Dow Chemical Co.	(1,000)	20.12.2020	6.000	(22)	0,00
ERP Operating LP	(1,000)	20.12.2020	5.500	20	0,00
Kinder Morgan Energy Partners LP	(1,000)	20.03.2019	840	1	0,00
Newmont Mining Corp.	(1,000)	20.12.2020	13.000	(142)	0,00
UnitedHealth Group, Inc.	(1,000)	20.12.2020	25.400	192	0,00
				\$ 282	0,00

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Anadarko Petroleum Corp.	1,000 %	20.06.2021	\$ 1.800	\$ 88	0,00
Anadarko Petroleum Corp.	1,000	20.12.2021	24.050	1.609	0,01
Anadarko Petroleum Corp.	1,000	20.06.2022	300	4	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.03.2019	16.800	(116)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2021	48.500	728	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.06.2022	29.900	(45)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2022	63.800	(83)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.06.2023	7.100	179	0,00
BT Group	1,000	20.06.2023	€ 22.100	(15)	0,00
Canadian Natural Resources Ltd.	1,000	20.06.2022	\$ 3.900	39	0,00
Carrefour	1,000	20.06.2023	€ 14.500	(11)	0,00
Daimler AG	1,000	20.12.2020	16.500	(10)	0,00
Deutsche Bank AG	1,000	20.06.2019	14.400	21	0,00
DISH DBS Corp.	5,000	20.12.2022	\$ 12.650	(873)	(0,01)
DISH DBS Corp.	5,000	20.06.2023	8.600	(459)	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.12.2021	2.500	146	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.06.2022	26.500	(39)	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.12.2022	17.900	79	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2021	1.000	10	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.06.2022	21.200	264	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2021	9.100	(75)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2022	200	(6)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2023	8.100	(62)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2021	29.300	(753)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2021	5.800	(155)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2022	3.600	(103)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2022	6.800	(106)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2023	33.100	83	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.06.2020	48.900	(163)	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.09.2020	7.700	(25)	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2020	6.100	(19)	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2021	9.300	(25)	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.06.2022	6.700	(16)	0,00
Hess Corp.	1,000	20.06.2021	7.900	554	0,00
Hess Corp.	1,000	20.12.2021	1.300	16	0,00
Host Hotels & Resorts LP	1,000	20.12.2020	3.300	38	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.06.2021	€ 49.100	1.463	0,01
Marks & Spencer PLC	1,000	20.06.2023	4.000	140	0,00
MBIA, Inc.	5,000	20.12.2019	\$ 11.200	1.698	0,01
MetLife, Inc.	1,000	20.09.2020	28.925	188	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2021	2.800	42	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.09.2021	7.200	152	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2021	34.100	1.116	0,01
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2022	12.500	(49)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2022	15.800	(67)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2023	11.000	465	0,00
Nordstrom, Inc.	1,000	20.06.2022	800	28	0,00
Pacific Gas & Electric Co.	1,000	20.06.2021	2.000	(5)	0,00
Prudential Financial, Inc.	1,000	20.09.2020	26.400	153	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2021	€ 22.100	(70)	0,00
Ryder System, Inc.	1,000	20.06.2022	\$ 9.400	(88)	0,00
Schaeffler Finance BV	0,000	20.06.2023	€ 19.000	(743)	0,00
Schaeffler Finance BV	5,000	20.06.2022	17.900	(877)	(0,01)
Sherwin Williams Co.	1,000	20.06.2022	\$ 5.900	(38)	0,00
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.12.2022	17.800	(140)	0,00
Simon Property Group LP	1,000	20.06.2022	20.900	(4)	0,00
Telecom Italia SpA	0,000	20.12.2022	€ 25.000	(757)	0,00
Telecom Italia SpA	1,000	20.12.2024	5.000	(216)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.U.	1,000	20.06.2022	23.000	(246)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Verizon Communications, Inc.	1,000 %	20.12.2022	\$ 3.000	\$ (15)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	€ 26.100	27	0,00
				\$ 2.856	0,02

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-30 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2023	\$ 50.000	\$ 742	0,00
CDX.IG-30 5-Year Index	(1,000)	20.06.2023	69.800	219	0,00
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	€ 439.200	5.275	0,03
				\$ 6.236	0,03

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,035 %	02.01.2020	BRL 1.688.700	\$ (6.533)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,500	02.01.2020	390.000	(815)	0,00
Zahlung	3-Month CAD Bank Bill	2,300	13.12.2047	CAD 1.200	(16)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2025	1.000	(23)	0,00
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	2,738	31.01.2048	2.300	(80)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	5,000	17.12.2024	NZD 217.600	(2.174)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.12.2026	\$ 328.100	38.707	0,20
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	533.800	(6.153)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	208.900	2.982	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	19.09.2023	ZAR 1.006.200	(1.761)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	19.09.2028	509.300	(1.549)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,300	15.03.2027	200	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	19.12.2028	1.692.700	405	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	£ 150.500	1.430	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	44.200	(779)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	71.000	723	0,00
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,750	21.09.2066	2.000	92	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month HUF-BBR	1,000	19.09.2023	HUF 37.770.400	(5.937)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	16.157.700	(2.618)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	¥ 7.992.900	(143)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,415	25.03.2029	2.120.000	(103)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	17.300.000	(842)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,000	18.09.2023	890.000	9	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	1,000	20.09.2024	1.830.000	(35)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,250	17.06.2035	2.530.000	(202)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,500	21.12.2045	470.000	(112)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	10.03.2026	MXN 384.500	(444)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	14.03.2025	456.000	(376)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,740	22.02.2027	1.200.400	(2.279)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,840	21.04.2028	4.040.000	(2.800)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,955	01.05.2028	148.600	11	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,273	30.09.2020	\$ 650	6	0,00
Erhalt	UKRPI	3,530	15.10.2031	£ 60.800	1.968	0,00
					\$ 10.559	0,05
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 19.933</b>	<b>0,10</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* 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	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,450 %	29.01.2019	\$ 328.500	\$ 780	\$ 264	0,00
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,940	18.02.2020	455.700	3.342	2.776	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,258	18.09.2019	54.300	1.618	1.809	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,945	09.12.2019	56.300	2.702	3.682	0,02
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,000	27.11.2018	1.156.200	2.837	1.619	0,00
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,000	04.12.2018	289.300	609	29	0,00
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,933	13.08.2018	33.800	3.515	731	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,230	19.02.2019	95.500	4.520	1.927	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,258	18.09.2019	45.000	1.365	1.499	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,340	04.10.2019	55.000	1.553	1.598	0,01
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,100	08.03.2019	29.200	1.971	911	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	18.03.2019	88.000	4.400	2.142	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,258	18.09.2019	31.600	980	1.053	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,930	09.12.2019	81.600	3.753	5.468	0,03
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,943	12.12.2019	24.700	1.186	1.628	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	16.12.2019	27.300	1.570	513	0,00
							\$ 37.867	\$ 27.753	0,15

## VERKAUFSoPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens	
BOA	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,700 %	18.07.2018	\$ 82.700	\$ (91)	\$ (47)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	142.500	(172)	(48)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,700	15.08.2018	17.900	(23)	(28)	0,00	
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.08.2018	55.600	(56)	(38)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	91.700	(87)	(31)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	74.500	(73)	(41)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	124.800	(146)	(137)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	1,000	15.08.2018	€ 107.100	(210)	(83)	0,00	
BRC	Call - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Kauf	0,500	19.09.2018	170.200	(170)	(9)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	170.200	(506)	(641)	(0,01)	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 21.800	(37)	(3)	0,00	
CBK	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 111.600	(228)	(279)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.07.2018	\$ 76.100	(106)	(20)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	32.200	(33)	(7)	0,00	
CKL	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.08.2018	147.000	(152)	(123)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	37.300	(53)	(41)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	€ 112.600	(284)	(424)	0,00	
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	110.900	(232)	(278)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	\$ 60.500	(77)	(20)	0,00	
GST	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	€ 46.700	(103)	(96)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.07.2018	\$ 76.400	(84)	(20)	0,00	
JPM	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	€ 41.600	(86)	(86)	0,00	
MEI	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	\$ 61.900	(57)	(25)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 129.200	(256)	(323)	0,00	
							\$ (3.322)	\$ (2.848)	(0,01)

## DEVIENSOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus BRL	BRL 3,700	12.07.2018	\$ 24.799	\$ (220)	\$ (1.017)	(0,01)
CBK	Call - OTC USD versus BRL	3,700	12.07.2018	153.988	(1.384)	(6.316)	(0,03)
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 20,500	09.07.2018	86.381	(855)	(243)	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	20,650	09.08.2018	86.488	(1.110)	(655)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	20,300	03.10.2018	97.446	(2.137)	(2.287)	(0,01)
					\$ (5.706)	\$ (10.518)	(0,06)

## INFLATIONSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Floor - OTC CPURNSA	\$ 215,949	Maximal $[(1 + 0,000 \%)^{10} - (\text{Index Final/Index Initial})]$ oder 0	12.03.2020	\$ 36.100	\$ (311)	\$ 0	0,00
DUB	Floor - OTC CPURNSA	217,965	Maximal $[(1 + 0,000 \%)^{10} - (\text{Index Final/Index Initial})]$ oder 0	29.09.2020	29.200	(377)	0	0,00
	Floor - OTC CPURNSA	218,011	Maximal $[0,000 \% - (\text{Index Final/Index Initial} - 1)]$ oder 0	13.10.2020	23.600	(231)	0	0,00
						\$ (919)	\$ 0	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,940 %	18.09.2019	\$ 232.700	\$ (1.650)	\$ (3.413)	(0,02)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	09.12.2019	247.700	(2.705)	(5.171)	(0,03)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	11.12.2019	108.600	(1.165)	(2.272)	(0,01)
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,553	29.01.2019	65.700	(780)	(302)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,086	18.02.2020	43.400	(3.342)	(3.207)	(0,02)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180	27.11.2018	82.100	(772)	(50)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,200	27.11.2018	80.900	(1.026)	(54)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,210	27.11.2018	80.900	(1.052)	(56)	0,00
DUB	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,173	04.12.2018	61.200	(612)	(40)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,900	13.08.2018	148.700	(3.515)	(599)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,000	19.02.2019	488.950	(5.001)	(4.219)	(0,02)
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,940	18.09.2019	193.500	(1.365)	(2.838)	(0,02)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,040	04.10.2019	221.200	(1.487)	(2.808)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,970	08.03.2019	127.000	(1.971)	(1.249)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,050	18.03.2019	440.000	(4.440)	(3.649)	(0,02)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,940	18.09.2019	135.900	(988)	(1.993)	(0,01)
JPM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	09.12.2019	359.000	(3.769)	(7.495)	(0,04)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	12.12.2019	108.600	(1.185)	(2.274)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.12.2019	120.000	(1.568)	(489)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,835	11.07.2018	82.400	(103)	(51)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,085	11.07.2018	82.400	(103)	(5)	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,770	02.07.2018	92.800	(112)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,010	02.07.2018	92.800	(112)	0	0,00
							\$ (38.823)	\$ (42.234)	(0,22)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHÜTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
BOA	Freeport-McMoRan, Inc.	(3,990) %	20.12.2018	\$ 1.000	\$ 0	\$ (17)	\$ (17)	0,00

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHÜTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
BOA	New York State General Obligation Bonds, Series 2005	1,850 %	20.03.2021	\$ 1.800	\$ 0	\$ 80	\$ 80	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	4.600	(470)	(19)	(489)	0,00
BPS	BHP Billiton Finance USA Ltd.	1,000	20.06.2021	5.100	(156)	259	103	0,00
	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	€ 5.000	53	(47)	6	0,00
	Intesa Sanpaolo	1,000	20.06.2023	4.430	(582)	4	(578)	0,00
BRC	Petroleos Mexicanos	1,000	20.09.2020	\$ 23.500	(1.173)	1.010	(163)	0,00
	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	€ 9.500	86	(74)	12	0,00
	Indonesia Government International Bond	0,000	20.06.2023	\$ 900	(12)	(2)	(14)	0,00
CBK	Mexico Government International Bond	0,000	20.06.2023	5.000	(51)	(24)	(75)	0,00
	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.06.2022	200	17	(11)	6	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2022	4.300	(27)	(10)	(37)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	10.500	(103)	(55)	(158)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	7.900	(659)	543	(116)	0,00
DBL	Valeant Pharmaceuticals International, Inc.	5,000	20.12.2020	4.500	115	194	309	0,00
DUB	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.06.2022	1.200	104	(67)	37	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.09.2020	12.800	(689)	600	(89)	0,00
GST	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	1.200	(69)	26	(43)	0,00
	American Tower Corp.	1,000	20.06.2021	17.500	(826)	731	(95)	0,00
	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.06.2022	7.300	646	(422)	224	0,00
	Enterprise Products Operating LLC	1,000	20.06.2021	7.000	(361)	492	131	0,00
	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	€ 500	5	(4)	1	0,00
	Indonesia Government International Bond	0,000	20.06.2023	\$ 2.500	(34)	(6)	(40)	0,00
	Intesa Sanpaolo	1,000	20.06.2022	€ 2.800	(226)	(40)	(266)	0,00
	Mexico Government International Bond	0,000	20.06.2023	\$ 8.100	(75)	(46)	(121)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	15.800	(1.760)	76	(1.684)	(0,01)
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.09.2020	9.500	(464)	398	(66)	0,00
HUS	Argentine Republic Government International Bond	0,000	20.12.2018	4.400	43	12	55	0,00
	Indonesia Government International Bond	0,000	20.06.2023	1.200	(16)	(3)	(19)	0,00
	Mexico Government International Bond	0,000	20.06.2023	68.100	(610)	(412)	(1.022)	(0,01)
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2022	14.500	(211)	182	(29)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	2.400	(269)	13	(256)	0,00
JPM	Petroleos Mexicanos	1,000	20.09.2020	19.700	(983)	846	(137)	0,00
	Anheuser-Busch InBev NV	1,000	20.06.2019	1.500	37	(26)	11	0,00
	AP Moller - Maersk	1,000	20.06.2022	€ 12.800	(72)	179	107	0,00
	Intesa Sanpaolo	1,000	20.06.2023	5.370	(692)	(9)	(701)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2022	\$ 21.200	(306)	264	(42)	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.09.2020	24.500	(1.279)	1.109	(170)	0,00
	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC	1,000	20.06.2022	€ 15.600	131	295	426	0,00
MEI	Southern Co.	1,000	20.12.2022	\$ 23.000	285	160	445	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.12.2021	200	(8)	29	21	0,00
	CMBX.NA.BBB-6 Index	3,000	11.05.2063	3.200	(285)	(45)	(330)	0,00
MYC	American Tower Corp.	1,000	20.06.2020	3.200	(112)	118	6	0,00
	Enterprise Products Operating LLC	1,000	20.06.2021	33.200	(1.141)	1.764	623	0,00

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
NGF	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.06.2021	\$ 7.900	\$ (651)	\$ 535	\$ (116)	0,00
UAG	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.06.2022	4.000	361	(238)	123	0,00
	Park Aerospace Holdings Ltd.	5,000	01.07.2020	7.400	433	(143)	290	0,00
					\$ (12.056)	\$ 8.216	\$ (3.840)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	CDX.HY-25 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2020	\$ 3.300	\$ 30	\$ 349	\$ 379	0,00
	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	7.100	1.079	(75)	1.004	0,01
	iTraxx Japan 20 5-Year Index	1,000	20.12.2018	¥ 810.000	83	(48)	35	0,00
BRC	iTraxx Japan 20 5-Year Index	1,000	20.12.2018	2.260.000	95	1	96	0,00
	iTraxx Japan 29 5-Year Index	0,000	20.06.2023	1.906.000	473	(85)	388	0,00
CBK	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	\$ 29.550	2.782	1.396	4.178	0,02
	iTraxx Japan 29 5-Year Index	0,000	20.06.2023	¥ 1.554.000	372	(55)	317	0,00
DUB	iTraxx Japan 20 5-Year Index	1,000	20.12.2018	1.610.000	155	(86)	69	0,00
	iTraxx Japan 29 5-Year Index	0,000	20.06.2023	1.886.000	461	(77)	384	0,00
FBF	CMBX.NA.BBB-10 Index	3,000	17.11.2059	\$ 4.000	(454)	94	(360)	0,00
GST	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	13.500	1.141	768	1.909	0,01
	CMBX.NA.BBB-7 Index	3,000	17.01.2047	22.450	(2.238)	660	(1.578)	(0,01)
	CMBX.NA.BBB-9 Index	3,000	17.09.2058	8.700	(1.480)	584	(896)	0,00
	iTraxx Japan 29 5-Year Index	0,000	20.06.2023	¥ 5.924.000	1.468	(261)	1.207	0,01
JPM	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	\$ 3.550	304	198	502	0,00
	CDX.HY-29 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2022	4.900	779	(87)	692	0,00
	iTraxx Japan 29 5-Year Index	0,000	20.06.2023	¥ 23.523.000	5.811	(1.019)	4.792	0,02
JPS	CMBX.NA.BBB-6 Index	3,000	11.05.2063	\$ 1.200	(92)	(32)	(124)	0,00
	CMBX.NA.BBB-9 Index	3,000	17.09.2058	1.300	(135)	1	(134)	0,00
MEI	CMBX.NA.BBB-10 Index	3,000	17.11.2059	600	(57)	3	(54)	0,00
	CMBX.NA.BBB-7 Index	3,000	17.01.2047	6.300	(664)	221	(443)	0,00
	CMBX.NA.BBB-9 Index	3,000	17.09.2058	800	(84)	2	(82)	0,00
MYC	CDX.HY-25 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2020	15.000	75	1.646	1.721	0,01
	CMBX.NA.BBB-7 Index	3,000	17.01.2047	20.700	(2.190)	735	(1.455)	(0,01)
	CMBX.NA.BBB-9 Index	3,000	17.09.2058	700	(73)	1	(72)	0,00
					\$ 7.641	\$ 4.834	\$ 12.475	0,06

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Rückertangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Rückertangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds 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
CBK	Zahlung	3-Month NZD-BBR	5,000 %	17.12.2024	NZD 22.000	\$ 371	\$ 1.679	\$ 2.050	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,650	14.11.2023	CLP 14.500.000	0	(267)	(267)	0,00
DUB	Zahlung	3-Month NZD-BBR	5,000	17.12.2024	NZD 65.800	1.173	4.958	6.131	0,03
GLM	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,270	14.11.2021	CLP 54.035.500	0	(832)	(832)	(0,01)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,520	16.11.2022	27.227.400	0	(395)	(395)	0,00
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,778	14.11.2024	35.000.000	0	(733)	(733)	0,00
JPM	Zahlung	3-Month NZD-BBR	5,000	17.12.2024	NZD 17.600	311	1.329	1.640	0,01
						\$ 1.855	\$ 5.739	\$ 7.594	0,04

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	09/2018	\$ 141	THB 4.486	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
BOA	07/2018	5.369	ARS 135.409	0	(676)	(676)	0,00
	07/2018	33.888	AUD 45.906	30	0	30	0,00
	07/2018	107.488	BRL 406.412	0	(1.855)	(1.855)	(0,01)
	07/2018	2.833	€ 2.412	0	(17)	(17)	0,00
	07/2018	16.098	PLN 55.388	0	(1.304)	(1.304)	(0,01)
	08/2018	ARS 109.700	\$ 5.092	1.448	0	1.448	0,01
	08/2018	AUD 45.906	33.891	0	(30)	(30)	0,00
	08/2018	BRL 406.412	107.182	1.924	0	1.924	0,01
	08/2018	CAD 10.400	8.053	141	0	141	0,00
	08/2018	MXN 1.058.411	53.749	362	0	362	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	08/2018	\$ 176	HUF 47.768	\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00
	08/2018	143.329	MXN 2.975.867	6.775	0	6.775	0,04
	08/2018	49.955	ZAR 635.679	0	(3.788)	(3.788)	(0,02)
	08/2018	ZAR 44.732	\$ 3.397	148	0	148	0,00
	09/2018	ARS 53.813	2.444	709	0	709	0,00
	09/2018	SGD 111.585	84.032	2.058	0	2.058	0,01
	01/2019	\$ 8.636	EGP 161.752	0	(137)	(137)	0,00
BPS	07/2018	ARS 735.616	\$ 27.230	1.887	0	1.887	0,01
	07/2018	BRL 370.935	98.028	1.616	0	1.616	0,01
	07/2018	COP 50.508.000	18.000	814	0	814	0,00
	07/2018	¥ 1.286.630	11.846	231	0	231	0,00
	07/2018	\$ 14.772	ARS 409.044	0	(729)	(729)	0,00
	07/2018	1.168	€ 1.009	10	0	10	0,00
	08/2018	ARS 660	\$ 31	9	0	9	0,00
	08/2018	HUF 909.209	3.505	273	0	273	0,00
	08/2018	MXN 131.737	6.925	280	0	280	0,00
	09/2018	\$ 9	IDR 128.571	0	0	0	0,00
	09/2018	48.849	INR 3.336.529	0	(642)	(642)	0,00
BRC	07/2018	ARS 623.801	\$ 22.434	1.198	0	1.198	0,01
	07/2018	\$ 954.770	£ 730.138	9.195	0	9.195	0,05
	08/2018	£ 730.138	\$ 956.101	0	(9.171)	(9.171)	(0,05)
CBK	07/2018	ARS 136.918	4.774	127	0	127	0,00
	07/2018	CAD 245.452	188.539	1.948	0	1.948	0,01
	07/2018	\$ 174	ARS 4.539	0	(19)	(19)	0,00
	07/2018	10.023	€ 8.466	0	(138)	(138)	0,00
	07/2018	2.340	£ 1.742	0	(40)	(40)	0,00
	07/2018	13.173	MXN 266.386	333	0	333	0,00
	07/2018	741	PLN 2.539	0	(62)	(62)	0,00
	08/2018	MXN 3.051.585	\$ 148.746	39	(5.216)	(5.177)	(0,03)
	08/2018	\$ 13.919	MXN 277.522	180	(100)	80	0,00
	09/2018	274	ARS 7.467	0	(33)	(33)	0,00
DUB	11/2018	NGN 261.321	\$ 690	0	(22)	(22)	0,00
	07/2018	BRL 188.950	50.000	889	0	889	0,01
	07/2018	TRY 442.902	89.809	0	(6.139)	(6.139)	(0,03)
	07/2018	\$ 9.521	ARS 239.552	0	(1.218)	(1.218)	(0,01)
	07/2018	543	PLN 1.838	0	(53)	(53)	0,00
GLM	07/2018	ARS 215.886	\$ 7.541	214	0	214	0,00
	07/2018	AUD 48.893	36.755	630	0	630	0,00
	07/2018	COP 33.056.190	11.810	562	0	562	0,00
	07/2018	€ 15.182	17.993	267	0	267	0,00
	07/2018	\$ 8.141	CHF 8.056	0	(28)	(28)	0,00
	07/2018	170.031	€ 145.209	38	(531)	(493)	0,00
	07/2018	85.009	£ 63.518	1	(1.150)	(1.149)	(0,01)
	08/2018	ARS 65.502	\$ 2.424	270	0	270	0,00
	08/2018	HUF 3.091.523	11.347	356	0	356	0,00
	08/2018	INR 2.020.191	29.145	0	(237)	(237)	0,00
	08/2018	RUB 2.832.227	43.920	0	(1.003)	(1.003)	(0,01)
	08/2018	\$ 3.263	MXN 65.066	19	0	19	0,00
	08/2018	1.065	ZAR 14.480	0	(13)	(13)	0,00
	08/2018	ZAR 49.453	\$ 3.565	0	(27)	(27)	0,00
	09/2018	INR 1.302.662	18.708	0	(113)	(113)	0,00
	03/2019	\$ 2.114	ARS 65.502	0	(254)	(254)	0,00
HUS	07/2018	ARS 493.348	\$ 17.818	994	0	994	0,01
	07/2018	CHF 20	20	0	0	0	0,00
	07/2018	£ 130	171	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 16.621	ARS 463.059	0	(775)	(775)	0,00
	07/2018	25.912	BRL 96.491	0	(832)	(832)	0,00
	07/2018	181.696	CAD 241.747	2.079	0	2.079	0,01
	07/2018	35	CHF 35	0	0	0	0,00
	07/2018	1.172.162	€ 1.014.770	12.633	0	12.633	0,07
	07/2018	304	£ 230	0	0	0	0,00
	07/2018	1.166	NZD 1.678	0	(30)	(30)	0,00
	08/2018	ARS 27.870	\$ 1.291	366	0	366	0,00
	08/2018	CAD 241.747	181.797	0	(2.070)	(2.070)	(0,01)
	08/2018	€ 1.003.488	1.161.588	0	(12.579)	(12.579)	(0,07)
	08/2018	\$ 4.000	ARS 82.760	0	(1.279)	(1.279)	(0,01)
	08/2018	898	HUF 253.762	4	0	4	0,00
	08/2018	1.703	MXN 34.785	51	0	51	0,00
	08/2018	75.276	RUB 4.704.904	0	(649)	(649)	0,00
	08/2018	ZAR 64.526	\$ 4.984	297	0	297	0,00
	09/2018	CNH 31.702	4.982	212	0	212	0,00
	10/2018	NGN 843.671	2.245	0	(61)	(61)	0,00
JPM	07/2018	ARS 66.910	2.356	76	0	76	0,00
	07/2018	CHF 8.056	8.130	17	0	17	0,00
	07/2018	COP 11.184.000	4.000	194	0	194	0,00
	07/2018	NZD 96.241	66.542	1.382	0	1.382	0,01
	07/2018	\$ 1.044	AUD 1.420	5	0	5	0,00
	07/2018	2.859	CAD 3.705	0	(42)	(42)	0,00
	07/2018	43.681	€ 37.254	41	(226)	(185)	0,00
	07/2018	1.548	£ 1.163	0	(12)	(12)	0,00
	07/2018	14.250	MXN 288.136	358	0	358	0,00
	07/2018	1.599	NZD 2.271	0	(61)	(61)	0,00
	07/2018	15.953	PLN 54.486	0	(1.400)	(1.400)	(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
	08/2018	NGN 1.309.515	\$ 3.415	\$ 0	\$ (190)	\$ (190)	0,00
	08/2018	\$ 8.151	CHF 8.056	0	(18)	(18)	0,00
	08/2018	1.498	ZAR 20.690	5	0	5	0,00
	08/2018	ZAR 587.135	\$ 45.826	3.185	0	3.185	0,02
	09/2018	NGN 1.225.900	3.250	0	(110)	(110)	0,00
	10/2018	3.490.902	9.258	0	(279)	(279)	0,00
	11/2018	4.401.602	11.695	0	(259)	(259)	0,00
	12/2018	1.380.443	3.654	0	(89)	(89)	0,00
MSB	07/2018	€ 2.017.183	2.353.478	0	(1.685)	(1.685)	(0,01)
	07/2018	PLN 105.663	31.093	2.869	0	2.869	0,02
	07/2018	\$ 15.506	BRL 56.983	0	(696)	(696)	0,00
	09/2018	ARS 440.363	\$ 19.953	5.571	0	5.571	0,03
	09/2018	MYR 404	101	1	0	1	0,00
	10/2018	NGN 256.390	683	0	(17)	(17)	0,00
	10/2018	\$ 31.673	MXN 623.866	0	(383)	(383)	0,00
RBC	08/2018	1.664	34.303	66	0	66	0,00
	08/2018	9.372	TRY 43.036	0	(169)	(169)	0,00
RYL	07/2018	NZD 1.277	\$ 899	34	0	34	0,00
SCX	07/2018	COP 52.331.900	18.650	843	0	843	0,00
	07/2018	£ 809.955	1.076.742	7.399	0	7.399	0,04
	07/2018	NGN 751.122	1.950	0	(126)	(126)	0,00
	07/2018	\$ 1.165	AUD 1.567	0	(7)	(7)	0,00
	07/2018	17.825	£ 13.326	3	(234)	(231)	0,00
	07/2018	64.386	NZD 93.569	0	(1.035)	(1.035)	(0,01)
	08/2018	NGN 2.582.794	\$ 6.877	0	(239)	(239)	0,00
	08/2018	NZD 14.484	9.879	73	0	73	0,00
	09/2018	NGN 2.589.641	6.874	0	(225)	(225)	0,00
	10/2018	1.941.141	5.136	0	(165)	(165)	0,00
	11/2018	1.330.254	3.498	0	(121)	(121)	0,00
	01/2019	\$ 5.432	EGP 101.524	0	(98)	(98)	0,00
SOG	07/2018	ARS 425.037	\$ 15.202	777	0	777	0,00
	07/2018	\$ 15.536	ARS 431.311	0	(822)	(822)	0,00
	07/2018	51.598	COP 147.841.236	0	(1.292)	(1.292)	(0,01)
	07/2018	133.394	TRY 626.566	2.357	(15)	2.342	0,01
	09/2018	ARS 466.140	\$ 15.746	821	0	821	0,00
SSB	07/2018	\$ 958.341	€ 827.368	7.654	0	7.654	0,04
	08/2018	€ 827.368	\$ 960.461	0	(7.631)	(7.631)	(0,04)
	08/2018	\$ 15.758	MXN 314.050	83	0	83	0,00
	09/2018	124	IDR 1.741.172	0	(4)	(4)	0,00
TOR	07/2018	11.710	¥ 1.286.630	0	(95)	(95)	0,00
	08/2018	¥ 1.286.630	\$ 11.735	96	0	96	0,00
UAG	08/2018	MXN 113.557	5.900	172	0	172	0,00
	08/2018	\$ 1.010	ZAR 13.378	0	(38)	(38)	0,00
	09/2018	67.538	RUB 4.245.588	0	(329)	(329)	0,00
				\$ 85.699	\$ (71.144)	\$ 14.555	0,08

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die ausschuttende Investor AUD (Hedged) Class 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	07/2018	AUD 110	\$ 81	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08/2018	\$ 81	AUD 110	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	81	110	0	0	0	0,00
GLM	07/2018	AUD 110	\$ 81	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 81	AUD 110	0	0	0	0,00
HUS	07/2018	81	110	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	81	110	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen fur die ausschuttende Investor CAD (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 83	CAD 110	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BOA	07/2018	CAD 110	\$ 83	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 83	CAD 110	1	0	1	0,00
	08/2018	83	110	1	0	1	0,00
HUS	07/2018	CAD 110	\$ 83	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	\$ 83	CAD 110	1	0	1	0,00
SSB	07/2018	83	110	1	0	1	0,00
				\$ 5	\$ (2)	\$ 3	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class, Investor CHF (Hedged) Class, Administrative CHF (Hedged) Class und Class E CHF (Hedged) 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	07/2018	\$ 417.894	CHF 411.610	\$ 0	\$ (3.361)	\$ (3.361)	(0,02)
BPS	07/2018	CHF 292	\$ 294	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 331	CHF 329	0	0	0	0,00
BRC	07/2018	CHF 169	\$ 172	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 203	CHF 199	0	(3)	(3)	0,00
CBK	07/2018	395.870	391.013	2	(2.083)	(2.081)	(0,01)
GLM	07/2018	CHF 398.502	\$ 399.275	8	(2.064)	(2.056)	(0,01)
	07/2018	\$ 393.790	CHF 389.690	2	(1.336)	(1.334)	(0,01)
	08/2018	397.896	396.140	2.055	0	2.055	0,01
JPM	07/2018	CHF 396.140	\$ 399.797	845	0	845	0,00
	07/2018	\$ 1.426	CHF 1.404	0	(12)	(12)	0,00
	08/2018	400.811	396.140	0	(861)	(861)	0,00
RBC	07/2018	CHF 1.042	\$ 1.060	10	0	10	0,00
SSB	07/2018	\$ 307	CHF 309	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 24.130	CHF 24.020	91	(31)	60	0,00
				\$ 3.015	\$ (9.752)	\$ (6.737)	(0,04)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional CZK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	08/2018	\$ 137	CZK 3.000	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
GLM	08/2018	30.523	647.984	0	(1.384)	(1.384)	(0,01)
IND	08/2018	CZK 7.210	\$ 327	3	0	3	0,00
JPM	08/2018	\$ 62.037	CZK 1.315.200	0	(2.897)	(2.897)	(0,01)
RYL	08/2018	CZK 13.807	\$ 651	30	0	30	0,00
				\$ 33	\$ (4.283)	\$ (4.250)	(0,02)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Currency Exposure) Class, Class E EUR (Currency Exposure) und Class G Retail EUR (Currency Exposure) 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	07/2018	AUD 2.131	\$ 1.573	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07/2018	€ 1.152	1.352	7	0	7	0,00
	08/2018	1.573	AUD 2.131	1	0	1	0,00
BPS	07/2018	34.524	€ 29.766	229	0	229	0,00
	07/2018	1.676	¥ 182.024	0	(33)	(33)	0,00
BRC	07/2018	€ 6	\$ 7	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	204	236	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	\$ 3.063	CAD 3.987	0	(32)	(32)	0,00
	07/2018	210	€ 182	2	0	2	0,00
	07/2018	7.465	£ 5.635	0	(26)	(26)	0,00
GLM	07/2018	€ 146	\$ 172	2	0	2	0,00
	07/2018	£ 98	131	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 1.602	AUD 2.131	0	(27)	(27)	0,00
	07/2018	994	CHF 981	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	76	SEK 669	0	(1)	(1)	0,00
HUS	07/2018	CAD 3.836	\$ 2.883	0	(33)	(33)	0,00
	08/2018	2.885	CAD 3.836	33	0	33	0,00
	09/2018	240	CNH 1.600	0	0	0	0,00
RBC	07/2018	€ 3	\$ 4	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	105	30	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 746	€ 639	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	CAD 151	\$ 117	2	0	2	0,00
	07/2018	€ 4	5	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 161	€ 136	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	168	NZD 239	0	(7)	(7)	0,00
SSB	07/2018	€ 29.208	\$ 34.001	0	(101)	(101)	0,00
	08/2018	\$ 34.076	€ 29.208	99	0	99	0,00
TOR	07/2018	¥ 182.024	\$ 1.657	13	0	13	0,00
	08/2018	\$ 1.660	¥ 182.024	0	(14)	(14)	0,00
UAG	07/2018	£ 5.537	\$ 7.321	11	0	11	0,00
	08/2018	7.331	£ 5.537	0	(12)	(12)	0,00
				\$ 402	\$ (296)	\$ 106	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 1.586.165	€ 1.354.441	\$ 0	\$ (4.787)	\$ (4.787)	(0,03)
	08/2018	7.046	5.889	0	(149)	(149)	0,00
BRC	07/2018	€ 6.615	\$ 7.805	82	0	82	0,00
	07/2018	\$ 2.498	€ 2.160	23	0	23	0,00
CBK	07/2018	€ 18.720	\$ 21.894	94	(56)	38	0,00
	07/2018	\$ 17.273	€ 14.950	182	0	182	0,00
GLM	07/2018	€ 12.631	\$ 14.833	102	(16)	86	0,00
	07/2018	\$ 158.952	€ 135.944	0	(231)	(231)	0,00
MSB	08/2018	8.774	7.325	0	(194)	(194)	0,00
	07/2018	1.833.467	1.571.415	1.302	(64)	1.238	0,01
RBC	07/2018	€ 12.291	\$ 14.275	0	(75)	(75)	0,00
RYL	07/2018	2.373	2.761	0	(10)	(10)	0,00
	07/2018	\$ 90.657	€ 77.530	0	(137)	(137)	0,00
SCX	07/2018	€ 7.130	\$ 8.364	50	(10)	40	0,00
	07/2018	\$ 17.165	€ 14.680	19	(45)	(26)	0,00
SSB	07/2018	€ 1.562.681	\$ 1.810.054	0	(14.456)	(14.456)	(0,08)
	07/2018	\$ 1.825.420	€ 1.576.477	15.197	0	15.197	0,08
UAG	08/2018	1.814.057	1.562.681	14.413	0	14.413	0,08
	07/2018	€ 1.564.089	\$ 1.816.142	0	(10.011)	(10.011)	(0,05)
	08/2018	\$ 1.820.201	€ 1.564.089	9.916	0	9.916	0,05
				\$ 41.380	\$ (30.241)	\$ 11.139	0,06

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Investor GBP (Hedged) Class, Administrative GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged) und Class R GBP (Hedged) 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	07/2018	£ 1.595	\$ 2.114	\$ 12	\$ (4)	\$ 8	0,00
	07/2018	\$ 4.742	£ 3.534	0	(76)	(76)	0,00
BOA	07/2018	1.480.987	1.109.167	0	(16.609)	(16.609)	(0,09)
	07/2018	£ 385	\$ 511	4	0	4	0,00
BRC	07/2018	\$ 178	£ 135	0	0	0	0,00
	07/2018	£ 1.102.128	\$ 1.441.228	12	(13.870)	(13.858)	(0,07)
CBK	07/2018	\$ 377	£ 285	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	1.442.239	1.101.383	13.834	0	13.834	0,07
GLM	07/2018	£ 1.302	\$ 1.740	20	0	20	0,00
	07/2018	\$ 1.470.712	£ 1.110.071	0	(5.140)	(5.140)	(0,03)
RYL	07/2018	£ 1.146	\$ 859	0	(12)	(12)	0,00
	07/2018	\$ 17.066	£ 22.543	11	0	11	0,00
SCX	07/2018	\$ 1.481.557	£ 1.114.460	0	(10.190)	(10.190)	(0,05)
	07/2018	£ 1.686	\$ 2.255	29	0	29	0,00
SSB	07/2018	\$ 1.558	£ 1.171	4	(17)	(13)	0,00
	07/2018	£ 1.101.381	\$ 1.456.304	2.204	0	2.204	0,01
UAG	08/2018	\$ 1.458.365	£ 1.101.381	0	(2.295)	(2.295)	(0,01)
					\$ 16.130	\$ (48.214)	\$ (32.084)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional HUF (Hedged) Class 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	08/2018	\$ 6.671	HUF 1.739.311	\$ 0	\$ (487)	\$ (487)	0,00
BPS	08/2018	6.710	1.740.311	0	(523)	(523)	(0,01)
GLM	08/2018	6.660	1.736.725	0	(486)	(486)	0,00
HUS	08/2018	HUF 25.744	\$ 94	3	0	3	0,00
				\$ 3	\$ (1.496)	\$ (1.493)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional ILS (Hedged) Class 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	08/2018	38.325	ILS 138.227	\$ 0	\$ (468)	\$ (468)	(0,01)
GLM	08/2018	ILS 984	\$ 278	9	0	9	0,00
JPM	08/2018	\$ 24.404	ILS 87.918	0	(326)	(326)	0,00
RYL	08/2018	ILS 1.713	\$ 471	2	0	2	0,00
	08/2018	\$ 56	ILS 200	0	(1)	(1)	0,00
SOG	08/2018	18.200	65.664	0	(217)	(217)	0,00
				\$ 11	\$ (1.012)	\$ (1.001)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional NOK (Hedged) Class 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	07/2018	NOK 305.827	\$ 37.265	\$ 0	\$ (258)	\$ (258)	0,00
	07/2018	\$ 38.904	NOK 317.096	2	0	2	0,00
	08/2018	37.310	305.827	257	0	257	0,00
DUB	07/2018	NOK 228	\$ 28	0	0	0	0,00
GLM	07/2018	30.005	3.700	19	0	19	0,00
HUS	07/2018	\$ 67	NOK 534	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07/2018	38.219	316.850	656	0	656	0,01
SCX	07/2018	NOK 305.886	\$ 37.513	0	(17)	(17)	0,00
	07/2018	\$ 38.635	NOK 318.072	390	0	390	0,00
	08/2018	37.552	305.827	16	0	16	0,00
SSB	07/2018	NOK 1.331	\$ 163	0	0	0	0,00
UAG	07/2018	149	19	0	0	0	0,00
				<b>\$ 1.340</b>	<b>\$ (276)</b>	<b>\$ 1.064</b>	<b>0,01</b>

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional PLN (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 88	PLN 300	\$ 0	\$ (8)	\$ (8)	0,00
CBK	07/2018	PLN 2.178	\$ 603	21	0	21	0,00
GLM	07/2018	1.684	460	11	0	11	0,00
HUS	07/2018	358	99	3	0	3	0,00
	07/2018	\$ 39	PLN 133	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07/2018	PLN 624	\$ 166	0	(1)	(1)	0,00
MSB	07/2018	\$ 6.348	PLN 21.572	0	(586)	(586)	0,00
RBC	07/2018	PLN 600	\$ 172	12	0	12	0,00
RYL	07/2018	105	30	2	0	2	0,00
UAG	07/2018	\$ 332	PLN 1.113	0	(35)	(35)	0,00
				<b>\$ 49</b>	<b>\$ (633)</b>	<b>\$ (584)</b>	<b>0,00</b>

Zum 30. Juni 2018 standen für die ausschüttende Investor RMB (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07/2018	CNH 244	\$ 1.600	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
HUS	09/2018	241	1.600	0	0	0	0,00
				<b>\$ 0</b>	<b>\$ (3)</b>	<b>\$ (3)</b>	<b>0,00</b>

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional SEK (Hedged) Class und Administrative SEK (Hedged) Class 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	07/2018	SEK 2.714	\$ 305	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07/2018	29	SEK 258	0	0	0	0,00
BRC	07/2018	68	584	0	(3)	(3)	0,00
GLM	07/2018	SEK 11.883	\$ 1.351	24	0	24	0,00
	07/2018	\$ 152.291	SEK 1.333.556	0	(3.225)	(3.225)	(0,02)
HUS	07/2018	SEK 6.112	\$ 693	9	0	9	0,00
IND	07/2018	1.316.446	145.972	2	(1.185)	(1.183)	(0,01)
	08/2018	\$ 146.215	SEK 1.315.722	1.184	0	1.184	0,01
JPM	07/2018	150.972	1.337.702	0	(1.441)	(1.441)	(0,01)
RBC	07/2018	SEK 17.384	\$ 1.987	43	0	43	0,00
RYL	07/2018	2.688	307	6	0	6	0,00
SCX	07/2018	1.315.718	147.758	685	0	685	0,00
	08/2018	\$ 148.096	SEK 1.315.718	0	(697)	(697)	0,00
SOG	07/2018	149.641	1.333.254	0	(607)	(607)	0,00
UAG	07/2018	SEK 2.084	\$ 234	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 60	SEK 517	0	(2)	(2)	0,00
				<b>\$ 1.956</b>	<b>\$ (7.160)</b>	<b>\$ (5.204)</b>	<b>(0,03)</b>

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional SGD (Hedged) Class, Investor SGD (Hedged) Class und Class E SGD (Hedged) 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	09/2018	SGD 487	\$ 363	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
BOA	09/2018	19.507	SGD 25.904	0	(478)	(478)	0,00
CBK	09/2018	SGD 37	\$ 28	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 30	SGD 40	0	0	0	0,00
GLM	09/2018	SGD 155	\$ 116	2	0	2	0,00
HUS	09/2018	97	71	0	0	0	0,00
IND	09/2018	204	152	2	0	2	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
NGF	09/2018	\$	5.024	SGD	6.716	\$ 0	\$ (91)	0,00	
RYL	09/2018	SGD	100	\$	75	2	0	0,00	
UAG	09/2018	\$	16.184	SGD	21.586	0	(326)	0,00	
						\$ 12	\$ (895)	\$ (883)	0,00
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ (37.007)</b>		<b>(0,19)</b>	

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	\$ 27.500	\$ (27.999)	(0,15)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (27.999)</b>	<b>(0,15)</b>
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Barclays Bank PLC 1,940 % fällig am 04.09.2018	47.900	47.874	0,25
<b>Summe Einlagenzertifikate</b>		<b>\$ 47.874</b>	<b>0,25</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 20.680.696</b>	<b>108,90</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (1.690.986)</b>	<b>(8,90)</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 18.989.710</b>	<b>100,00</b>

## 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) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(d) 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.

(j) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	2,850 %	25.05.2024	17.05.2017	\$ 3.677	\$ 3.665	0,02
AT&T, Inc.	4,850	25.05.2047	17.05.2017 - 25.09.2017	7.335	7.533	0,04
AWAS Aviation Capital Ltd.	4,870	03.10.2021	02.10.2014	36.467	36.396	0,19
Farm Credit Bank of Texas	10,000	25.05.2020	03.12.2010	4.350	4.610	0,02
				\$ 1.829	\$ 52.204	0,27

(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 979.382 als Sicherheiten verpfändet.

(l) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 43.655 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 287.163 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 131.810 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(m) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 8.597	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 01.01.2022	\$ (8.773)	\$ 8.597	\$ 8.597	0,05
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (8.773)</b>	<b>\$ 8.597</b>	<b>\$ 8.597</b>	<b>0,05</b>

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

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

## Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 266.430	\$ 20.333.323	\$ 56.827	\$ 20.656.580
Einlagen bei Kreditinstituten	0	47.874	0	47.874
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	21.315	(17.364)	290	4.241
Leerverkäufe	0	(27.999)	0	(27.999)
<b>Summen</b>	<b>\$ 287.745</b>	<b>\$ 20.335.834</b>	<b>\$ 57.117</b>	<b>\$ 20.680.696</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 639.422	\$ 21.964.816	\$ 121.641	\$ 22.725.879
Einlagen bei Kreditinstituten	0	48.306	0	48.306
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(8.071)	110.525	356	102.810
Leerverkäufe	0	(28.721)	0	(28.721)
<b>Summen</b>	<b>\$ 631.351</b>	<b>\$ 22.094.926</b>	<b>\$ 121.997</b>	<b>\$ 22.848.274</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 der Wertpapieranlagen.

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BCY	(0,250) %	14.03.2018	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (467)	\$ (467)	0,00
	0,000	18.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(8.021)	(8.027)	(0,04)
	0,950	18.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(833)	(833)	0,00
BOS	2,450	29.06.2018	02.07.2018	(18.180)	(18.182)	(0,10)
BRC	0,000	19.12.2017	TBD <sup>(1)</sup>	€ (7.953)	(9.286)	(0,05)
NXN	1,910	13.04.2018	12.07.2018	\$ (195.000)	(195.817)	(1,03)
	1,990	07.05.2018	05.07.2018	(523.100)	(524.690)	(2,76)
RCY	2,000	18.05.2018	06.07.2018	(85.033)	(85.240)	(0,45)
	2,350	29.06.2018	05.07.2018	(92.276)	(92.288)	(0,49)
SCX	2,120	05.06.2018	06.08.2018	(25.996)	(26.036)	(0,14)
SGY	1,950	29.06.2018	05.07.2018	(5.340)	(5.340)	(0,03)
TDM	1,850	15.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(8.170)	(8.177)	(0,04)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (974.383)</b>	<b>(5,13)</b>

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

## Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkaufgeschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BCY	1,900 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ (42.955)	\$ (42.959)	(0,22)
NOM	2,100	28.06.2018	05.07.2018	(1.220)	(1.221)	(0,01)
<b>Summe Rückkaufgeschäfte</b>					<b>\$ (44.180)</b>	<b>(0,23)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 3 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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (66)	\$ 0	\$ (66)
BOA	(25.214)	58.450	33.236
BPS	1.852	(670)	1.182
BRC	1.423	(450)	973
CBK	(13.503)	26.420	12.917
CKL	(702)	0	(702)
DBL	37	0	37
DUB	(4.894)	(2.210)	(7.104)
FBF	(360)	320	(40)
GLM	(15.139)	22.160	7.021
GST	(1.380)	1.290	(90)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
HUS	\$ (3.037)	\$ 3.610	\$ 573
IND	6	0	6
JPM	6.182	(3.920)	2.262
JPS	(258)	250	(8)
MEI	(1.232)	1.270	38
MSB	6.695	(10.600)	(3.905)
MYC	823	(1.250)	(427)
NGF	(590)	1.040	450
RBC	(113)	0	(113)
RYL	(59)	(340)	(399)
SCX	(3.738)	7.640	3.902
SOG	1.002	1.570	2.572
SSB	15.330	3.220	18.550
UAG	(331)	410	79

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	76,22	75,69
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	28,30	26,19
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	4,26	7,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,11	(0,04)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,10	0,08
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,19)	0,46
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,15)	0,23
Einlagenzertifikate	0,25	(0,14)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(5,13)	(10,20)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,23)	(0,95)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Investment Grade Credit Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	426.804.285	\$ 4.273.232	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	464.019.004	\$ 4.645.600
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	\$ 614.754	606.220	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2027	\$ 1.064.742	1.013.528
U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2027	591.313	565.581	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	614.754	605.338
U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.04.2022	283.460	279.291	U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 28.02.2021	580.400	563.246
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	JPY 25.553.900	240.468	U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 30.04.2023	291.400	275.473
U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 15.02.2048	\$ 212.152	212.667	U.S. Treasury Bonds 2,750 % fällig am 15.08.2047	253.930	239.375
U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.07.2022	168.087	165.283	U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 31.03.2021	234.900	228.587
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.11.2047	167.902	157.185	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.02.2027	204.164	193.329
U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 30.06.2022	136.000	135.193	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.08.2027	173.405	165.387
KBC Group NV 4,250 % fällig am 24.10.2025	€ 74.600	92.090	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.11.2047	167.902	160.152
U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.05.2046	\$ 94.012	85.188	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.05.2024	79.070	75.240
CVS Health Corp. 4,100 % fällig am 25.03.2025	84.300	83.475	U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2046	74.498	67.704
BellSouth LLC 4,333 % fällig am 26.04.2019	79.350	80.462	U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 31.05.2023	62.300	58.837
Italy Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2018	€ 56.500	69.635	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.07.2022	56.100	54.084
JPMorgan Chase & Co. 3,509 % fällig am 23.01.2029	\$ 69.100	69.100	Charter Communications Operating LLC 4,908 % fällig am 23.07.2025	47.911	50.019
AT&T, Inc. 2,975 % fällig am 01.06.2021	67.600	67.600	Endo Luxembourg Finance Co. SARL 6,375 % fällig am 29.04.2024	44.972	44.799
JPMorgan Chase & Co. 3,559 % fällig am 23.04.2024	66.500	66.500	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 466.200	37.637
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	JPY 6.950.000	65.517	Argentina Government International Bond 7,500 % fällig am 22.04.2026	\$ 33.950	33.082
Argentina Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.09.2018	ARS 1.278.231	62.813	Argentina Government International Bond 6,875 % fällig am 26.01.2027	32.400	30.196
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2028	\$ 55.433	54.879	Microsoft Corp. 2,400 % fällig am 06.02.2022	29.000	28.764

(a) Der Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

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 UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
Avolon Holdings Ltd. 4,088 % fällig am 15.01.2025	\$	1.247	0,19	Barclays PLC 4,375 % fällig am 12.01.2026	\$	1.700	0,25	4,375 % fällig am 22.03.2028	\$	400	0,06
Beacon Roofing Supply, Inc. 4,280 % fällig am 02.01.2025		299	0,04	Blackstone CQP Holdco LP 4,972 % fällig am 16.05.2029		800	0,12	7,000 % fällig am 27.06.2019	£	1.400	0,28
Caesars Resort Collection LLC 4,844 % fällig am 22.12.2024		299	0,04	BOC Aviation Ltd. 7,000 % fällig am 15.09.2019 (f)(h)	£	500	0,07	(f)(h)			
CenturyLink, Inc. 4,844 % fällig am 31.01.2025		100	0,01	8,000 % fällig am 15.12.2020 (f)(h)	€	500	0,07	7,875 % fällig am 27.06.2029		300	0,07
Cheniere Energy Partners LP 4,344 % fällig am 25.02.2020		300	0,05	Blackstone CQP Holdco LP 6,500 % fällig am 20.03.2021	\$	50	0,01	(f)(h)			
Core & Main LP 5,211 % - 5,300 % fällig am 01.08.2024		50	0,01	BOC Aviation Ltd. 2,750 % fällig am 18.09.2022		800	0,11	LoanCore Capital Markets LLC 6,875 % fällig am 01.06.2020	\$	250	0,04
Crown Americas LLC 4,312 % fällig am 29.01.2025		200	0,03	Brighthouse Financial, Inc. 4,700 % fällig am 22.06.2047		400	0,05	Mid-America Apartments LP 3,600 % fällig am 01.06.2027		600	0,09
CSC Holdings LLC 4,573 % fällig am 25.01.2026		300	0,04	Brookfield Finance LLC 4,000 % fällig am 01.04.2024		50	0,01	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,190 % fällig am 13.09.2021		50	0,01
Ply Gem Industries, Inc. 6,089 % fällig am 12.04.2025	1.400	1.400	0,21	Brookfield Finance, Inc. 4,700 % fällig am 20.09.2047		500	0,07	Mizuho Bank Ltd. 2,400 % fällig am 26.03.2020		400	0,06
SS&C Technologies Holdings Europe SARL 4,594 % fällig am 16.04.2025	207	207	0,03	Capital One Financial Corp. 3,115 % fällig am 12.05.2020		200	0,03	Mizuho Financial Group, Inc. 3,473 % fällig am 13.09.2021		50	0,01
SS&C Technologies, Inc. 4,594 % fällig am 16.04.2025	546	548	0,08	CIT Group, Inc. 3,875 % fällig am 19.02.2019		100	0,01	Morgan Stanley 2,903 % fällig am 10.02.2021		500	0,07
Wynndham Hotels & Resorts, Inc. 3,726 % fällig am 30.05.2025	500	500	0,08	5,250 % fällig am 19.03.2025		400	0,06	2,903 % fällig am 10.02.2021		200	0,03
		5.434	0,81	Citigroup, Inc. 2,876 % fällig am 24.07.2023		600	0,09	3,125 % fällig am 23.01.2023		100	0,01
				3,320 % fällig am 25.04.2022		100	0,01	3,772 % fällig am 24.01.2029		100	0,01
				4,044 % fällig am 01.06.2024		1.400	0,21	MUFG Bank Ltd 2,300 % fällig am 05.03.2020		400	0,06
				Cooperative Rabobank UA 2,500 % fällig am 19.01.2021		250	0,04	Nasdaq, Inc. 2,722 % fällig am 22.03.2019		1.000	0,15
				5,500 % fällig am 29.06.2020 (f)(h)	€	400	0,07	Nationwide Building Society 3,766 % fällig am 08.03.2024		1.100	0,16
				11,000 % fällig am 30.06.2019 (f)	\$	1.867	0,30	10,250 % (f)	£	2	0,05
				Credit Agricole S.A. 8,125 % fällig am 19.09.2033 (h)		500	0,08	Navient Corp. 5,000 % fällig am 26.10.2020	\$	300	0,04
				Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	1.200	1.279	0,19	8,000 % fällig am 25.03.2020		100	0,02
				Credit Suisse Group AG 2,125 % fällig am 12.09.2025	£	200	0,04	Oxford Finance LLC 6,375 % fällig am 15.12.2022		400	0,06
				3,574 % fällig am 09.01.2023	\$	250	0,04	QBE Insurance Group Ltd. 7,500 % fällig am 24.11.2043 (h)	1.400	1.530	0,23
				3,869 % fällig am 12.01.2029		800	0,11	QNB Finance Ltd. 3,713 % fällig am 07.02.2020	4.000	4.030	0,60
				Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,750 % fällig am 26.03.2025		150	0,02	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	500	508	0,08
				4,550 % fällig am 17.04.2026	1.000	1.002	0,15	9,250 % fällig am 06.07.2024	647	696	0,10
				Deutsche Bank AG 2,500 % fällig am 13.02.2019	600	596	0,09	Royal Bank of Scotland Group PLC 4,892 % fällig am 18.05.2029	700	698	0,10
				3,150 % fällig am 22.01.2021	800	775	0,12	7,500 % fällig am 10.08.2020 (f)(h)	50	51	0,01
				3,312 % fällig am 13.07.2020	100	99	0,01	Santander Holdings USA, Inc. 3,700 % fällig am 28.03.2022	100	99	0,01
				3,520 % fällig am 16.11.2022	800	775	0,12	Santander UK Group Holdings PLC 2,875 % fällig am 05.08.2021	200	194	0,03
				4,250 % fällig am 14.10.2021	300	296	0,04	3,373 % fällig am 05.01.2024	2.400	2.310	0,35
				General Motors Financial Co., Inc. 3,187 % fällig am 09.04.2021	700	704	0,11	Santander UK PLC 2,500 % fällig am 14.03.2019	100	100	0,01
				Goldman Sachs Group, Inc. 2,876 % fällig am 31.10.2022	900	879	0,13	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 4,150 % fällig am 06.03.2019 (i)	1.000	1.000	0,15
				3,200 % fällig am 23.02.2023	1.100	1.073	0,16	Springleaf Finance Corp. 5,250 % fällig am 15.12.2019	100	102	0,02
				3,691 % fällig am 05.06.2028	100	95	0,01	5,625 % fällig am 15.03.2023	500	499	0,07
				3,750 % fällig am 22.05.2025	50	49	0,01	6,000 % fällig am 01.06.2020	100	103	0,02
				HSBC Holdings PLC 3,326 % fällig am 18.05.2024	500	499	0,07	6,125 % fällig am 15.05.2022	100	103	0,02
				3,400 % fällig am 08.03.2021	200	200	0,03	7,750 % fällig am 01.10.2021	100	108	0,02
				6,000 % fällig am 29.03.2040	£	100	0,03	8,250 % fällig am 15.12.2020	200	216	0,03
				6,250 % fällig am 23.03.2023 (f)(h)	\$	1.000	0,15	Standard Chartered PLC 3,461 % fällig am 19.08.2019	50	50	0,01
				International Lease Finance Corp. 8,250 % fällig am 15.12.2020	100	110	0,02	Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % (f)	€	450	0,09
				Intesa Sanpaolo SpA 3,875 % fällig am 12.01.2028	1.400	1.202	0,18	Synchrony Bank 3,000 % fällig am 15.06.2022	\$	250	0,04
				6,250 % fällig am 16.05.2024 (f)(h)	€	700	0,10	Toronto-Dominion Bank 3,331 % fällig am 07.04.2021	100	102	0,02
				7,700 % fällig am 17.09.2025 (f)(h)	\$	800	0,11	Toyota Motor Credit Corp. 2,721 % fällig am 17.05.2022	3.000	3.010	0,45
				7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h)	€	300	0,06	UBS AG 2,639 % fällig am 07.12.2018	1.400	1.401	0,21
				Jefferies Finance LLC 7,375 % fällig am 01.04.2020	\$	200	0,03	2,901 % fällig am 08.06.2020	1.400	1.405	0,21
				JPMorgan Chase & Co. 2,776 % fällig am 25.04.2023	1.300	1.261	0,19	5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)	100	100	0,01
				3,220 % fällig am 01.03.2025	100	97	0,01	7,625 % fällig am 17.08.2022 (h)	500	553	0,08
				3,260 % fällig am 25.04.2023	100	101	0,02	UBS Group AG 7,125 % fällig am 19.02.2020 (f)(h)	1.300	1.337	0,20
				3,589 % fällig am 24.10.2023	1.000	1.019	0,15	UniCredit SpA 9,250 % fällig am 03.06.2022 (f)(h)	€	800	0,16
				3,900 % fällig am 15.07.2025	50	50	0,01	Wand Merger Corp. 8,125 % fällig am 15.07.2023 (a)	\$	1.300	0,20
				Kennedy-Wilson, Inc. 5,875 % fällig am 01.04.2024	1.000	975	0,15				
				Lloyds Bank PLC 12,000 % fällig am 16.12.2024 (f)	100	123	0,02				
				Lloyds Banking Group PLC 3,000 % fällig am 11.01.2022	200	195	0,03				





# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Libor Plus 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
<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>			
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.	\$ 750	\$ 750	0,11	SoFi Consumer Loan Program Trust	\$ 752	\$ 749	0,11	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
3,279 % fällig am 20.04.2027				2,550 % fällig am 25.02.2027				<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
Jamestown CLO Ltd.				Sound Point CLO Ltd.				Southern Co.	\$ 400	\$ 400	0,06
3,038 % fällig am 15.07.2026	761	758	0,11	3,208 % fällig am 15.04.2027	1.300	1.300	0,19	Syngenta Wilmington	2.300	2.296	0,34
3,190 % fällig am 25.07.2027	700	697	0,10	Soundview Home Loan Trust				3,050 % fällig am 27.07.2018			
3,218 % fällig am 15.01.2028	900	897	0,13	2,341 % fällig am 25.10.2036	600	571	0,09				
3,488 % fällig am 15.01.2026	768	768	0,12	2,351 % fällig am 25.02.2037	1.201	520	0,08				
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				SpringCastle America Funding LLC							
2,231 % fällig am 25.07.2036	37	37	0,01	3,050 % fällig am 25.04.2029	56	56	0,01				
Long Beach Mortgage Loan Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				<b>PENSIONSGESCHÄFTE (j)</b>			
2,311 % fällig am 25.02.2036	978	953	0,14	3,482 % fällig am 25.04.2035	124	122	0,02				
2,701 % fällig am 25.08.2035	4.270	3.927	0,59	THL Credit Wind River CLO Ltd.					108.837	16,30	
Marathon CLO Ltd.				3,218 % fällig am 15.10.2027	700	701	0,11	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
3,201 % fällig am 21.11.2027	1.000	998	0,15	TICP CLO Ltd.				Harris Corp.			
Monarch Grove CLO				3,159 % fällig am 20.07.2027	1.500	1.498	0,22	2,794 % fällig am 27.02.2019	1.800	1.801	0,27
3,240 % fällig am 25.01.2028	2.400	2.401	0,36	Tralea CLO Ltd.				Letras del Banco Central de la Republica Argentina			
Monroe Capital BSL CLO Ltd.				3,389 % fällig am 20.10.2027	900	901	0,13	33,500 % fällig am 18.07.2018 ARS	700	24	0,00
3,449 % fällig am 22.05.2027	200	200	0,03	U.S. Residential Opportunity Fund Trust				37,800 % fällig am 21.11.2018	860	26	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				3,352 % fällig am 27.11.2037	423	422	0,06				
2,216 % fällig am 25.07.2036	771	673	0,10	Venture CLO Ltd.							
2,231 % fällig am 25.05.2037	2.499	2.287	0,34	3,168 % fällig am 15.04.2027	1.250	1.244	0,19	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
2,321 % fällig am 25.10.2036	1.604	1.063	0,16	3,198 % fällig am 15.01.2028	700	701	0,11	(14,311)% fällig am			
2,341 % fällig am 25.04.2036	183	172	0,03	VOLT LLC				14.09.2018 (c)(d)	610	22	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				3,125 % fällig am 25.06.2047	52	52	0,01	(12,971)% fällig am			
2,431 % fällig am 25.02.2036	1.800	1.682	0,25	3,125 % fällig am 25.09.2047	794	789	0,12	14.09.2018 (c)(d)	777	28	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				3,250 % fällig am 25.06.2047	288	287	0,04	(3,247)% fällig am 12.10.2018			
5,728 % fällig am 25.10.2036	387	210	0,03	3,375 % fällig am 25.04.2047	40	40	0,01	(c)(d)	1.210	43	0,01
Mountain View CLO Ltd.				3,500 % fällig am 25.03.2047	133	133	0,02	(2,723)% fällig am 12.10.2018			
3,162 % fällig am 13.10.2027	1.700	1.694	0,25	Voya CLO Ltd.				(c)(d)	240	8	0,00
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				3,080 % fällig am 25.07.2026	1.600	1.595	0,24	(0,978)% fällig am 12.10.2018			
2,491 % fällig am 25.02.2037 ^	4.034	1.914	0,29	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				(c)(d)	1.670	59	0,01
NovaStar Mortgage Funding Trust				3,816 % fällig am 25.11.2035	100	101	0,02	2,799 % fällig am 27.07.2018			
2,251 % fällig am 25.09.2037	102	100	0,02	Z Capital Credit Partners CLO Ltd.				(c)(d)	\$ 400	399	0,06
2,411 % fällig am 25.05.2036	156	155	0,02	3,298 % fällig am 16.07.2027	1.800	1.801	0,27	2,830 % fällig am 13.07.2018			
OCP CLO Ltd.								(c)(d)	1.600	1.598	0,24
3,148 % fällig am 15.07.2027	1.500	1.499	0,22					25,300 % fällig am			
3,182 % fällig am 26.10.2027	1.300	1.299	0,19					19.09.2018 (c)(d)	36.200	1.151	0,17
3,203 % fällig am 17.04.2027	900	899	0,13					39,900 % fällig am 19.09.2018	9.450	301	0,05
OFSI Fund Ltd.								(c)(d)			
2,998 % fällig am 20.03.2025	2.000	2.001	0,30	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
3,255 % fällig am 18.10.2026	200	200	0,03	Argentina Government International Bond				5,875 % fällig am 11.01.2028	3.500	2.855	0,43
Option One Mortgage Loan Trust				21,200 % fällig am 19.09.2018 ARS	660	22	0,00	34,188 % fällig am 03.04.2022	7.110	225	0,03
2,231 % fällig am 25.01.2037	76	50	0,01	34,660 % fällig am 01.03.2020	200	7	0,00	40,000 % fällig am 21.06.2020	46.311	1.673	0,25
2,231 % fällig am 25.02.2037	946	714	0,11	Autonomous Community of Catalonia				4,900 % fällig am 15.09.2021 €	850	1.079	0,16
2,231 % fällig am 25.03.2037	1.327	1.203	0,18	4,950 % fällig am 11.02.2020	300	371	0,06	Qatar Government International Bond			
2,311 % fällig am 25.04.2037	933	739	0,11	3,875 % fällig am 23.04.2023 \$	1.000	1.001	0,15	4,500 % fällig am 23.04.2028	1.200	1.213	0,18
2,311 % fällig am 25.05.2037	997	719	0,11	4,500 % fällig am 17.04.2030	5.700	5.704	0,86	Saudi Government International Bond			
RAAC Trust								3,250 % fällig am 26.10.2026	100	94	0,01
2,471 % fällig am 25.10.2046	183	180	0,03					3,625 % fällig am 04.03.2028	1.600	1.525	0,23
Residential Asset Securities Corp. Trust								4,500 % fällig am 17.04.2030	5.700	5.704	0,86
2,261 % fällig am 25.11.2036	119	102	0,02								
2,341 % fällig am 25.04.2037	58	57	0,01								
2,501 % fällig am 25.01.2036	74	74	0,01								
RMAT LP											
4,090 % fällig am 25.05.2048	1.901	1.904	0,29								
Saratoga Investment Corp. CLO Ltd.											
3,909 % fällig am 20.10.2025	250	251	0,04								
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust											
2,751 % fällig am 25.08.2035 ^	128	88	0,01	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>							
Sierra Madre Funding Ltd.				PIMCO Fixed Income Source ETFs							
2,405 % fällig am 07.09.2039	5.465	4.891	0,73	plc - PIMCO US Dollar Short	614.500	62.347	9,34				
SoFi Consumer Loan Program LLC				Maturity Source UCITS ETF (g)							
2,770 % fällig am 25.05.2026	148	147	0,02								

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
90-Day Eurodollar June Futures	Short	06/2019	2	\$ 5	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	180	(487)	(0,07)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	288	53	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09/2018	11	(50)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	6	(36)	(0,01)
				\$ (515)	(0,08)

**VERKAUFSOPTIONEN****OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRÄKTE**

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens	
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 118,000	27.07.2018	116	\$ (29)	\$ (4)	0,00	
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	119,500	27.07.2018	96	(41)	(18)	0,00	
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	121,500	27.07.2018	96	(36)	(10)	0,00	
				<u>\$ (106)</u>	<u>\$ (32)</u>	<u>0,00</u>	
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate						<u>\$ (547)</u>	<u>(0,08)</u>

**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>(2)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Daimler AG	1,000 %	20.12.2020	€ 1.000	\$ (1)	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.12.2022	\$ 50	0	0,00
				<u>\$ (1)</u>	<u>0,00</u>

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2022	€ 350	\$ 4	0,00
iTraxx Europe Senior 27 5-Year Index	(1,000)	20.06.2022	100	2	0,00
iTraxx Europe Subordinated 27 5-Year Index	(1,000)	20.06.2022	2.300	56	0,01
				<u>\$ 62</u>	<u>0,01</u>

**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.HY-30 5-Year Index	5,000 %	20.06.2023	\$ 6.600	\$ (8)	0,00
CDX.IG-30 5-Year Index	1,000	20.06.2023	36.400	(45)	(0,01)
				<u>\$ (53)</u>	<u>(0,01)</u>

**ZINSSWAPS**

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,500 %	02.01.2020	BRL 93.400	\$ (207)	(0,03)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.06.2027	\$ 1.400	60	0,01	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.12.2026	100	4	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.12.2019	400	5	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	1.900	11	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	15.040	16	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	195	15	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027	38.260	1.146	0,17	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	14.740	(268)	(0,04)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	800	68	0,01	
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	€ 25.920	423	0,06	
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.12.2023	5.600	57	0,01	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.09.2048	5.110	(179)	(0,03)	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.12.2048	200	(6)	0,00	
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.12.2023	£ 3.000	(15)	0,00	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	34.100	(307)	(0,04)	
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.03.2026	¥ 2.660.000	(88)	(0,01)	
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	1.430.000	(122)	(0,02)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	530.000	(13)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,350	30.09.2027	MXN 99.500	(109)	(0,01)	
					<u>\$ 491</u>	<u>0,08</u>	
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						<u>\$ 499</u>	<u>0,08</u>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 der Wertpapieranlagen des Global Libor Plus Bond Fund (Forts.)

<sup>(2)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* 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	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,945 %	11.12.2019	\$ 4.800	\$ 227	\$ 315	0,05
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,943	12.12.2019	2.400	115	158	0,02
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,650	15.11.2018	1.400	8	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,050	12.12.2018	250	12	7	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,945	11.12.2019	2.100	185	137	0,02
							\$ 547	\$ 617	0,09

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750 %	11.12.2019	\$ 21.200	\$ (227)	\$ (444)	(0,07)
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	12.12.2019	10.600	(116)	(222)	(0,03)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,700	12.12.2018	1.200	(13)	(18)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	11.12.2019	8.100	(195)	(169)	(0,03)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,000	15.11.2018	300	(8)	0	0,00
							\$ (559)	\$ (853)	(0,13)

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 98,078	05.07.2018	\$ 24.000	\$ (56)	\$ 0	0,00

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% 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	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Argentine Republic Government International Bond	5,000 %	20.12.2022	\$ 400	\$ 47	\$ (37)	\$ 10	0,00
	Colombia Government International Bond	0,000	20.12.2022	400	(3)	1	(2)	0,00
	Russia Government International Bond	0,000	20.06.2023	3.600	(56)	(11)	(67)	(0,01)
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	100	(3)	4	1	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2018	2.500	16	(7)	9	0,00
GST	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.06.2022	200	18	(12)	6	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	200	(3)	2	(1)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.03.2019	1.000	1	(1)	0	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	0	0	0	0	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	600	(38)	(6)	(44)	(0,01)
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	500	(16)	(14)	(30)	0,00
					\$ (37)	\$ (81)	\$ (118)	(0,02)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,000 %	17.11.2059	\$ 2.200	\$ (9)	\$ (1)	\$ (10)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	100	(4)	4	0	0,00

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,000 %	17.11.2059	\$ 1.500	\$ (3)	\$ (4)	\$ (7)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	300	(10)	8	(2)	0,00
					\$ (26)	\$ 7	\$ (19)	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps entspricht, und erhält 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	07/2018	ARS 6.800	\$ 270	\$ 34	\$ 0	\$ 34	0,01
	07/2018	\$ 8.218	AUD 11.133	7	0	7	0,00
	08/2018	AUD 11.133	\$ 8.219	0	(7)	(7)	0,00
BPS	08/2018	\$ 5.557	RUB 345.485	0	(77)	(77)	(0,01)
	09/2018	SGD 7.081	\$ 5.332	131	0	131	0,02
	07/2018	ARS 4.605	166	8	0	8	0,00
BRC	07/2018	€ 27.721	32.152	0	(213)	(213)	(0,03)
	07/2018	¥ 389.720	3.588	70	0	70	0,01
	07/2018	\$ 246	ARS 6.800	0	(10)	(10)	0,00
CBK	09/2018	660	EGP 12.114	0	0	0	0,00
	07/2018	€ 365	\$ 428	2	0	2	0,00
	09/2018	\$ 2.791	ARS 77.547	0	(305)	(305)	(0,05)
GLM	07/2018	£ 9.652	\$ 12.788	45	0	45	0,01
	07/2018	\$ 4.425	€ 3.787	12	(15)	(3)	0,00
	08/2018	273	MXN 5.242	0	(9)	(9)	0,00
HUS	08/2018	2.960	TRY 13.103	0	(153)	(153)	(0,02)
	09/2018	996	EGP 18.230	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	AUD 11.133	\$ 8.369	144	0	144	0,02
MSB	07/2018	BRL 25.085	6.536	85	(69)	16	0,00
	07/2018	€ 661	771	2	(3)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 1.148	€ 976	1	(10)	(9)	0,00
NGF	07/2018	CAD 4.146	\$ 3.199	47	0	47	0,01
	07/2018	€ 22	25	0	0	0	0,00
	07/2018	£ 2.000	2.619	0	(22)	(22)	0,00
RBC	07/2018	\$ 1.990	BRL 7.410	0	(64)	(64)	(0,01)
	07/2018	428	€ 367	0	0	0	0,00
	08/2018	MXN 2.768	\$ 139	0	(1)	(1)	0,00
SCX	08/2018	\$ 1.155	RUB 72.209	0	(10)	(10)	0,00
	10/2018	770	EGP 14.180	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	4.691	BRL 17.675	0	(97)	(97)	(0,01)
SSB	08/2018	BRL 17.675	\$ 4.678	100	0	100	0,01
	10/2018	\$ 300	EGP 5.509	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	TWD 156.623	\$ 5.286	122	0	122	0,02
TOR	08/2018	€ 7.200	8.912	469	0	469	0,07
	07/2018	\$ 565	EGP 10.788	33	0	33	0,00
	07/2018	27.973	€ 24.030	83	0	83	0,01
UAG	08/2018	€ 24.030	\$ 28.035	0	(82)	(82)	(0,01)
	07/2018	¥ 45.600	416	4	0	4	0,00
	07/2018	\$ 3.962	¥ 435.320	0	(32)	(32)	(0,01)
UAG	08/2018	¥ 435.320	\$ 3.970	32	0	32	0,00
	07/2018	€ 303	356	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 12.762	£ 9.652	0	(19)	(19)	0,00
	08/2018	£ 9.652	\$ 12.780	20	0	20	0,00
				\$ 1.453	\$ (1.201)	\$ 252	0,04

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class Accumulation Shares, Institutional EUR (Hedged) Class Income Shares, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) Class und Class G Institutional EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 8.991	€ 7.659	\$ 0	\$ (48)	\$ (48)	(0,01)
BPS	07/2018	9.021	7.778	60	0	60	0,01
BRC	07/2018	155	132	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2018	153	131	1	(1)	0	0,00
GLM	07/2018	35	30	0	0	0	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Libor Plus Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
MSB	07/2018	€ 9.596	\$ 11.083	\$ 0	\$ (121)	\$ (121)	(0,02)
	08/2018	\$ 11.108	€ 9.596	121	0	121	0,02
RBC	07/2018	€ 47	\$ 40	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	€ 590	\$ 693	5	0	5	0,00
	07/2018	\$ 264	€ 226	1	(1)	0	0,00
SCX	07/2018	€ 15	\$ 17	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 6.497	€ 5.508	0	(66)	(66)	(0,01)
SSB	07/2018	€ 9.536	\$ 11.101	0	(33)	(33)	0,00
	07/2018	\$ 9.069	€ 7.793	30	0	30	0,00
	08/2018	11.126	9.536	32	0	32	0,01
TOR	07/2018	2	2	0	0	0	0,00
				\$ 250	\$ (271)	\$ (21)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 4.168	£ 3.100	\$ 0	\$ (75)	\$ (75)	(0,01)
BOA	07/2018	208.038	£ 155.807	0	(2.333)	(2.333)	(0,35)
BRC	07/2018	£ 159.968	\$ 209.184	0	(2.014)	(2.014)	(0,30)
	08/2018	\$ 209.475	£ 159.968	2.009	0	2.009	0,30
CBK	07/2018	£ 124	\$ 166	3	0	3	0,00
	07/2018	\$ 209.167	£ 157.877	0	(730)	(730)	(0,11)
GLM	07/2018	£ 930	\$ 1.240	12	0	12	0,00
RYL	07/2018	\$ 6	£ 4	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	215.151	£ 161.825	0	(1.501)	(1.501)	(0,23)
UAG	07/2018	£ 158.935	\$ 210.152	318	0	318	0,05
	08/2018	\$ 210.449	£ 158.935	0	(331)	(331)	(0,05)
				\$ 2.342	\$ (6.984)	\$ (4.642)	(0,70)
<b>Summe Freiverkehrsfina n z d e r i v a t e</b>						<b>\$ (4.784)</b>	<b>(0,72)</b>

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMOGENS
<b>INLAGENZERTIFIKATE</b>			
Barclays Bank PLC			
1,940 % fallig am 04.09.2018	\$ 350	\$ 350	0,05
Credit Suisse AG			
2,722 % fallig am 28.09.2018	2.000	2.002	0,30
<b>Summe Einlagenzertifikate</b>		<b>\$ 2.352</b>	<b>0,35</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 733.221</b>	<b>109,79</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (65.361)</b>	<b>(9,79)</b>
<b>Nettovermogen</b>		<b>\$ 667.860</b>	<b>100,00</b>

## ERLA U T E R U N G E N Z U R A U F S T E L L U N G D E R W E R T P A P I E R A N L A G E N (A n g a b e n i n T a u s e n d \*):

\* 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) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Hohe von USD 6.591 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Hohe von USD 10.870 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

(i) Eingeschrankte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Falligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.	4,150 %	06.03.2019	16.01.2018	\$ 1.005	\$ 1.000	0,15

## (j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	2,220 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 40.100	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 15.05.2024	\$ (40.910)	\$ 40.100	\$ 40.910	6,00
NOM	2,220	29.06.2018	02.07.2018	67.300	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044	(68.533)	67.300	67.308	10,08
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	1.437	U.S. Treasury Notes 0,800 % fällig am 15.11.2021	(1.437)	1.437	1.471	0,22
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (110.880)</b>	<b>\$ 108.837</b>	<b>\$ 109.689</b>	<b>16,30</b>

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

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 65.441	\$ 668.261	\$ 1.999	\$ 735.701
Einlagen bei Kreditinstituten	0	2.352	0	2.352
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(547)	(4.285)	0	(4.832)
<b>Summen</b>	<b>\$ 64.894</b>	<b>\$ 666.328</b>	<b>\$ 1.999</b>	<b>\$ 733.221</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 52.276	\$ 481.650	\$ 876	\$ 534.802
Einlagen bei Einlagen bei Kreditinstituten	0	350	0	350
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	23	2.803	0	2.826
<b>Summen</b>	<b>\$ 52.299</b>	<b>\$ 484.803</b>	<b>\$ 876</b>	<b>\$ 537.978</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (75)	\$ 0	\$ (75)
BOA	(2.481)	4.640	2.159
BPS	(85)	0	(85)
BRC	(299)	260	(39)
CBK	(848)	2.520	1.672
GLM	98	0	98
GST	(5)	0	(5)
HUS	(95)	40	(55)
MSB	2	50	52
MYC	(73)	0	(73)
NGF	122	0	122
RBC	469	(550)	(81)
RYL	5	0	5
SAL	(7)	0	(7)
SCX	(1.534)	3.360	1.826
SSB	30	0	30
TOR	4	0	4
UAG	(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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	55,77	50,13
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	28,19	27,54
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	26,20	21,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,08)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,08	(0,03)
Freiverkehrsfinaanzderivate	(0,72)	0,55
Einlagenzertifikate	0,35	0,07

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Libor Plus Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	4.099.426	\$ 41.041	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	4.627.695	\$ 46.330
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 31.01.2023	\$ 40.100	39.535	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.03.2025	\$ 36.800	36.202
U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.03.2025	36.800	36.371	U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.01.2023	35.400	34.016
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	¥ 3.690.000	34.629	U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 31.01.2023	19.800	19.467
U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.01.2020	\$ 20.800	20.705	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	10.300	10.194
	<b>AKTIEN</b>		U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.08.2022	10.000	9.740
PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)	182.500	18.530	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 15.01.2018	¥ 1.020.500	9.164
	<b>PARI (000S)</b>		U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.08.2027	\$ 9.100	8.639
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.06.2018	¥ 1.590.000	14.995	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2024	6.800	6.564
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 07.05.2018	1.380.000	12.621	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 28.02.2023	5.800	5.819
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2027(b)	\$ 8.926	10.157	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 31.03.2023	5.700	5.632
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	10.300	10.128	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 15.05.2025	4.500	4.282
U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.08.2027	9.100	8.733	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2027	3.000	2.844
Greece Treasury Bills 0,000 % fällig am 31.08.2018	€ 7.200	8.729	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 31.05.2025	2.100	2.097
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 23.04.2018	¥ 751.000	6.771	Altice France S.A. 0,000 % fällig am 15.05.2024	€ 1.100	1.334
Italy Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2018	€ 5.000	6.183	Letras del Banco Central de la Republica Argentina 27,700 % fällig am 18.04.2018	ARS 24.470	1.131
U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 28.02.2023	\$ 5.800	5.792	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.06.2024	\$ 1.000	954
U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 31.03.2023	5.700	5.683	Letras del Banco Central de la Republica Argentina 27,700 % fällig am 18.04.2018	ARS 17.320	850
Saudi Government International Bond 4,500 % fällig am 17.04.2030	5.700	5.668	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025(b)	\$ 654	739
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	¥ 600.000	5.301	Southern Power Co. 2,875 % fällig am 20.12.2020	400	401
Sierra Madre Funding Ltd. 2,405 % fällig am 07.09.2039	\$ 5.849	5.220			
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 01.05.2018	¥ 490.000	4.510			

(a) Der Global Libor Plus Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Nennbetrag des Wertpapiers wurde 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return 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>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Andeavor Logistics LP</b>					
Cooperative Rabobank UA				Barclays PLC				5.500 % fällig am 15.10.2019	\$	5.100	\$ 5.234	0,34	
5,500 % fällig am 29.06.2020 (e)(g)	€	800	1.000	0,07	6,500 % fällig am 15.09.2019 (e)(g)	€	200	\$ 241	0,02	2,975 % fällig am 01.06.2021	2.300	2.310	0,15
6,625 % fällig am 29.06.2021 (e)(g)		200	263	0,02	7,000 % fällig am 15.09.2019 (e)(g)	£	400	541	0,04	3,298 % fällig am 15.07.2021	5.800	5.858	0,38
<b>ING Bank NV</b>				8,000 % fällig am 15.12.2020 (e)(g)	€	880	1.140	0,07	5,000 % fällig am 01.03.2021	100	104	0,01	
2,625 % fällig am 05.12.2022	\$	700	685	0,04	<b>BAT International Finance PLC</b>				5,150 % fällig am 15.02.2050	1.400	1.309	0,08	
<b>Mylan NV</b>				2,750 % fällig am 15.06.2020	\$	3.500	3.463	0,22	<b>Bank of America Corp.</b>				
3,150 % fällig am 15.06.2021		1.000	990	0,06	Lloyds Banking Group PLC				4,600 % fällig am 21.10.2025	MXN	7.000	456	0,03
3,750 % fällig am 15.12.2020		600	604	0,04	3,130 % fällig am 21.06.2021	1.100	1.100	0,07	<b>BAT Capital Corp.</b>				
			3.542	0,23	Royal Bank of Scotland Group PLC				2,297 % fällig am 14.08.2020	\$	600	587	0,04
Summe Niederlande			20.205	1,30	3,885 % fällig am 25.06.2024	1.600	1.598	0,10	2,945 % fällig am 14.08.2020	4.200	4.215	0,27	
					4,519 % fällig am 25.06.2024	1.000	1.002	0,06	<b>Boston Scientific Corp.</b>				
					7,500 % fällig am 10.08.2020 (e)(g)	530	542	0,04	6,000 % fällig am 15.01.2020	700	730	0,05	
					8,625 % fällig am 15.08.2021 (e)(g)	200	213	0,01	<b>Charter Communications Operating LLC</b>				
							9.840	0,63	3,579 % fällig am 23.07.2022	920	919	0,06	
									4,464 % fällig am 23.07.2022	220	223	0,01	
									<b>CIT Group, Inc.</b>				
									3,875 % fällig am 19.02.2019	150	151	0,01	
									<b>CNH Industrial Capital LLC</b>				
									4,375 % fällig am 06.11.2020	3.800	3.869	0,25	
									<b>Consolidated Edison Co. of New York, Inc.</b>				
									2,739 % fällig am 25.06.2021	600	601	0,04	
									<b>CVS Health Corp.</b>				
									3,700 % fällig am 09.03.2023	8.800	8.765	0,56	
									<b>D.R. Horton, Inc.</b>				
									4,000 % fällig am 15.02.2020	1.900	1.919	0,12	
									<b>Dell International LLC</b>				
									3,480 % fällig am 01.06.2019	4.355	4.367	0,28	
									4,420 % fällig am 15.06.2021	12.200	12.387	0,80	
									<b>Delta Air Lines, Inc.</b>				
									3,625 % fällig am 15.03.2022	800	792	0,05	
									<b>Discovery Communications LLC</b>				
									3,035 % fällig am 20.09.2019	900	904	0,06	
									<b>DISH DBS Corp.</b>				
									7,875 % fällig am 01.09.2019	500	520	0,03	
									<b>Dominion Energy Gas Holdings LLC</b>				
									2,926 % fällig am 15.06.2021	1.100	1.100	0,07	
									<b>eBay, Inc.</b>				
									2,750 % fällig am 30.01.2023	1.300	1.254	0,08	
									3,229 % fällig am 30.01.2023	200	201	0,01	
									<b>EMC Corp.</b>				
									2,650 % fällig am 01.06.2020	3.000	2.915	0,19	
									<b>Emera U.S. Finance LP</b>				
									2,700 % fällig am 15.06.2021	300	292	0,02	
									<b>EQT Corp.</b>				
									2,500 % fällig am 01.10.2020	1.500	1.466	0,09	
									3,107 % fällig am 01.10.2020	900	901	0,06	
									<b>GATX Corp.</b>				
									3,083 % fällig am 05.11.2021	5.500	5.528	0,36	
									<b>General Motors Financial Co., Inc.</b>				
									2,350 % fällig am 04.10.2019	100	99	0,01	
									<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>				
									2,876 % fällig am 31.10.2022	1.800	1.758	0,11	
									3,541 % fällig am 15.09.2020	2.300	2.335	0,15	
									<b>HCA, Inc.</b>				
									3,750 % fällig am 15.03.2019	1.000	1.006	0,06	
									<b>International Lease Finance Corp.</b>				
									6,250 % fällig am 15.05.2019	200	205	0,01	
									8,250 % fällig am 15.12.2020	2.500	2.758	0,18	
									<b>Komatsu Finance America, Inc.</b>				
									2,118 % fällig am 11.09.2020	700	684	0,04	
									2,437 % fällig am 11.09.2022	2.700	2.596	0,17	
									<b>Kraft Heinz Foods Co.</b>				
									2,800 % fällig am 02.07.2020	500	497	0,03	
									<b>MGM Resorts International</b>				
									5,250 % fällig am 31.03.2020	100	102	0,01	
									6,750 % fällig am 01.10.2020	1.100	1.155	0,07	
									<b>Navigent Corp.</b>				
									4,875 % fällig am 17.06.2019	2.850	2.868	0,18	
									5,000 % fällig am 26.10.2020	1.900	1.900	0,12	
									5,500 % fällig am 15.01.2019	1.600	1.615	0,10	
									5,875 % fällig am 25.03.2021	100	102	0,01	
									8,000 % fällig am 25.03.2020	2.500	2.644	0,17	
									<b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b>				
									2,636 % fällig am 03.09.2019	3.300	3.307	0,21	



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	113	\$ (97)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	295	303	0,02
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	5	12	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	232	(364)	(0,02)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	12	(21)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 157.000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	67	38	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09/2018	15	7	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	317	59	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	380	76	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09/2018	558	(579)	(0,04)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09/2018	595	(2.376)	(0,15)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	7	(42)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	237	(362)	(0,02)
				\$ (3.640)	(0,23)

### VERKAUFSoPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	\$ 141,000	27.07.2018	20	\$ (19)	\$ (1)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	142,000	27.07.2018	25	(17)	(4)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	143,000	27.07.2018	76	(58)	(24)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	145,000	27.07.2018	39	(23)	(39)	(0,01)
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	146,000	27.07.2018	40	(24)	(24)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	146,500	27.07.2018	38	(24)	(17)	0,00
				\$ (165)	\$ (109)	(0,01)
					\$ (3.749)	(0,24)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

#### 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>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.06.2022	\$ 100	\$ 2	0,00
Daimler AG	1,000	20.12.2020	€ 650	0	0,00
Simon Property Group LP	1,000	20.06.2022	\$ 4.000	75	0,01
				\$ 77	0,01

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-30 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2023	\$ 6.175	\$ 33	0,00
iTraxx Europe Main 26 5-Year Index	(1,000)	20.12.2021	€ 7.400	(43)	(0,01)
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	29.400	275	0,02
				\$ 265	0,01

#### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000 %	15.12.2047	\$ 8.110	\$ 746	0,05
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,428	20.12.2047	1.400	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,478	20.12.2047	2.494	(39)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,499	20.12.2047	1.160	(19)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,970	04.01.2027	BRL 17.900	52	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	20.06.2020	\$ 49.800	28	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.12.2026	9.060	1.034	0,07
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,950	08.11.2026	41.000	214	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.12.2019	500	9	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	55.900	(178)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,000	27.07.2026	58.700	796	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,150	19.06.2048	1.200	86	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	16.12.2022	33.900	(1.154)	(0,07)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	89.000	(2.524)	(0,16)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	28.000	182	0,01

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250 %	20.06.2028	\$ 38.600	\$ 153	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,400	07.12.2026	80.500	1.263	0,08
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,500	19.12.2023	10.200	(129)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	23.910	(406)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,670	19.11.2023	2.000	(25)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,678	25.10.2023	5.000	(59)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,681	12.12.2023	2.000	(25)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	530	(3)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,948	19.10.2048	160	1	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	3,100	17.04.2028	2.070	7	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	€ 6.700	111	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.09.2020	£ 44.600	(203)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	7.680	(147)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	17.060	264	0,02
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 3.450.000	(87)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	1.070.000	(12)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	1.110.000	(49)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,500	21.12.2045	32.800	51	0,00
Zahlung	CPTFEMU	0,806	15.04.2021	€ 21.500	296	0,02
Erhalt	CPTFEMU	1,478	15.05.2023	4.800	(10)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,505	26.06.2021	1.600	(1)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,535	15.06.2023	16.200	6	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,635	15.06.2028	2.500	(6)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,710	15.03.2033	1.600	6	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	1.600	(23)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,678	24.05.2021	\$ 4.000	86	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,845	24.05.2026	1.000	(37)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,550	26.07.2021	1.100	3	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,578	24.11.2020	2.700	22	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,603	12.09.2021	1.240	4	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,730	26.07.2026	1.100	(6)	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,801	12.09.2026	1.240	(7)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,925	08.05.2019	3.530	5	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,021	25.11.2020	4.100	44	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,027	23.11.2020	4.100	43	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,069	15.07.2022	4.000	57	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,070	23.03.2019	33.880	52	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,143	25.04.2020	5.840	0	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,150	25.09.2027	3.800	(97)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,156	17.10.2027	8.500	(210)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,168	15.07.2020	10.700	55	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,180	20.09.2027	3.800	(85)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,210	05.02.2023	17.550	115	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,220	13.04.2023	7.440	28	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,263	27.04.2023	60	0	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,263	09.05.2023	5.230	10	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,281	10.05.2023	7.960	8	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,335	05.02.2028	8.910	(52)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,353	09.05.2028	5.230	1	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,360	09.05.2028	7.870	7	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,364	10.05.2028	7.960	9	0,00
Zahlung	FRCPXTOB	1,000	15.04.2020	€ 1.650	8	0,00
Zahlung	FRCPXTOB	1,345	15.06.2021	22.910	12	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,350	15.01.2023	12.040	(68)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,575	15.01.2028	5.640	(23)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,590	15.02.2028	13.210	(27)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,606	15.02.2028	1.320	0	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,910	15.01.2038	3.740	34	0,00
Erhalt	UKRPI	3,100	15.06.2031	£ 1.880	54	0,00
Erhalt	UKRPI	3,140	15.04.2031	210	9	0,00
Erhalt	UKRPI	3,300	15.12.2030	4.000	218	0,01
Erhalt	UKRPI	3,350	15.05.2030	2.700	90	0,01
Erhalt	UKRPI	3,400	15.06.2030	1.300	5	0,00
Zahlung	UKRPI	3,428	15.03.2047	820	(45)	0,00
Erhalt	UKRPI	3,470	15.09.2032	8.470	229	0,01
Erhalt	UKRPI	3,530	15.10.2031	20.660	654	0,04
					\$ 1.411	0,09
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 1.753</b>	<b>0,11</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.07.2018	\$ 4.300	\$ (4)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	8.200	(11)	(9)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	€ 14.200	(27)	(20)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 2.500	(4)	0	0,00
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	3.000	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	3.500	(5)	(4)	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 28.300	(58)	(71)	(0,01)
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 2.700	(5)	0	0,00
						\$ (117)	\$ (106)	(0,01)

### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
CBK	Call - OTC USD versus MXN	MXN 21,100	22.08.2018	\$ 5.968	\$ (67)	\$ (36)	0,00

### INFLATIONSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	€ 1.500	\$ (68)	\$ (9)	0,00
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
	Cap - OTC YOY CPURNSA	233,707	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	01.04.2019	2.100	(14)	0	0,00
	Floor - OTC YOY CPURNSA	234,812	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	24.03.2020	4.600	(52)	(4)	0,00
						\$ (142)	\$ (13)	0,00

### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,250 %	04.12.2018	\$ 15.600	\$ (88)	\$ (57)	0,00

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

### ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	10-Year USD-ISDA - 2-Year USD-ISDA	0,000 %	02.01.2020	\$ 165.300	\$ (128)	\$ (239)	(0,02)

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens	
CBK	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2022	\$ 200	\$ (13)	\$ 4	\$ (9)	0,00	
FBF	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2021	100	(7)	4	(3)	0,00	
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2021	2.400	(167)	109	(58)	(0,01)	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	900	(58)	16	(42)	0,00	
	Italy Government International Bond	1,000	20.03.2019	50	(1)	1	0	0,00	
JPM	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2021	200	(14)	9	(5)	0,00	
						\$ (260)	\$ 143	\$ (117)	(0,01)

### 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 Nettvermögens	
GST	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500 %	17.01.2047	\$ 2.900	\$ (146)	\$ 162	\$ 16	0,00	
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,000	17.10.2057	600	(40)	42	2	0,00	
UAG	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	900	(80)	80	0	0,00	
						\$ (266)	\$ 284	\$ 18	0,00

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	CPURNSA	1,570 %	23.11.2020	\$ 12.200	\$ 0	\$ 323	\$ 323	0,02
BRC	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,374)	20.06.2020	ILS 13.060	0	4	4	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	2.810	0	(5)	(5)	0,00
DUB	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	2.690	0	5	5	0,00
GLM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	10.240	1	3	4	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,290)	16.02.2020	24.820	0	0	0	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,270)	21.03.2020	15.260	0	5	5	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,883	21.03.2028	3.200	0	(5)	(5)	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	5.230	0	8	8	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	2.190	0	(2)	(2)	0,00
HUS	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	8.080	0	3	3	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	1.730	0	(1)	(1)	0,00
JPM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,420)	20.06.2020	12.620	0	1	1	0,00
MYC	Erhalt	CPURNSA	2,058	12.05.2025	\$ 2.700	0	(42)	(42)	0,00
	Erhalt	CPURNSA	1,788	18.07.2026	2.000	0	(108)	(108)	(0,01)
	Erhalt	CPURNSA	1,810	19.07.2026	1.900	0	(99)	(99)	(0,01)
	Erhalt	CPURNSA	1,800	20.07.2026	1.300	0	(69)	(69)	0,00
	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	500	0	(26)	(26)	0,00
						\$ 1	\$ (5)	\$ (4)	0,00

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07/2018	\$ 3.002	ARS 77.947	\$ 0	\$ (300)	\$ (300)	(0,02)
	07/2018	35.770	AUD 48.456	31	0	31	0,00
	08/2018	AUD 48.456	\$ 35.774	0	(32)	(32)	0,00
	08/2018	CAD 7.140	5.529	97	0	97	0,01
BPS	07/2018	ARS 32.192	1.173	57	0	57	0,00
	07/2018	\$ 1.163	ARS 32.192	0	(57)	(57)	0,00
	07/2018	10.004	¥ 1.086.534	0	(194)	(194)	(0,01)
	08/2018	ARS 137.880	\$ 6.405	1.826	0	1.826	0,12
	09/2018	\$ 217	IDR 3.046.326	0	(6)	(6)	0,00
	09/2018	4.887	INR 333.819	0	(64)	(64)	0,00
BRC	09/2018	KRW 3.441.872	\$ 3.107	8	0	8	0,00
	09/2018	SGD 4.213	3.107	12	0	12	0,00
	09/2018	TWD 93.922	3.107	10	0	10	0,00
CBK	07/2018	CAD 29.048	22.313	231	0	231	0,01
	07/2018	£ 165.406	219.142	765	0	765	0,05
	07/2018	RUB 395.045	6.247	0	(49)	(49)	0,00
	07/2018	\$ 781	ARS 20.394	0	(85)	(85)	(0,01)
	07/2018	4.570	COP 13.096.349	0	(113)	(113)	(0,01)
	07/2018	177	TRY 814	0	0	0	0,00
	08/2018	1.341	MXN 26.183	0	(21)	(21)	0,00
DUB	07/2018	ARS 57.766	\$ 2.071	69	0	69	0,00
	07/2018	\$ 477	ARS 12.012	0	(61)	(61)	0,00
FBF	07/2018	€ 230	\$ 285	17	0	17	0,00
GLM	07/2018	AUD 48.456	36.427	625	0	625	0,04
	07/2018	€ 47.066	54.768	0	(184)	(184)	(0,01)
	07/2018	PEN 18.501	5.642	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	\$ 7.366	€ 6.293	0	(19)	(19)	0,00
	09/2018	INR 331.688	\$ 4.814	22	0	22	0,00
HUS	07/2018	ARS 125.933	5.951	1.655	0	1.655	0,11
	07/2018	€ 231	268	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	£ 440	578	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	\$ 678	ARS 17.691	0	(75)	(75)	(0,01)
	07/2018	21.832	CAD 29.048	250	0	250	0,02
	07/2018	10	€ 9	0	0	0	0,00
	07/2018	6.268	RUB 395.045	28	0	28	0,00
	08/2018	CAD 29.048	\$ 21.845	0	(249)	(249)	(0,02)
	08/2018	€ 5.460	6.769	367	0	367	0,02
	08/2018	RUB 395.045	6.238	0	(28)	(28)	0,00
	08/2018	\$ 6.332	RUB 395.766	0	(55)	(55)	0,00
	09/2018	CNH 58.228	\$ 9.150	389	0	389	0,02
	10/2018	€ 390	484	25	0	25	0,00
JPM	07/2018	4.128	4.939	121	(3)	118	0,01
	07/2018	¥ 2.640.000	24.291	414	0	414	0,03
	07/2018	NZD 484	341	13	0	13	0,00
	07/2018	\$ 323.029	€ 277.673	1.168	0	1.168	0,07

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	08/2018	€ 277.673	\$ 323.751	\$ 0	\$ (1.150)	\$ (1.150)	(0,07)
	10/2018	NGN 399.984	1.064	0	(28)	(28)	0,00
	11/2018	425.572	1.130	0	(28)	(28)	0,00
MSB	07/2018	CAD 5.400	4.162	56	0	56	0,00
	07/2018	¥ 1.210.000	11.135	191	0	191	0,01
	07/2018	\$ 45.170	€ 39.108	491	0	491	0,03
	08/2018	€ 39.108	\$ 45.269	0	(490)	(490)	(0,03)
	09/2018	ARS 19.488	883	246	0	246	0,02
	10/2018	NGN 76.645	204	0	(5)	(5)	0,00
RYL	10/2018	€ 1.160	1.448	84	0	84	0,01
SCX	07/2018	CAD 10.000	7.731	129	0	129	0,01
	07/2018	\$ 10.992	SEK 97.880	0	(51)	(51)	0,00
	08/2018	SEK 97.880	\$ 11.017	52	0	52	0,00
	09/2018	KRW 4.807.645	4.473	144	0	144	0,01
	10/2018	NGN 38.391	102	0	(3)	(3)	0,00
	11/2018	115.239	306	0	(7)	(7)	0,00
SOG	07/2018	SEK 97.880	10.986	44	0	44	0,00
SSB	07/2018	€ 273.150	316.268	0	(2.648)	(2.648)	(0,17)
	09/2018	\$ 2.940	IDR 41.254.750	0	(91)	(91)	(0,01)
TOR	07/2018	¥ 1.086.534	\$ 9.889	80	0	80	0,01
	08/2018	\$ 9.910	¥ 1.086.534	0	(81)	(81)	(0,01)
UAG	07/2018	\$ 218.708	£ 165.406	0	(331)	(331)	(0,02)
	08/2018	£ 165.406	\$ 219.018	345	0	345	0,02
				\$ 10.062	\$ (6.519)	\$ 3.543	0,23

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CHF (Hedged) Class 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 Nettovermogens
BOA	07/2018	CHF 415	\$ 420	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07/2018	\$ 8.316	CHF 8.190	0	(68)	(68)	(0,01)
BPS	07/2018	CHF 124	CHF 124	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 6	CHF 6	0	0	0	0,00
BRC	07/2018	CHF 76	\$ 78	1	0	1	0,00
CBK	07/2018	56	56	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 8.335	CHF 8.233	0	(44)	(44)	0,00
GLM	07/2018	CHF 7.809	\$ 7.824	0	(40)	(40)	0,00
	07/2018	\$ 8.341	CHF 8.254	0	(28)	(28)	0,00
	08/2018	7.712	7.678	40	0	40	0,00
JPM	07/2018	CHF 8.550	\$ 8.631	20	0	20	0,00
	08/2018	\$ 7.731	CHF 7.641	0	(17)	(17)	0,00
SSB	07/2018	CHF 1.124	\$ 1.128	1	(5)	(4)	0,00
				\$ 64	\$ (202)	\$ (138)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class und Class E EUR (Hedged) 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 Nettovermogens
BOA	07/2018	\$ 346.874	€ 295.502	\$ 0	\$ (1.860)	\$ 1.860	(0,12)
	08/2018	14.885	12.441	0	(314)	(314)	(0,02)
BRC	07/2018	€ 269	\$ 311	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	\$ 103	€ 87	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2018	€ 37.308	\$ 43.143	11	(426)	(415)	(0,03)
GLM	07/2018	549	638	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	\$ 306	€ 260	0	(2)	(2)	0,00
MSB	07/2018	€ 305.757	\$ 353.149	0	(3.838)	(3.838)	(0,24)
	08/2018	\$ 353.927	€ 305.757	3.834	0	3.834	0,25
RBC	07/2018	€ 280	\$ 326	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 502	€ 433	4	0	4	0,00
RYL	07/2018	€ 7.338	\$ 8.607	40	0	40	0,00
	07/2018	\$ 20	€ 17	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	€ 576	\$ 672	1	(1)	0	0,00
	07/2018	\$ 375.733	€ 324.327	2.943	(8)	2.935	0,19
SSB	07/2018	€ 304.623	\$ 354.612	0	(1.051)	(1.051)	(0,07)
	07/2018	\$ 377.194	€ 324.146	1.263	0	1.263	0,08
	08/2018	355.398	304.623	1.036	0	1.036	0,07
				\$ 9.132	\$ (7.509)	\$ 1.623	0,11

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 21.247	£ 15.840	\$ 1	\$ (335)	\$ (334)	(0,02)		
BOA	07/2018	64.031	47.955	0	(718)	(718)	(0,05)		
BPS	07/2018	1.165	883	3	(2)	1	0,00		
BRC	07/2018	£ 54.477	\$ 71.237	0	(686)	(686)	(0,04)		
	07/2018	\$ 705	£ 531	0	(4)	(4)	0,00		
	08/2018	71.336	54.477	684	0	684	0,04		
CBK	07/2018	£ 179	\$ 238	2	0	2	0,00		
	07/2018	\$ 64.087	£ 48.369	0	(228)	(228)	(0,01)		
GLM	07/2018	£ 60	\$ 80	1	0	1	0,00		
RYL	07/2018	\$ 400	£ 303	0	0	0	0,00		
SCX	07/2018	£ 180	\$ 241	3	0	3	0,00		
	07/2018	\$ 63.768	£ 47.968	0	(438)	(438)	(0,03)		
SSB	07/2018	945	710	1	(10)	(9)	0,00		
UAG	07/2018	£ 54.125	\$ 71.567	108	0	108	0,01		
	08/2018	\$ 71.668	£ 54.125	0	(113)	(113)	(0,01)		
						\$ 803	\$ (2.534)	\$ (1.731)	(0,11)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>							<b>\$ 2.743</b>	<b>0,18</b>	

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Fannie Mae, TBA			
3,000 % fällig am 01.07.2048	\$ 36.400	\$ (35.264)	(2,27)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (35.264)</b>	<b>(2,27)</b>
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Barclays Bank PLC			
1,940 % fällig am 04.09.2018	200	200	0,01
<b>Summe Einlagenzertifikate</b>		<b>\$ 200</b>	<b>0,01</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 2.153.763</b>	<b>138,31</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (596.579)</b>	<b>(38,31)</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 1.557.184</b>	<b>100,00</b>

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (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) 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) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 390.372 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 7.996 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 10.610 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(i) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 1.453	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	\$ (1.483)	\$ 1.453	\$ 1.453	0,09
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (1.483)</b>	<b>\$ 1.453</b>	<b>\$ 1.453</b>	<b>0,09</b>

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 2.964	\$ 2.175.214	\$ 9.902	\$ 2.188.080
Einlagen bei Kreditinstituten	0	200	0	200
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(3.750)	4.497	0	747
Leerverkäufe	0	(35.264)	0	(35.264)
<b>Summen</b>	<b>\$ (786)</b>	<b>\$ 2.144.647</b>	<b>\$ 9.902</b>	<b>\$ 2.153.763</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 136	\$ 2.574.002	\$ 0	\$ 2.574.138
Einlagen bei Kreditinstituten	0	390	0	390
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(465)	2.054	0	1.589
Leerverkäufe	0	(55.204)	0	(55.204)
<b>Summen</b>	<b>\$ (329)</b>	<b>\$ 2.521.242</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 2.520.913</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 der Wertpapieranlagen.

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

### Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkaufgeschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	1,990 %	25.04.2018	25.07.2018	\$ (24.258)	\$ (24.348)	(1,57)
	2,050	30.05.2018	05.07.2018	(13.379)	(13.403)	(0,86)
	2,110	24.05.2018	24.08.2018	(18.046)	(18.087)	(1,16)
	2,110	01.06.2018	05.07.2018	(9.378)	(9.394)	(0,60)
TDM	1,920	17.04.2018	12.07.2018	(160.820)	(161.463)	(10,37)
	1,930	02.05.2018	02.07.2018	(131.654)	(132.078)	(8,48)
	2,080	18.05.2018	13.07.2018	(31.681)	(31.761)	(2,04)
<b>Summe Rückkaufgeschäfte</b>				<b>\$ (390.534)</b>	<b>(25,08)</b>	

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 218 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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (334)	\$ 390	\$ 56
BOA	(2.839)	7.060	4.221
BPS	1.533	(1.320)	213
BRC	20	0	20
CBK	(64)	(1.670)	(1.734)
CKL	(71)	0	(71)
DUB	13	(110)	(97)
FBF	14	0	14
GLM	407	(1.150)	(743)
GST	18	0	18
HUS	2.203	(2.030)	173
JPM	502	(520)	(18)
MSB	485	(380)	105
MYC	(583)	410	(173)
RBC	3	0	3
RYL	124	(500)	(376)
SCX	2.764	690	3.454
SOG	44	0	44
SSB	(1.504)	2.060	556
TOR	(1)	0	(1)
UAG	9	0	9

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	72,93	59,84
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	66,50	56,00
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,09	1,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,24)	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,11	(0,03)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,18	(0,12)
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,27)	(2,51)
Einlagezertifikate	0,01	(0,02)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	0,00	(3,40)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(25,08)	(5,42)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Low Duration Real Return Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US			PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US		
Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	42.591.200	\$ 426.429	Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	42.308.737	\$ 423.600
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b)	\$ 128.594	128.374	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2021 (b)	\$ 271.543	267.180
United Kingdom Gilt 1,875 % fällig am 22.11.2022	£ 45.329	75.353	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 28.02.2022	142.200	138.599
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,875 % fällig am 15.07.2019 (b)	65.844	67.830	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b)	129.589	128.551
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2021 (b)	\$ 66.874	65.826	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2021 (b)	89.387	91.586
U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 28.02.2022	67.225	65.544	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2022	€ 61.300	77.597
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	63.263	62.095	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,250 % fällig am 15.07.2020 (b)	\$ 73.576	75.540
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€ 43.815	60.411	United Kingdom Gilt 1,875 % fällig am 22.03.2026	£ 44.513	71.456
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2019	38.381	46.238	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 52.970	51.744
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£ 23.817	38.926	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b)	46.553	46.597
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 01.05.2018	¥ 3.850.000	35.435	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.07.2024	35.600	34.924
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.07.2018	3.850.000	35.217	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b)	33.862	33.722
U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.12.2024	\$ 28.000	27.646	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	29.922	29.985
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	¥ 2.549.800	24.038	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b)	25.916	28.972
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2021 (b)	\$ 22.547	23.041	United States Treasury Note/Bond 2,250 % fällig am 31.12.2024	28.000	27.658
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	22.528	22.380	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2027	¥ 2.448.763	23.747
France Government International Bond 1,850 % fällig am 25.07.2027	€ 13.111	19.763	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 20.912	20.377
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2023	14.644	18.657	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2023	€ 14.719	17.986
U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.07.2024	\$ 17.800	17.466	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 17.460	17.010
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2025	€ 11.504	15.231	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2021 (b)	15.322	15.563

(a) Der Global Low Duration Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Nennbetrag des Wertpapiers wurde 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapierranlagen des Global Multi-Asset Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	MARKT- PARI WERT (000S)	% DES NETTOVER MÖGENS	BESCHREIBUNG	MARKT- PARI WERT (000S)	% DES NETTOVER MÖGENS	BESCHREIBUNG	MARKT- PARI WERT (000S)	% DES NETTOVER MÖGENS					
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGLER MARKT</b>													
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>													
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>													
<b>AerCap Ireland Capital DAC</b>			<b>Central Nippon Expressway Co. Ltd.</b>			1,750 % fällig am 15.01.2028 (j)	\$	18.861	20.620	2,01			
3,750 % fällig am 15.05.2019	\$	500	\$	503	0,05	2,000 % fällig am 15.01.2026		324	356	0,04			
4,250 % fällig am 01.07.2020		200		202	0,02	2,125 % fällig am 15.02.2040		13.932	17.536	1,71			
4,625 % fällig am 30.10.2020		200		204	0,02	2,125 % fällig am 15.02.2041		1.361	1.726	0,17			
<b>American Tower Corp.</b>			<b>Del International LLC</b>			2,375 % fällig am 15.01.2025		8.639	9.581	0,93			
2,800 % fällig am 01.06.2020		100		99	0,01	2,375 % fällig am 15.01.2027		373	424	0,04			
<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b>			<b>Dominion Energy Gas Holdings LLC</b>			2,500 % fällig am 15.01.2029 (j)		17.139	20.158	1,96			
7,000 % fällig am 19.02.2019 (f)(h)	€	1.000		1.197	0,12	3,375 % fällig am 15.04.2032		2.229	2.978	0,29			
8,875 % fällig am 14.04.2021 (f)(h)		1.000		1.311	0,13	3,875 % fällig am 15.04.2029		309	408	0,04			
<b>Bank of America Corp.</b>			<b>eBay, Inc.</b>			<b>U.S. Treasury Notes</b>							
5,875 % fällig am 15.03.2028 (f)	\$	650		636	0,06	2,125 % fällig am 31.03.2024 (j)		50.395	48.653	4,74			
<b>Barclays PLC</b>			<b>EMC Corp.</b>			2,750 % fällig am 15.02.2024 (j)		29.100	29.067	2,83			
8,000 % fällig am 15.12.2020 (f)(h)	€	200		259	0,02								
<b>BRFKredit A/S</b>			<b>Enbridge, Inc.</b>			<b>244.362</b>							
2,500 % fällig am 01.10.2047	DKK	9		1	0,00	<b>23.80</b>							
<b>Credit Suisse Group AG</b>			<b>Mitsubishi Corp.</b>			<b>NON-AGENCY-MBS</b>							
3,869 % fällig am 12.01.2029	\$	1.400		1.319	0,13	<b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>							
<b>Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.</b>			<b>Time Warner Cable LLC</b>			3,604 % fällig am 25.02.2036 ^		166	157	0,01			
3,800 % fällig am 15.09.2022		1.300		1.295	0,13	4,137 % fällig am 25.07.2036 ^		347	328	0,03			
<b>CSCEC Finance Cayman Ltd.</b>			<b>VMware, Inc.</b>			<b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust</b>							
2,250 % fällig am 14.06.2019		200		197	0,02	6,000 % fällig am 25.02.2037 ^		74	59	0,01			
<b>Deutsche Bank AG</b>			<b>Wind Tre SpA</b>			<b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>							
4,250 % fällig am 14.10.2021		4.800		4.736	0,46	2,371 % fällig am 25.07.2035		196	171	0,02			
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>			<b>WORLDWIDE MORTGAGE INVESTMENT TRUST</b>			<b>WalMa Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>							
2,876 % fällig am 31.10.2022		800		781	0,08	2,421 % fällig am 25.01.2045		4.516	4.500	0,44			
3,541 % fällig am 15.09.2020		9.900		10.052	0,98	<b>5.215</b>							
<b>Indian Railway Finance Corp. Ltd.</b>			<b>VERSÖRGUNGSUNTERNEHMEN</b>			<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>							
3,917 % fällig am 26.02.2019		500		502	0,05	<b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>							
<b>ING Bank NV</b>			<b>AT&amp;T, Inc.</b>			3,891 % fällig am 25.06.2034		325	313	0,03			
2,625 % fällig am 05.12.2022		1.400		1.370	0,13	<b>Argent Securities Trust</b>							
<b>International Lease Finance Corp.</b>			<b>Consolidated Edison Co. of New York, Inc.</b>			2,241 % fällig am 25.07.2036		1.954	1.672	0,16			
6,250 % fällig am 15.05.2019		2.000		2.051	0,20	<b>Aurium CLO DAC</b>							
<b>Intesa Sanpaolo SpA</b>			<b>Gaprom OAO Via Gaz Capital S.A.</b>			0,800 % fällig am 26.04.2029	€	900	1.052	0,10			
7,000 % fällig am 19.01.2021 (f)(h)	€	3.100		3.705	0,36	<b>Babson Euro CLO BV</b>							
<b>Lincoln Finance Ltd.</b>			<b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b>			0,492 % fällig am 25.10.2029		300	350	0,03			
6,875 % fällig am 15.04.2021		900		1.088	0,10	<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>							
<b>Lloyds Banking Group PLC</b>			<b>Petrobras Global Finance BV</b>			2,511 % fällig am 25.07.2036	\$	72	72	0,01			
3,130 % fällig am 21.06.2021	\$	700		700	0,07	<b>Calm CLO BV</b>							
7,000 % fällig am 27.06.2019 (f)(h)	€	500		674	0,06	0,650 % fällig am 20.10.2028	€	400	467	0,05			
<b>Nationwide Building Society</b>			<b>Sempra Energy</b>			<b>Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC</b>							
6,875 % fällig am 20.06.2019 (f)(h)		200		270	0,03	0,730 % fällig am 21.09.2029		300	350	0,03			
<b>Navient Corp.</b>			<b>Sinopec Group Overseas Development Ltd.</b>			<b>Cavalry CLO Ltd.</b>							
10,250 % (f)		41		8.341	0,81	3,198 % fällig am 15.10.2026	\$	500	500	0,05			
4,875 % fällig am 17.06.2019	\$	200		201	0,02	<b>CIT Mortgage Loan Trust</b>							
5,500 % fällig am 15.01.2019		1.100		1.110	0,11	3,441 % fällig am 25.10.2037		4.020	4.064	0,40			
8,000 % fällig am 25.03.2020		2.100		2.221	0,22	<b>Countrywide Asset-Backed Certificates</b>							
<b>Nordea Kredit Realkreditaktieselskab</b>			<b>Sunsumme Unternehmensanleihen und Wechsel</b>			2,321 % fällig am 25.05.2037		11.500	10.614	1,03			
2,500 % fällig am 01.10.2047	DKK	67		11	0,00	<b>CVP Cascade CLO Ltd.</b>							
<b>Nykredit Realkredit A/S</b>			<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			3,498 % fällig am 16.01.2026		852	853	0,08			
2,500 % fällig am 01.10.2047		13		2	0,00	<b>Dartry Park CLO DAC</b>							
<b>Realkredit Danmark A/S</b>			<b>Fannie Mae</b>			0,830 % fällig am 28.04.2029	€	200	234	0,02			
2,500 % fällig am 01.07.2047		88		14	0,00	<b>Driver Australia Four Trust</b>							
<b>Royal Bank of Scotland Group PLC</b>			<b>4,489 % fällig am 25.03.2036 (a)</b>			2,940 % fällig am 21.08.2025	AUD	1.410	1.043	0,10			
3,885 % fällig am 25.06.2024	\$	1.000		999	0,10	<b>Dryden Senior Loan Fund</b>							
4,519 % fällig am 25.06.2024		700		701	0,07	3,248 % fällig am 15.10.2027	\$	2.400	2.402	0,23			
<b>Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.</b>			<b>Freddie Mac</b>			<b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b>							
3,080 % fällig am 07.03.2019	€	5.170		6.117	0,59	2,561 % fällig am 25.11.2036		2.200	1.950	0,19			
<b>Springleaf Finance Corp.</b>			<b>6,980 % fällig am 15.05.2035</b>			2,241 % fällig am 25.10.2036		8.491	4.632	0,45			
6,000 % fällig am 01.06.2020	\$	100		103	0,01	<b>Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.</b>							
<b>State Bank of India</b>			<b>US-SCHATZobligationen</b>			3,279 % fällig am 20.04.2027		900	900	0,09			
3,275 % fällig am 06.04.2020		1.100		1.104	0,11	<b>Harvest CLO DAC</b>							
<b>Toronto-Dominion Bank</b>			<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)</b>			0,630 % fällig am 18.11.2029	€	1.400	1.637	0,16			
2,250 % fällig am 15.03.2021		2.000		1.957	0,19	<b>Jubilee CLO BV</b>							
<b>UBS AG</b>			<b>0,125 % fällig am 15.04.2019</b>		5,057	0,49	0,479 % fällig am 15.12.2029		360	421	0,04		
2,450 % fällig am 01.12.2020		5.700		5.579	0,54	15,348	15,187	1,48	<b>Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust</b>				
									<b>61.612</b>	<b>6,00</b>			
<b>INDUSTRIEWERTE</b>													
<b>BAT Capital Corp.</b>			<b>0,125 % fällig am 15.04.2020</b>		1	0,00	7,170 % fällig am 15.04.2040 ^	\$	1.226	868	0,09		
2,945 % fällig am 14.08.2020		1.500		1.506	0,15	2,665	2.611	0,25	<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>				
									<b>10,878</b>	<b>10,646</b>			
									<b>5,955</b>	<b>5,851</b>			
									<b>7,508</b>	<b>7,298</b>			
									<b>10,878</b>	<b>10,646</b>			
									<b>1,934</b>	<b>1,932</b>			
									<b>1,065</b>	<b>1,059</b>			
									<b>7,644</b>	<b>7,655</b>			
									<b>10,632</b>	<b>11,003</b>			
									<b>1,07</b>	<b>1,07</b>			
									<b>1,250 % fällig am 15.01.2026</b>	<b>€</b>	<b>4.400</b>	<b>5.144</b>	<b>0,50</b>
									<b>800</b>	<b>935</b>	<b>0,09</b>		



BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER MÖGENS
1.211 % fällig am 31.08.2018 (c)(d) €	3.390	3.954	0,39
		6.042	0,59
<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
(0,156)% fällig am 30.07.2018 (c)(d) ¥	1.980.000	17.877	1,74
Summe kurzfristige Instrumente		40.719	3,97
<b>AKTIEN</b>			
<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (g)	2.386.996	23.901	2,32
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt		\$ 1.454.901	141,68

## 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
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2018	4	\$ (4)	0,00
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2019	4	(4)	0,00
90-Day Eurodollar June Futures	Long	06/2019	4	(4)	0,00
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2019	4	(4)	0,00
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2018	4	(3)	0,00
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2019	4	(4)	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	23	(26)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 162,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	170	(174)	(0,02)
E-mini NASDAQ 100 Index September Futures	Short	09/2018	11	38	0,00
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09/2018	1.828	(5.465)	(0,53)
Euro STOXX 50 September Futures	Long	09/2018	1.118	(607)	(0,06)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09/2018	15	47	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	1	(2)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	409	687	0,07
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	121	(177)	(0,02)
FTSE 100 Index September Futures	Long	09/2018	276	(163)	(0,02)
FTSE China A50 Index July Futures	Short	07/2018	9	0	0,00
Hang Seng China Enterprises Index July Futures	Long	07/2018	82	(39)	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	19	(34)	0,00
JPX Nikkei Index 400 September Futures	Long	09/2018	2.909	(910)	(0,09)
Mini MSCI EAFE Index September Futures	Long	09/2018	445	(1.315)	(0,13)
Mini MSCI Emerging Markets Index September Futures	Long	09/2018	138	(482)	(0,05)
Nikkei 225 Index September Futures	Long	09/2018	14	(35)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 144,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	718	(1)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 157,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	85	49	0,01
S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures	Long	09/2018	90	146	0,01
Swiss Market Index September Futures	Long	09/2018	138	122	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2018	71	(39)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	128	14	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09/2018	433	(436)	(0,04)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09/2018	1.079	(3.599)	(0,35)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	8	(48)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	392	(598)	(0,06)
				\$ (13.070)	(1,27)

## OPTIONSKAUF

## OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	\$ 120,500	24.08.2018	71	\$ 1	\$ 0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note October 2018 Futures	107,000	21.09.2018	128	1	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	137,000	24.08.2018	210	2	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	117,000	24.08.2018	156	1	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	\$ 169,000	24.08.2018	352	\$ 3	£ 1	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	176,000	24.08.2018	777	6	1	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2018 Futures	188,000	24.08.2018	8	0	0	0,00
				\$ 14	\$ 2	0,00

### OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOE S&P 500	\$ 2.725,000	20.07.2018	38	\$ 67	\$ 128	0,01
Put - CBOE S&P 500	2.650,000	21.09.2018	40	404	189	0,02
Put - CBOE S&P 500	2.650,000	21.12.2018	39	486	329	0,03
Put - CBOE S&P 500	2.700,000	15.03.2019	75	732	934	0,09
Call - EUREX EURO STOXX 50	3.650,000	21.12.2018	254	165	87	0,01
Call - EUREX EURO STOXX 50	3.750,000	21.12.2018	243	317	38	0,01
				\$ 2.171	€ 1.705	0,17

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	\$ 141,000	27.07.2018	26	\$ (25)	\$ (2)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	142,000	27.07.2018	34	(23)	(5)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	143,000	27.07.2018	100	(76)	(31)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	145,000	27.07.2018	50	(29)	(50)	(0,01)
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	146,000	27.07.2018	54	(33)	(32)	(0,01)
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	146,500	27.07.2018	50	(32)	(23)	0,00
				\$ (218)	\$ (143)	(0,02)

### OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOE S&P 500	\$ 2.675,000	20.07.2018	75	\$ (78)	\$ (141)	(0,01)
Put - CBOE S&P 500	2.400,000	21.09.2018	80	(404)	(121)	(0,01)
Put - CBOE S&P 500	2.350,000	21.12.2018	158	(861)	(508)	(0,05)
Put - CBOE S&P 500	2.550,000	21.12.2018	39	(382)	(238)	(0,02)
Put - CBOE S&P 500	2.600,000	15.03.2019	75	(555)	(718)	(0,07)
Put - EUREX EURO STOXX 50	3.200,000	21.12.2018	254	(170)	(254)	(0,03)
Put - EUREX EURO STOXX 50	3.250,000	21.12.2018	243	(326)	(282)	(0,03)
				\$ (2.776)	\$ (2.262)	(0,22)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ (13.768) (1,34)

### 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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Altria Group, Inc.	(1,000) %	20.06.2021	\$ 1.210	\$ 9	0,00
Boston Scientific Corp.	(1,000)	20.06.2020	1.800	16	0,00
Cigna Corp.	(1,000)	20.03.2021	370	3	0,00
Kraft Heinz Foods Co.	(1,000)	20.09.2020	1.000	8	0,00
				\$ 36	0,00

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Daimler AG	1,000 %	20.12.2020	€ 1.010	\$ (1)	0,00
Deutsche Bank AG	1,000	20.06.2019	1.200	2	0,00
				\$ 1	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-30 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2023	\$ 65.250	\$ 318	0,03
iTraxx Europe Main 26 5-Year Index	(1,000)	20.12.2021	€ 37.900	(315)	(0,03)
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	108.600	907	0,09
				\$ 910	0,09

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-30 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2023	11.800	(4)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000 %	15.12.2047	\$ 7.140	\$ 653	0,06
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,428	20.12.2047	1.400	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,478	20.12.2047	1.136	(19)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,499	20.12.2047	5.400	(83)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,970	04.01.2027	BRL 23.700	69	0,01
Erhalt	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	NZD 600	(14)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	20.06.2020	\$ 73.000	41	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.12.2019	300	5	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	15.500	(49)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,150	19.06.2048	13.800	988	0,10
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	35.800	(1.015)	(0,10)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	12.600	(80)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,300	27.04.2026	16.700	488	0,05
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,400	16.03.2026	11.440	285	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,400	07.12.2026	15.200	207	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,500	19.12.2023	5.900	(128)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027	26.190	150	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,670	19.11.2023	13.000	(163)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,678	25.10.2023	11.000	(131)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,681	12.12.2023	13.000	(159)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	3,100	17.04.2028	2.360	8	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.09.2020	£ 50.200	(229)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	7.030	(70)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	4.580	(88)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	20.820	283	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	2,340	13.01.2026	27.680	(1.005)	(0,10)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 1.640.000	(41)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	1,000	20.03.2024	2.017.000	(44)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	1,500	20.12.2044	990.000	948	0,09
Zahlung	CPTFEMU	1,507	15.05.2023	€ 2.100	(1)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,520	15.11.2027	2.770	(1)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,535	15.03.2028	10.500	(73)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	1,710	15.03.2033	1.800	7	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	6.020	(143)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,678	24.05.2021	\$ 11.600	201	0,02
Erhalt	CPURNSA	1,845	24.05.2026	2.900	(81)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,460	18.07.2018	13.700	163	0,02
Zahlung	CPURNSA	1,550	26.07.2021	3.100	8	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,603	12.09.2021	2.470	7	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,715	18.07.2019	13.700	(179)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	1,730	26.07.2026	3.100	(18)	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,780	15.09.2026	11.300	(62)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	1,801	12.09.2026	2.470	(14)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,955	25.07.2024	15.600	450	0,04
Zahlung	CPURNSA	2,070	23.03.2019	1.300	2	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,070	04.10.2019	1.100	(10)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,080	25.07.2027	6.800	(200)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,102	20.07.2027	9.900	(268)	(0,03)
Erhalt	CPURNSA	2,122	01.08.2027	6.800	(175)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,143	25.04.2020	220	0	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,150	25.09.2027	3.300	(84)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,155	17.10.2027	3.700	(92)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,168	15.07.2020	3.400	17	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,180	20.09.2027	3.340	(75)	(0,01)
Zahlung	FRCPXTOB	1,000	15.04.2020	€ 470	2	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,575	15.01.2028	16.300	(68)	(0,01)
Erhalt	FRCPXTOB	1,590	15.02.2028	8.660	(19)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,606	15.02.2028	1.610	0	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,910	15.01.2038	1.010	9	0,00
Erhalt	UKRPI	3,100	15.06.2031	£ 100	2	0,00
Erhalt	UKRPI	3,325	15.08.2030	9.000	274	0,03
Erhalt	UKRPI	3,350	15.05.2030	7.900	182	0,02
Erhalt	UKRPI	3,400	15.06.2030	26.000	617	0,06
Erhalt	UKRPI	3,530	15.10.2031	11.910	374	0,04
Zahlung	UKRPI	3,585	15.10.2046	1.530	(141)	(0,01)
					<b>\$ 1.418</b>	<b>0,14</b>
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 2.361</b>	<b>0,23</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 der Wertpapieranlagen des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

(2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

### FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

#### OPTIONSKAUF

##### BARRIER-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Barrierewert	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens	
JPM	Put - OTC S&P 500 D&I @ 2,615.300	EURUSD 1,200	\$ 2,615	15.03.2019	7.914	\$ 216	\$ 461	0,05	

##### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfalls-datum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens	
BOA	Call - OTC USD versus JPY	¥ 117,250	26.07.2018	\$ 6.000	\$ 1	\$ 0	0,00	

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens	
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500 %	24.08.2021	\$ 111.000	\$ 4.394	\$ 331	0,03	
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	24.08.2021	89.200	3.796	266	0,03	
							\$ 8.190	\$ 597	0,06	

##### OPTIONEN AUF INDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens	
JPM	Call - OTC EURO STOXX 50	€ 3.400,000	20.07.2018	€ 3	\$ 133	\$ 145	0,01	

##### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens	
FAR	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 73,000	05.07.2018	\$ 46.420	\$ 2	\$ 0	0,00	
JPM	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	69,000	05.07.2018	92.000	3	0	0,00	
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2048	71,000	05.07.2018	122.000	5	0	0,00	
					\$ 10	\$ 0	0,00	

#### VERKAUFSoPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens	
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.07.2018	\$ 5.600	\$ (4)	\$ (2)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	10.800	(14)	(12)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	€ 18.000	(35)	(25)	0,00	
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 2.900	(5)	0	0,00	
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	3.600	(4)	(1)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	4.600	(7)	(5)	0,00	
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 54.500	(111)	(136)	(0,02)	
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 3.000	(5)	0	0,00	
						\$ (185)	\$ (181)	(0,02)	

##### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens	
CBK	Call - OTC USD versus MXN	MXN 21,100	22.08.2018	\$ 7.660	\$ (85)	\$ (46)	0,00	

##### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag	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)	\$ (48)	(0,01)	
JPM	Cap - OTC CPURNSA	234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	\$ 1.500	(11)	0	0,00	

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
	Cap - OTC YOY CPURNSA	\$ 233,707	Maximal [(3 + 0,000 %) - (Index Final/Index Initial)] oder 0	10.04.2020	\$ 10.600	\$ 0	\$ 0	0,00
	Floor - OTC YOY CPURNSA	233,707	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	10.04.2020	10.600	0	0	0,00
	Floor - OTC YOY CPURNSA	234,812	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	24.03.2020	14.000	(158)	(13)	0,00
	Floor - OTC YOY CPURNSA	238,654	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	02.10.2020	7.000	(129)	(10)	0,00
						\$ (672)	\$ (71)	(0,01)

## ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	10-Year USD-ISDA - 2-Year USD-ISDA	0,000 %	02.01.2020	161.000	\$ (125)	\$ (233)	(0,02)

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

## OPTIONEN AUF INDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
FBF	Put - OTC EURO STOXX Banks	€ 110,000	20.07.2018	€ 78	\$ (114)	\$ (191)	(0,02)
	Call - OTC MSCI Emerging Markets	\$ 1.100,000	20.07.2018	\$ 10	(73)	(48)	(0,01)
JPM	Call - OTC EURO STOXX 50	€ 3.450,000	20.07.2018	€ 5	(123)	(136)	(0,01)
					\$ (310)	\$ (375)	(0,04)

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
CBK	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2021	\$ 300	\$ (26)	\$ 19	\$ (7)	0,00
DUB	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2021	500	(43)	31	(12)	0,00
FBF	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2021	100	(7)	5	(2)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2021	5.300	(368)	239	(129)	(0,01)
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	20.500	(1.324)	367	(957)	(0,09)
JPM	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2021	600	(42)	27	(15)	0,00
	Deutsche Bank AG	1,000	20.12.2021	€ 700	(146)	91	(55)	(0,01)
					\$ (1.956)	\$ 779	\$ (1.177)	(0,11)

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	0,000 %	17.11.2059	\$ 2.900	\$ (86)	\$ 73	\$ (13)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	12.200	(403)	349	(54)	(0,01)
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	5.100	(148)	125	(23)	0,00
					\$ (637)	\$ 547	\$ (90)	(0,01)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	1-Year ILS-TELBOR	1,998 %	20.06.2028	ILS 3.610	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
BRC	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,374)	20.06.2020	14.910	0	5	5	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	3.210	0	(6)	(6)	0,00
DUB	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,414)	20.06.2020	14.260	0	2	2	0,00
GLM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	11.560	1	3	4	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,290)	16.02.2020	27.870	0	0	0	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,270)	21.03.2020	17.230	0	5	5	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	5.870	0	9	9	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	2.470	0	(2)	(2)	0,00
HUS	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	9.100	0	3	3	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	1.940	0	(2)	(2)	0,00
JPM	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	2,078	20.06.2028	3.040	0	4	4	0,00
MYC	Erhalt	CPURNSA	1,810	19.07.2026	\$ 1.500	0	(78)	(78)	(0,01)
	Erhalt	CPURNSA	1,800	20.07.2026	3.800	0	(200)	(200)	(0,02)
	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	26.000	0	(1.343)	(1.343)	(0,13)
						\$ 1	\$ (1.603)	\$ (1.602)	(0,16)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

### 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
BNP	Erhalt	AMZX Index	629	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 744	25.01.2019	\$ 0	\$ 16	\$ 16	0,00
BOA	Erhalt	SPSIOPTR Index	78	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	520	15.03.2019	0	81	81	0,01
BPS	Erhalt	DWRTFT Index	97	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	933	07.11.2018	0	29	29	0,00
	Erhalt	S&P Banks Select Industry Index	3.791	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.870	15.11.2018	0	(227)	(227)	(0,02)
							\$ 0	\$ (101)	\$ (101)	(0,01)

### TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Zahlung	Enbridge, Inc.	2.949	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	CAD 125	15.05.2019	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	0,00
	Zahlung	TransCanada Corp.	4.551	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	250	15.05.2019	0	(10)	(10)	0,00
	Zahlung	Affiliated Managers Group, Inc.	820	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 128	28.11.2018	0	5	5	0,00
	Zahlung	Bank Of The Ozarks, Inc.	3.692	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	176	28.11.2018	0	10	10	0,00
	Zahlung	Church & Dwight Co., Inc.	3.302	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	166	28.11.2018	0	(10)	(10)	0,00
	Zahlung	Clorox Co.	2.144	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	276	28.11.2018	0	(13)	(13)	0,00
	Zahlung	Eli Lilly & Co.	1.764	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	153	28.11.2018	0	4	4	0,00
	Zahlung	Exxon Mobil Corp.	2.349	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	189	28.11.2018	0	(5)	(5)	0,00
	Zahlung	Franklin Resources, Inc.	5.088	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	173	28.11.2018	0	9	9	0,00
	Zahlung	Invesco Ltd.	4.988	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	137	28.11.2018	0	4	4	0,00
	Zahlung	Merck & Co., Inc.	1	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	0	28.11.2018	0	0	0	0,00
	Zahlung	Werner Enterprises, Inc.	2.322	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	91	28.11.2018	0	3	3	0,00
	Zahlung	Amgen, Inc.	1.231	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	228	15.05.2019	0	1	1	0,00
	Zahlung	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	1	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	0	15.05.2019	0	0	0	0,00
	Zahlung	PayPal Holdings, Inc.	1.484	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	127	15.05.2019	0	3	3	0,00
JPM	Zahlung	Mettler-Toledo	212	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	125	15.10.2018	0	2	2	0,00
	Zahlung	Wal-Mart Stores, Inc.	1.232	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	103	17.10.2018	0	(2)	(2)	0,00
	Zahlung	Aramark	2.052	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	80	25.01.2019	0	4	4	0,00
	Zahlung	Iron Mountain, Inc.	6.566	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	219	25.01.2019	0	(15)	(15)	0,00
	Zahlung	KB Home	1.488	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	39	25.01.2019	0	(1)	(1)	0,00
	Zahlung	PulteGroup, Inc.	1.694	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	51	25.01.2019	0	2	2	0,00
	Zahlung	The Brink's Co.	3.400	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	271	25.01.2019	0	0	0	0,00
MEI	Zahlung	Logitech International SA	5.259	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	CHF 236	28.11.2018	0	8	8	0,00
	Zahlung	Enable Midstream Partners LP	143.575	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 74.861	20.06.2019	0	(5.108)	(5.108)	(0,50)
MYI	Zahlung	Copart, Inc.	1	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	0	15.03.2019	0	0	0	0,00
	Zahlung	Schneider National Inc.	4.050	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	117	15.03.2019	0	5	5	0,00
							\$ 0	\$ (5.114)	\$ (5.114)	(0,50)

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07/2018	\$ 3.038	AUD 4.116	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07/2018	2.339	BRL 8.843	0	(40)	(40)	0,00
	08/2018	AUD 4.116	\$ 3.039	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	BRL 8.843	2.332	42	0	42	0,00
	08/2018	MXN 86.856	4.416	35	0	35	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
BPS	07/2018	ARS 116.453	\$ 4.206	\$ 208	\$ 0	\$ 208	0,02
	07/2018	CLP 396.705	623	13	0	13	0,00
	07/2018	€ 8.972	10.406	0	(69)	(69)	(0,01)
	07/2018	TWD 52.421	1.761	39	0	39	0,00
	07/2018	\$ 4.306	ARS 118.331	1	(206)	(205)	(0,02)
	07/2018	57.926	¥ 6.291.324	0	(1.127)	(1.127)	(0,11)
	07/2018	3.137	PEN 10.265	0	(4)	(4)	0,00
BRC	09/2018	PEN 10.265	\$ 3.129	4	0	4	0,00
	07/2018	TRY 13.245	2.868	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	ZAR 10.341	761	8	0	8	0,00
	08/2018	22.622	1.652	9	0	9	0,00
CBK	09/2018	KRW 2.492.505	2.250	6	0	6	0,00
	07/2018	£ 66.320	87.866	307	0	307	0,03
	07/2018	\$ 13.298	CAD 17.313	0	(137)	(137)	(0,01)
	07/2018	12.772	CHF 12.616	0	(67)	(67)	(0,01)
	07/2018	3.862	DKK 23.180	0	(230)	(230)	(0,02)
	07/2018	232	TRY 1.067	1	0	1	0,00
	09/2018	KRW 5.701.482	\$ 5.331	197	0	197	0,02
DUB	09/2018	TWD 55.884	1.882	40	0	40	0,00
	07/2018	ARS 121.322	4.350	145	0	145	0,01
FBF	07/2018	\$ 193	ARS 4.868	0	(25)	(25)	0,00
	07/2018	€ 130	\$ 161	9	0	9	0,00
	07/2018	\$ 5.229	COP 15.050.751	0	(107)	(107)	(0,01)
GLM	08/2018	MXN 56.185	\$ 2.803	0	(31)	(31)	0,00
	07/2018	BRL 6.568	1.736	33	0	33	0,00
	07/2018	CHF 384	389	2	0	2	0,00
	07/2018	€ 5.461	6.363	2	(15)	(13)	0,00
	07/2018	£ 3.124	4.166	42	0	42	0,00
	07/2018	PEN 10.265	3.130	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	RUB 54.302	868	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 1.418	£ 1.053	0	(28)	(28)	0,00
	07/2018	868	MXN 17.954	44	0	44	0,00
	07/2018	868	PHP 46.708	5	0	5	0,00
	07/2018	ZAR 10.460	\$ 791	29	0	29	0,00
	08/2018	RUB 111.517	1.762	0	(7)	(7)	0,00
	08/2018	\$ 472	ILS 1.678	0	(13)	(13)	0,00
	09/2018	IDR 38.995.488	\$ 2.770	77	0	77	0,01
	09/2018	INR 344.641	5.002	23	0	23	0,00
HUS	09/2018	\$ 355	PHP 18.741	0	(6)	(6)	0,00
	07/2018	CAD 17.313	\$ 13.012	0	(149)	(149)	(0,01)
	07/2018	€ 52	60	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	RUB 54.641	868	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	\$ 7.973	€ 6.874	53	0	53	0,01
	07/2018	868	PLN 3.186	0	(17)	(17)	0,00
	07/2018	868	TRY 4.049	14	0	14	0,00
	08/2018	€ 3.390	\$ 4.215	239	0	239	0,02
	08/2018	\$ 13.019	CAD 17.313	148	0	148	0,02
	09/2018	68	ARS 1.848	0	(8)	(8)	0,00
	10/2018	€ 230	\$ 285	15	0	15	0,00
IND	08/2018	\$ 750	ZAR 9.534	0	(58)	(58)	(0,01)
JPM	07/2018	AUD 4.116	\$ 3.100	59	0	59	0,01
	07/2018	CHF 11.010	11.111	23	0	23	0,00
	07/2018	€ 760	948	60	0	60	0,01
	07/2018	¥ 1.360.000	12.514	214	0	214	0,02
	07/2018	NZD 1.439	1.013	39	0	39	0,00
	07/2018	\$ 1.659	INR 112.154	0	(23)	(23)	0,00
	07/2018	922	NOK 7.645	16	0	16	0,00
	07/2018	870	PLN 3.238	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	ZAR 21.316	\$ 1.603	53	(3)	50	0,01
	08/2018	\$ 11.139	CHF 11.010	0	(24)	(24)	0,00
	08/2018	3.673	MXN 71.639	0	(60)	(60)	(0,01)
MSB	07/2018	CAD 3.600	\$ 2.774	37	0	37	0,00
	07/2018	¥ 620.000	5.705	98	0	98	0,01
	09/2018	ARS 11.587	525	146	0	146	0,01
	09/2018	MYR 1.109	277	3	0	3	0,00
	09/2018	THB 12.543	395	15	0	15	0,00
	09/2018	\$ 2.605	SGD 3.474	0	(53)	(53)	(0,01)
NGF	09/2018	CNH 73.569	\$ 11.522	453	0	453	0,04
	09/2018	KRW 2.087.920	1.885	5	0	5	0,00
	09/2018	SGD 5.607	4.135	16	0	16	0,00
	09/2018	TWD 125.063	4.135	11	0	11	0,00
RBC	07/2018	DKK 5.960	962	28	0	28	0,00
	07/2018	¥ 213.900	1.945	14	0	14	0,00
RYL	09/2018	HKD 2.535	323	0	0	0	0,00
	10/2018	€ 670	836	48	0	48	0,01
SCX	07/2018	BRL 8.843	2.421	123	0	123	0,01
	07/2018	CAD 6.500	5.025	84	0	84	0,01
	07/2018	COP 8.511.643	2.993	97	0	97	0,01
	07/2018	DKK 17.221	2.699	0	0	0	0,00
	07/2018	NOK 7.645	938	0	0	0	0,00
	07/2018	SEK 37.485	4.210	20	0	20	0,00
	07/2018	\$ 5.834	RUB 372.546	103	0	103	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	08/2018	TRY 2.597	\$ 581	\$ 25	\$ 0	\$ 25	0,00
	08/2018	\$ 939	NOK 7.645	0	0	0	0,00
	08/2018	5.776	RUB 361.795	0	(37)	(37)	0,00
	08/2018	4.219	SEK 37.485	0	(20)	(20)	0,00
	10/2018	2.719	DKK 17.221	0	(1)	(1)	0,00
SOG	07/2018	TWD 52.650	\$ 1.736	6	(1)	5	0,00
	07/2018	\$ 808	INR 55.422	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	868	PHP 46.480	1	0	1	0,00
	07/2018	868	PLN 3.231	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	4.207	SEK 37.485	0	(17)	(17)	0,00
	08/2018	153	ARS 3.170	0	(48)	(48)	0,00
SSB	07/2018	CHF 1.222	\$ 1.236	5	0	5	0,00
	07/2018	\$ 16.801	€ 14.433	50	0	50	0,01
	07/2018	827	INR 56.693	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	€ 14.433	\$ 16.839	0	(49)	(49)	0,00
	09/2018	HKD 37.386	\$ 4.773	1	0	1	0,00
TOR	07/2018	¥ 6.077.424	55.315	447	0	447	0,04
	08/2018	\$ 55.428	¥ 6.077.424	0	(451)	(451)	(0,04)
UAG	07/2018	90.430	£ 68.391	0	(137)	(137)	(0,01)
	07/2018	868	PLN 3.144	0	(28)	(28)	0,00
	08/2018	£ 68.391	\$ 90.558	143	0	143	0,01
	09/2018	HKD 2.783	355	0	0	0	0,00
	09/2018	RUB 799.530	12.719	62	0	62	0,01
	09/2018	\$ 8.815	HKD 69.030	0	(4)	(4)	0,00
	09/2018	6.073	IDR 86.492.369	0	(99)	(99)	(0,01)
	09/2018	3.601	INR 246.695	0	(37)	(37)	0,00
				\$ 4.300	\$ (3.459)	\$ 841	0,08

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged) und Class G Retail EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 6.401	AUD 8.672	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
	07/2018	1.569	BRL 5.931	0	(27)	(27)	0,00
	07/2018	125.808	€ 107.176	0	(675)	(675)	(0,07)
	08/2018	AUD 8.672	\$ 6.402	0	(6)	(6)	0,00
	08/2018	BRL 5.931	1.564	28	0	28	0,00
	08/2018	ILS 812	225	3	0	3	0,00
	09/2018	SGD 1.840	1.386	34	0	34	0,00
BPS	07/2018	¥ 2.665.190	24.539	478	0	478	0,05
	09/2018	INR 136.840	2.000	23	0	23	0,00
BRC	07/2018	€ 407	476	3	(2)	1	0,00
	07/2018	£ 306	405	1	0	1	0,00
CBK	07/2018	CAD 11.250	8.641	89	0	89	0,01
	07/2018	€ 337	395	3	(1)	2	0,00
	07/2018	£ 12.983	17.201	60	0	60	0,01
	07/2018	\$ 435	€ 377	5	0	5	0,00
	08/2018	TRY 1.574	\$ 356	18	0	18	0,00
	09/2018	TWD 74.875	2.522	53	0	53	0,01
GLM	07/2018	AUD 8.672	6.519	112	0	112	0,01
	07/2018	CHF 7.526	7.605	26	0	26	0,00
	07/2018	€ 1.476	1.715	0	(10)	(10)	0,00
	07/2018	\$ 10.392	€ 8.898	0	(2)	(2)	0,00
HUS	07/2018	8.455	CAD 11.250	97	0	97	0,01
	08/2018	CAD 11.250	\$ 8.460	0	(96)	(96)	(0,01)
	08/2018	RUB 41.998	672	6	0	6	0,00
	09/2018	IDR 13.416.480	934	8	0	8	0,00
	09/2018	TWD 18.135	611	13	0	13	0,00
JPM	07/2018	NOK 7.443	898	0	(16)	(16)	0,00
	07/2018	\$ 7.595	CHF 7.526	0	(16)	(16)	0,00
	08/2018	CHF 7.526	\$ 7.614	16	0	16	0,00
	08/2018	MXN 23.718	1.216	20	0	20	0,00
	08/2018	ZAR 28.997	2.272	166	0	166	0,02
MSB	07/2018	€ 135.044	155.975	0	(1.695)	(1.695)	(0,16)
	07/2018	PLN 2.258	664	61	0	61	0,01
	08/2018	\$ 156.319	€ 135.044	1.693	0	1.693	0,17
	09/2018	MYR 5.398	\$ 1.348	15	0	15	0,00
RBC	07/2018	€ 6.433	7.454	0	(57)	(57)	(0,01)
	07/2018	\$ 156	€ 134	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	€ 547	\$ 636	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	\$ 3.125	€ 2.674	0	(4)	(4)	0,00
	09/2018	HKD 2.221	\$ 283	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	BRL 5.931	1.624	83	0	83	0,01
	07/2018	€ 2.511	2.959	27	0	27	0,00
	07/2018	¥ 62.058	566	6	0	6	0,00
	07/2018	\$ 1.841	DKK 11.744	0	0	0	0,00
	07/2018	159.579	€ 137.752	1.253	0	1.253	0,12

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	07/2018	\$ 288	¥ 31.552	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	07/2018	913	NOK 7.443	0	0	0	0,00
	07/2018	2.574	SEK 22.916	0	(12)	(12)	0,00
	08/2018	NOK 7.443	\$ 914	0	0	0	0,00
	08/2018	SEK 22.916	2.579	12	0	12	0,00
	09/2018	KRW 6.048.659	5.627	181	0	181	0,02
	10/2018	DKK 11.744	1.854	1	0	1	0,00
SOG	07/2018	SEK 22.916	2.572	11	0	11	0,00
SSB	07/2018	€ 137.768	160.376	0	(475)	(475)	(0,05)
	07/2018	\$ 158.933	€ 136.581	532	0	532	0,05
	07/2018	291	£ 222	3	0	3	0,00
	08/2018	160.732	€ 137.768	469	0	469	0,05
TOR	07/2018	24.943	¥ 2.740.672	0	(200)	(200)	(0,02)
	08/2018	¥ 2.695.697	\$ 24.586	200	0	200	0,02
UAG	07/2018	DKK 11.744	1.958	118	0	118	0,01
	07/2018	\$ 17.572	£ 13.289	0	(27)	(27)	0,00
	08/2018	£ 13.289	\$ 17.597	28	0	28	0,00
	09/2018	HKD 94.444	12.060	6	0	6	0,00
	09/2018	PHP 29.411	554	6	0	6	0,00
				\$ 5.973	\$ (3.326)	\$ 2.647	0,26

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 115	AUD 155	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2018	35	BRL 133	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	2.377	£ 1.780	0	(27)	(27)	0,00
	08/2018	AUD 155	\$ 115	0	0	0	0,00
	08/2018	BRL 133	35	1	0	1	0,00
	09/2018	SGD 33	25	1	0	1	0,00
BPS	07/2018	€ 426	494	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	¥ 42.351	390	8	0	8	0,00
	09/2018	INR 3.037	44	1	0	1	0,00
BRC	07/2018	£ 2.008	2.625	0	(25)	(25)	0,00
	08/2018	\$ 2.629	£ 2.008	25	0	25	0,00
CBK	07/2018	CAD 194	\$ 149	2	0	2	0,00
	07/2018	DKK 220	37	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 2.693	£ 2.033	0	(9)	(9)	0,00
	08/2018	TRY 50	\$ 11	1	0	1	0,00
GLM	07/2018	AUD 155	117	2	0	2	0,00
	07/2018	CHF 133	135	0	0	0	0,00
	07/2018	SEK 383	43	1	0	1	0,00
HUS	07/2018	\$ 146	CAD 194	2	0	2	0,00
	08/2018	CAD 194	\$ 146	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	RUB 1.125	18	0	0	0	0,00
	09/2018	IDR 244.551	17	0	0	0	0,00
	09/2018	TWD 2.106	71	1	0	1	0,00
JPM	07/2018	\$ 134	CHF 133	0	0	0	0,00
	08/2018	CHF 133	\$ 135	0	0	0	0,00
	08/2018	ZAR 568	45	3	0	3	0,00
MSB	09/2018	MYR 139	35	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	BRL 133	37	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 2.689	£ 2.023	0	(19)	(19)	0,00
	09/2018	KRW 103.585	\$ 96	3	0	3	0,00
SOG	08/2018	ILS 33	9	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	£ 8	10	0	0	0	0,00
	07/2018	NOK 174	21	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 496	€ 426	1	0	1	0,00
	08/2018	€ 426	\$ 497	0	(2)	(2)	0,00
TOR	07/2018	\$ 385	¥ 42.351	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	¥ 42.351	\$ 386	3	0	3	0,00
UAG	07/2018	£ 2.013	2.662	4	0	4	0,00
	08/2018	MXN 394	20	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 2.666	£ 2.013	0	(4)	(4)	0,00
	09/2018	HKD 1.495	\$ 191	0	0	0	0,00
				\$ 63	\$ (95)	\$ (32)	0,00
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ (4.331)</b>	<b>(0,42)</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Fannie Mae, TBA			
3,000 % fällig am 01.07.2048	\$ 3.800	\$ (3.682)	(0,36)
3,000 % fällig am 01.08.2048	65.000	(62.910)	(6,13)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (66.592)</b>	<b>(6,49)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 1.372.571</b>	<b>133,66</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (345.651)</b>	<b>(33,66)</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 1.026.920</b>	<b>100,00</b>

### 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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(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:

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Dommo Energia S.A.	26.12.2017	\$ 28	\$ 292	0,03

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 65.989 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 33.999 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 21.553 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 431.704	\$ 1.023.197	
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(13.211)	(2.988)	461	(15.738)
Leerverkäufe	0	(66.592)	0	(66.592)
<b>Summen</b>	<b>\$ 418.493</b>	<b>\$ 953.617</b>	<b>\$ 461</b>	<b>\$ 1.372.571</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 453.328	\$ 983.923	
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	2.113	317	265	2.695
Leerverkäufe	0	(90.688)	0	(90.688)
<b>Summen</b>	<b>\$ 455.441</b>	<b>\$ 893.552</b>	<b>\$ 300</b>	<b>\$ 1.349.293</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 der Wertpapieranlagen.

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
GRE	1,920 %	17.04.2018	17.07.2018	\$ (15.022)	\$ (15.082)	(1,47)
	2,040	10.05.2018	17.07.2018	(13.983)	(14.024)	(1,36)
IND	1,980	03.05.2018	03.07.2018	(32.142)	(32.246)	(3,14)
	2,010	09.05.2018	09.07.2018	(4.700)	(4.714)	(0,46)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (66.066)</b>	<b>(6,43)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BNP	\$ 16	\$ 0	\$ 16
BOA	(548)	1.680	1.132
BPS	(871)	610	(261)
BRC	23	0	23
CBK	275	(880)	(605)
CKL	(136)	0	(136)
DUB	110	(280)	(170)
FBF	(370)	270	(100)
GLM	284	(740)	(456)
GST	(151)	0	(151)
HUS	(636)	640	4
IND	(58)	0	(58)
JPM	1.224	(1.330)	(106)
MEI	(5.100)	6.510	1.410
MSB	320	(300)	20
MYC	(1.642)	1.269	(373)
MYI	5	180	185
NGF	485	(540)	(55)
RBC	(15)	0	(15)
RYL	42	(74)	(32)
SCX	1.928	(900)	1.028
SOG	(54)	0	(54)
SSB	534	1.030	1.564
TOR	(4)	0	(4)
UAG	8	(10)	(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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	91,87	90,46
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	30,41	43,02
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	19,40	1,26
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(1,34)	0,20
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,23	(0,32)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,42)	0,37
Leerverkaufte Wertpapiere	(6,49)	(8,50)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(6,43)	(11,60)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0,00	(0,19)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Multi-Asset Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	33.855.974	\$ 338.964	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	31.532.908	\$ 315.700
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 66.989	65.599	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 56.342	54.788
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b)	20.286	22.456	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)	37.551	36.801
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.01.2018	JPY 1.980.000	18.223		<b>AKTIEN</b>	
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£ 8.106	18.222	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (a)	2.806.100	30.054
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.07.2018	JPY 1.980.000	18.111		<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	\$ 16.151	16.005	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 15.05.2024	\$ 21.300	21.068
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)	14.794	14.839	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2021 (b)	17.993	17.691
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.09.2018	JPY 1.326.600	12.506	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	16.151	15.982
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€ 8.713	12.398	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£ 8.936	14.132
	<b>AKTIEN</b>		Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2027	JPY 1.380.700	13.375
Source Physical Gold P-ETC	83.037	10.314	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$ 10.277	12.101
	<b>PARI (000S)</b>		U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.07.2024	9.500	9.246
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.02.2047 (b)	\$ 8.036	7.826		<b>AKTIEN</b>	
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2046	£ 3.503	7.562	GGP, Inc.	380.663	8.104
U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 15.05.2024	\$ 7.500	7.402	Alphabet, Inc. 'C'	7.083	7.740
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	7.393	7.247		<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	6.672	6.562	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2046	£ 3.401	7.570
U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.05.2048	6.400	6.438	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.02.2025	\$ 7.600	7.286
France Government International Bond 1,850 % fällig am 25.07.2027	€ 3.954	6.094		<b>AKTIEN</b>	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	JPY 584.700	5.486	Omnicom Group, Inc.	90.236	7.071
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b)	\$ 5.287	5.224		<b>PARI (000S)</b>	
			U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 6.035	6.616
				<b>AKTIEN</b>	
			Pfizer, Inc.	183.533	6.612
				<b>PARI (000S)</b>	
			U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.05.2048	\$ 6.400	6.435
				<b>AKTIEN</b>	
			Gilead Sciences, Inc.	77.426	6.267

(a) Der Global Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Nennwert des Wertpapiers wurde 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.







## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
15.609 % fällig am 04.10.2018 (b)(c) NGN	47.650	\$ 128	0,01
		1.596	0,07
Summe kurzfristige Instrumente		84.756	3,81

### AKTIEN

ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS			
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (f)			
12.040.233	120.559	5,41	
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt	\$ 3.171.999	142,34	

### 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
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2018	14	\$ (12)	0,00
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2019	14	(15)	0,00
90-Day Eurodollar June Futures	Long	06/2019	14	(15)	0,00
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2019	14	(14)	0,00
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2018	14	(9)	0,00
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2019	14	(15)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09/2018	205	(59)	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	49	(63)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 162,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	178	(182)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Short	09/2018	114	(88)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09/2018	98	182	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	50	31	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	340	364	0,02
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	19	44	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	29	(41)	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	20	(36)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 157,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	89	51	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2018	310	(77)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	92	12	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09/2018	679	(395)	(0,02)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09/2018	374	(1.356)	(0,06)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	19	(83)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	548	(856)	(0,05)
				\$ (2.632)	(0,12)

### VERKAUFSSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	\$ 141,000	27.07.2018	27	\$ (26)	\$ (2)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	142,000	27.07.2018	36	(24)	(6)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	143,000	27.07.2018	107	(81)	(33)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	145,000	27.07.2018	52	(31)	(52)	(0,00)
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	146,000	27.07.2018	57	(35)	(34)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	146,500	27.07.2018	55	(35)	(25)	0,00
				\$ (232)	\$ (152)	(0,00)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (2.784)	(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>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.06.2022	\$ 100	\$ (2)	0,00
Daimler AG	1,000	20.12.2020	€ 760	(1)	0,00
				\$ (3)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-30 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2023	\$ 27.814	\$ 138	0,01
iTraxx Europe Main 26 5-Year Index	(1,000)	20.12.2021	€ 12.200	94	0,00
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	34.700	333	0,02
				\$ 565	0,03

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000 %	15.12.2047	\$ 8.250	\$ 449	0,02
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,428	20.12.2047	1.800	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,478	20.12.2047	4.292	(58)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,499	20.12.2047	1.120	(18)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,970	04.01.2027	BRL 25.500	75	0,00
Erhalt	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	NZD 8.200	(192)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.06.2027	\$ 2.500	109	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	20.06.2020	134.400	75	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,850	20.07.2026	31.600	594	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,850	27.07.2026	12.150	228	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.12.2019	400	5	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	40.300	(128)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,000	27.07.2026	78.000	1.473	0,06
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	49.000	(1.390)	(0,06)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	34.030	220	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	31.300	163	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,300	21.04.2026	6.400	130	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,300	27.04.2026	37.200	755	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,400	07.12.2026	11.000	149	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,500	19.12.2023	20.000	(656)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	23.070	(518)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,670	19.11.2023	14.000	(463)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,678	25.10.2023	21.200	(705)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,681	12.12.2023	14.000	(461)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,750	19.12.2048	1.800	129	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,951	19.11.2048	2.000	148	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,953	12.12.2048	2.000	147	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,969	25.10.2048	3.180	236	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	3,100	17.04.2028	3.110	5	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	£ 2.340	(23)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	46.170	(838)	(0,04)
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,500	21.03.2068	11.100	896	0,04
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	1.590	(20)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 2.650.000	(67)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	1.170.000	(48)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	1.290.000	(61)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	0,806	15.04.2021	€ 19.300	142	0,01
Zahlung	CPTFEMU	1,165	15.12.2021	35.960	347	0,01
Zahlung	CPTFEMU	1,360	15.06.2027	12.000	34	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,475	15.05.2023	100	0	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,505	26.06.2021	2.200	(2)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,535	15.06.2023	8.400	1	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,535	15.03.2028	1.800	(12)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,710	15.03.2033	1.900	7	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	1.900	(27)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,678	24.05.2021	\$ 23.600	230	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,845	24.05.2026	5.900	(114)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,550	26.07.2021	6.900	90	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,603	12.09.2021	6.020	84	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,730	26.07.2026	6.900	(150)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	1,780	15.09.2026	400	(9)	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,801	12.09.2026	6.020	(135)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,070	23.03.2019	1.720	3	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,070	04.10.2019	3.300	(28)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,143	25.04.2020	300	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

Zahlung/Erhalt					Nicht realisierte	% des
variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Wertzunahme/ (-abnahme)	Nettovermögens
Erhalt	CPURNSA	2,150 %	25.09.2027	\$ 3.800	\$ (86)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,156	17.10.2027	8.200	(202)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,168	15.07.2020	11.700	60	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,180	20.09.2027	3.820	(86)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,210	05.02.2023	21.840	144	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,263	09.05.2023	7.120	13	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,281	10.05.2023	10.910	11	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,335	05.02.2028	11.090	(65)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,353	09.05.2028	7.120	1	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,360	09.05.2028	10.710	9	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,364	10.05.2028	10.910	13	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,370	06.06.2028	16.800	3	0,00
Zahlung	FRCPXTOB	1,000	15.04.2020	€ 2.060	10	0,00
Zahlung	FRCPXTOB	1,345	15.06.2021	21.490	11	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,350	15.01.2023	13.240	(76)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,575	15.01.2028	6.210	(26)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,590	15.02.2028	14.990	(31)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,606	15.02.2028	1.630	0	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,910	15.01.2038	4.150	37	0,00
Erhalt	UKRPI	3,100	15.06.2031	£ 12.350	490	0,02
Erhalt	UKRPI	3,140	15.04.2031	1.900	71	0,00
Erhalt	UKRPI	3,190	15.04.2030	10.600	353	0,01
Erhalt	UKRPI	3,325	15.08.2030	10.100	393	0,02
Erhalt	UKRPI	3,358	15.04.2035	20.900	1.289	0,06
Zahlung	UKRPI	3,428	15.03.2047	7.710	(762)	(0,04)
Erhalt	UKRPI	3,470	15.09.2032	7.900	376	0,02
Erhalt	UKRPI	3,530	15.10.2031	4.930	216	0,01
Zahlung	UKRPI	3,585	15.10.2046	1.420	(187)	(0,01)
					\$ 2.780	0,12
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 3.342</b>	<b>0,15</b>

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

### FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf		Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
		Ausübungskurs						
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.07.2018	\$ 5.900	\$ (6)	\$ (2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	11.700	(15)	(13)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	€ 18.100	(35)	(25)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 3.200	(6)	0	0,00
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	3.800	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	5.000	(7)	(6)	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 36.100	(74)	(90)	(0,01)
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 3.300	(5)	0	0,00
						\$ (152)	\$ (137)	(0,01)

### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Call - OTC USD versus MXN	MXN 21,100	22.08.2018	\$ 7.985	\$ (89)	\$ (48)	0,00

### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher		Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
		Index	Variabler Zinssatz					
CBK	Floor - OTC CPURNSA	\$ 216,687	Maximal $[(1 + 0,000\%)^{10} - (\text{Index Final/Index Initial})]$ oder 0	07.04.2020	\$ 26.500	\$ (236)	\$ 0	0,00
	Floor - OTC CPURNSA	217,965	Maximal $[(1 + 0,000\%)^{10} - (\text{Index Final/Index Initial})]$ oder 0	29.09.2020	3.000	(39)	0	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	€ 7.800	\$ (356)	\$ (45)	0,00
JPM	Cap - OTC CPURNSA	233,916	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	22.04.2024	\$ 37.600	(273)	(2)	0,00
	Cap - OTC CPURNSA	234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	3.100	(21)	0	0,00
	Floor - OTC YOY CPURNSA	234,812	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	24.03.2020	31.300	(354)	(29)	0,00
						\$ (1.279)	\$ (76)	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,250 %	04.12.2018	\$ 21.300	\$ (121)	\$ (78)	(0,01)

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

## ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens	
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	10-Year USD-ISDA - 2-Year USD-ISDA		0,000 %	02.01.2020	\$ 165.400	\$ (128)	\$ (239)	(0,01)

<sup>(1)</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	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2021	\$ 700	\$ (60)	\$ 43	\$ (17)	0,00
DUB	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2021	1.100	(95)	68	(27)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	2.400	(155)	43	(112)	0,00
					\$ (310)	\$ 154	\$ (156)	0,00

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)	\$ 751	\$ 38	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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
BRC	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,374) %	20.06.2020	ILS 15.270	\$ 0	\$ 5	\$ 5	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	3.290	0	(6)	(6)	0,00
DUB	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,414)	20.06.2020	14.860	0	2	2	0,00
	Zahlung	CPURNSA	2,500	15.07.2022	\$ 38.000	863	(3.791)	(2.928)	(0,13)
GLM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	ILS 11.900	1	3	4	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,290)	16.02.2020	29.300	0	0	0	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,270)	21.03.2020	18.100	0	5	5	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,883	21.03.2028	3.790	0	(6)	(6)	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	6.170	(1)	10	9	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	2.550	0	(2)	(2)	0,00
HUS	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	9.550	0	4	4	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	2.050	0	(1)	(1)	0,00
JPM	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	2,078	20.06.2028	3.170	0	4	4	0,00
MYC	Erhalt	CPURNSA	2,058	12.05.2025	\$ 1.000	0	(16)	(16)	0,00
	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	2.400	0	(124)	(124)	(0,01)
						\$ 863	\$ (3.913)	\$ (3.050)	(0,14)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	09/2018	\$ 856	THB 27.235	\$ 0	\$ (32)	\$ (32)	0,00
BOA	07/2018	1.193	ARS 30.981	0	(119)	(119)	(0,01)
	07/2018	55.750	AUD 75.521	49	0	49	0,00
	08/2018	ARS 58.300	\$ 2.706	770	0	770	0,03
	08/2018	AUD 75.521	55.755	0	(50)	(50)	0,00
	09/2018	ARS 28.599	1.299	377	0	377	0,02
BPS	07/2018	40.804	1.474	73	0	73	0,00
	07/2018	¥ 4.887.375	44.999	876	0	876	0,04
	07/2018	PEN 19.057	5.815	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 1.486	ARS 40.804	0	(72)	(72)	0,00
	07/2018	5.481	£ 4.090	0	(81)	(81)	0,00
	08/2018	ARS 47.140	\$ 2.190	624	0	624	0,03
	08/2018	MXN 128.431	6.751	273	0	273	0,01
	09/2018	\$ 221	IDR 3.103.648	0	(6)	(6)	0,00
	09/2018	6.051	INR 413.305	0	(80)	(80)	0,00
BRC	07/2018	€ 20.125	\$ 23.259	0	(238)	(238)	(0,01)
	07/2018	\$ 733.332	£ 560.625	6.961	(128)	6.833	0,31
	08/2018	£ 552.768	\$ 723.838	0	(6.943)	(6.943)	(0,31)
	09/2018	ARS 22.258	820	102	0	102	0,00
	09/2018	KRW 2.630.978	2.375	6	0	6	0,00
	09/2018	SGD 1.308	965	4	0	4	0,00
	09/2018	TWD 29.171	965	3	0	3	0,00
CBK	07/2018	CAD 78.092	59.985	620	0	620	0,03
	07/2018	RUB 423.825	6.702	0	(52)	(52)	0,00
	07/2018	\$ 358	ARS 9.333	0	(39)	(39)	0,00
	07/2018	4.828	COP 13.835.578	0	(120)	(120)	(0,01)
	07/2018	25.270	€ 21.677	165	(126)	39	0,00
	07/2018	11.711	£ 8.834	0	(48)	(48)	0,00
	07/2018	253	TRY 1.161	1	0	1	0,00
	08/2018	236	1.073	0	(7)	(7)	0,00
	10/2018	357	ARS 10.720	0	(19)	(19)	0,00
DUB	07/2018	ARS 80.606	\$ 2.890	96	0	96	0,00
	07/2018	\$ 351	ARS 8.822	0	(45)	(45)	0,00
FBF	07/2018	€ 290	\$ 360	21	0	21	0,00
GLM	07/2018	AUD 75.310	56.614	971	0	971	0,04
	07/2018	£ 11.034	14.715	148	0	148	0,01
	07/2018	\$ 13.598	£ 11.640	0	(8)	(8)	0,00
	07/2018	3.382	£ 2.536	1	(34)	(33)	0,00
	09/2018	INR 404.998	\$ 5.878	26	0	26	0,00
HUS	07/2018	ARS 57.632	2.720	754	0	754	0,03
	07/2018	€ 1.528	1.784	0	0	0	0,00
	07/2018	£ 91	120	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 310	ARS 8.096	0	(34)	(34)	0,00
	07/2018	58.693	CAD 78.092	672	0	672	0,03
	07/2018	9.114	€ 7.859	62	0	62	0,00
	07/2018	6.659	RUB 423.825	95	0	95	0,00
	08/2018	ARS 14.810	\$ 686	194	0	194	0,01
	08/2018	CAD 78.092	58.726	0	(669)	(669)	(0,03)
	08/2018	€ 9.460	11.721	628	0	628	0,03
	08/2018	RUB 128.225	2.025	0	(9)	(9)	0,00
	08/2018	\$ 2.062	RUB 128.887	0	(18)	(18)	0,00
	09/2018	CNH 72.963	\$ 11.466	487	0	487	0,02
	10/2018	€ 490	608	32	0	32	0,00
	10/2018	\$ 50	ARS 1.520	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07/2018	AUD 211	\$ 160	4	0	4	0,00
	07/2018	€ 2.210	2.712	131	0	131	0,01
	07/2018	¥ 2.880.000	26.500	452	0	452	0,02
	07/2018	NZD 52.433	36.253	753	0	753	0,03
	07/2018	\$ 28.430	€ 24.496	170	0	170	0,01
	10/2018	NGN 273.458	\$ 727	0	(19)	(19)	0,00
	11/2018	466.148	1.238	0	(29)	(29)	0,00
MSB	07/2018	ARS 26.788	949	35	0	35	0,00
	07/2018	CAD 7.400	5.703	77	0	77	0,00
	07/2018	¥ 1.320.000	12.147	209	0	209	0,01
	09/2018	ARS 8.387	380	106	0	106	0,01
	10/2018	NGN 89.028	237	0	(6)	(6)	0,00
NGF	07/2018	ARS 12.512	440	13	0	13	0,00
	09/2018	KRW 2.244.099	2.026	5	0	5	0,00
	09/2018	SGD 4.659	3.436	13	0	13	0,00
	09/2018	TWD 103.922	3.436	9	0	9	0,00
RYL	10/2018	€ 1.450	1.810	105	0	105	0,00
SCX	07/2018	CAD 13.900	10.746	179	0	179	0,01
	07/2018	£ 559.636	743.971	5.112	0	5.112	0,23
	07/2018	\$ 15.409	DKK 98.317	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	35.762	NZD 52.433	0	(262)	(262)	(0,01)
	07/2018	6.107	SEK 54.382	0	(28)	(28)	0,00
	08/2018	NZD 52.433	\$ 35.764	263	0	263	0,01
	08/2018	SEK 54.382	6.121	29	0	29	0,00
	09/2018	KRW 4.846.374	4.509	145	0	145	0,01
	10/2018	DKK 98.317	15.522	5	0	5	0,00
	10/2018	NGN 44.672	119	0	(3)	(3)	0,00
	11/2018	445.922	1.183	0	(29)	(29)	0,00
SOG	07/2018	SEK 54.382	6.104	25	0	25	0,00
	08/2018	\$ 209	ARS 4.343	0	(66)	(66)	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte	Nicht realisierte	Nicht realisierte	% des
				Wertzunahme	(Wertabnahme)	Nettowertzunahme/ (-abnahme)	
SSB	07/2018	€ 361.353	418.394	\$ 0	\$ (3.504)	\$ (3.504)	(0,16)
	09/2018	\$ 2.995	IDR 42.031.032	0	(93)	(93)	0,00
TOR	07/2018	£ 5.338	7.107	59	0	59	0,00
	07/2018	\$ 44.483	¥ 4.887.375	0	(359)	(359)	(0,02)
UAG	08/2018	¥ 4.887.375	\$ 44.575	363	0	363	0,02
	07/2018	DKK 98.319	16.393	986	0	986	0,04
	07/2018	\$ 378.283	€ 325.783	2.085	0	2.085	0,09
	08/2018	€ 325.783	\$ 379.128	0	(2.065)	(2.065)	(0,09)
				\$ 26.424	\$ (15.446)	\$ 10.978	0,49

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Class Z AUD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte	Nicht realisierte	Nicht realisierte	% des
				Wertzunahme	(Wertabnahme)	Nettowertzunahme/ (-abnahme)	
AZD	07/2018	\$ 3.010	AUD 3.999	\$ 0	\$ (55)	\$ (55)	0,00
BOA	07/2018	AUD 3.917	\$ 2.892	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	\$ 2.892	AUD 3.917	3	0	3	0,00
BRC	07/2018	AUD 39	\$ 29	1	0	1	0,00
GLM	07/2018	3.962	2.910	0	(17)	(17)	0,00
	07/2018	\$ 2.975	AUD 3.958	0	(51)	(51)	0,00
HUS	08/2018	2.875	3.914	17	0	17	0,00
	07/2018	AUD 65	\$ 49	1	0	1	0,00
JPM	07/2018	150	114	3	0	3	0,00
	07/2018	\$ 3.017	AUD 3.979	0	(77)	(77)	(0,01)
RYL	07/2018	AUD 2	\$ 1	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 22	AUD 29	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2018	AUD 41	30	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 32	AUD 44	0	0	0	0,00
TOR	07/2018	48	64	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 25	\$ (205)	\$ (180)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CHF (Hedged) Class und Investor CHF (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte	Nicht realisierte	Nicht realisierte	% des
				Wertzunahme	(Wertabnahme)	Nettowertzunahme/ (-abnahme)	
BOA	07/2018	35.386	CHF 34.849	\$ 0	\$ (290)	\$ (290)	(0,01)
BPS	07/2018	CHF 26	26	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 16	CHF 16	0	0	0	0,00
BRC	07/2018	CHF 104	106	1	0	1	0,00
CBK	07/2018	\$ 35.461	CHF 35.025	0	(187)	(187)	(0,01)
GLM	07/2018	CHF 35.484	35.555	2	(183)	(181)	(0,01)
	07/2018	\$ 35.325	CHF 34.957	0	(120)	(120)	(0,01)
JPM	08/2018	35.293	35.138	182	0	182	0,01
	07/2018	CHF 34.993	35.316	75	0	75	0,00
SSB	07/2018	\$ 80	CHF 79	0	0	0	0,00
	08/2018	35.379	34.966	0	(76)	(76)	0,00
	07/2018	1.565	1.559	6	(1)	5	0,00
				\$ 266	\$ (857)	\$ (591)	(0,03)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional USD (Currency Exposure) Accumulation Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte	Nicht realisierte	Nicht realisierte	% des
				Wertzunahme	(Wertabnahme)	Nettowertzunahme/ (-abnahme)	
BOA	07/2018	AUD 1.387	\$ 1.024	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	08/2018	\$ 1.024	AUD 1.387	1	0	1	0,00
BPS	07/2018	18.545	€ 15.989	123	0	123	0,01
	07/2018	2.226	¥ 241.737	0	(43)	(43)	0,00
CBK	07/2018	1.721	CAD 2.240	0	(18)	(18)	0,00
	07/2018	225	DKK 1.351	0	(13)	(13)	0,00
GLM	07/2018	25.887	£ 19.539	0	(90)	(90)	(0,01)
	07/2018	1.043	AUD 1.387	0	(18)	(18)	0,00
HUS	07/2018	CAD 2.240	\$ 1.684	0	(19)	(19)	0,00
	08/2018	\$ 1.685	CAD 2.240	19	0	19	0,00
SCX	07/2018	SEK 7.871	\$ 884	4	0	4	0,00
	07/2018	\$ 405	NZD 575	0	(16)	(16)	0,00
SOG	08/2018	886	SEK 7.871	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	883	7.871	0	(4)	(4)	0,00
SSB	07/2018	€ 15.989	\$ 18.613	0	(55)	(55)	0,00
	08/2018	\$ 18.654	€ 15.989	54	0	54	0,00
TOR	07/2018	¥ 241.737	\$ 2.200	18	0	18	0,00
	08/2018	\$ 2.205	¥ 241.737	0	(18)	(18)	0,00
UAG	07/2018	£ 19.539	\$ 25.835	39	0	39	0,00
	08/2018	\$ 25.872	£ 19.539	0	(41)	(41)	0,00
				\$ 258	\$ (340)	\$ (82)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte			% des
				Wertzunahme	Wertabnahme	Nettowertzunahme/(-abnahme)	
BOA	07/2018	\$ 280.973	€ 239.361	\$ 0	\$ (1.507)	\$ (1.507)	(0,07)
BRC	07/2018	€ 1.479	\$ 1.729	9	(8)	1	0,00
CBK	07/2018	3.879	4.594	65	0	65	0,01
GLM	07/2018	\$ 6.723	€ 5.795	43	0	43	0,00
MSB	07/2018	€ 1.860	\$ 2.178	8	(1)	7	0,00
MSB	07/2018	251.741	290.760	0	(3.158)	(3.158)	(0,14)
RBC	08/2018	\$ 291.401	€ 251.741	3.157	0	3.157	0,14
RBC	07/2018	€ 7.208	\$ 8.351	0	(65)	(65)	0,00
RBC	07/2018	\$ 18.947	€ 16.267	46	0	46	0,00
RYL	07/2018	€ 444	\$ 523	4	0	4	0,00
RYL	07/2018	\$ 1.128	€ 963	0	(4)	(4)	0,00
SCX	07/2018	€ 1.035	\$ 1.218	10	0	10	0,00
SSB	07/2018	\$ 290.074	€ 250.358	2.232	0	2.232	0,10
SSB	07/2018	€ 250.727	\$ 291.872	0	(865)	(865)	(0,04)
SSB	07/2018	\$ 283.561	€ 243.682	949	0	949	0,04
SSB	08/2018	292.519	250.727	852	0	852	0,04
				\$ 7.375	\$ (5.608)	\$ 1.767	0,08

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged) und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte			% des
				Wertzunahme	Wertabnahme	Nettowertzunahme/(-abnahme)	
AZD	07/2018	£ 14.091	\$ 18.908	\$ 305	\$ 0	\$ 305	0,01
AZD	07/2018	\$ 200	£ 149	0	(3)	(3)	0,00
BOA	07/2018	65.205	48.834	0	(731)	(731)	(0,03)
BPS	07/2018	205	155	1	0	1	0,00
BRC	07/2018	£ 45.032	\$ 58.887	0	(567)	(567)	(0,03)
BRC	07/2018	\$ 565	£ 426	0	(3)	(3)	0,00
BRC	08/2018	58.969	45.032	566	0	566	0,03
CBK	07/2018	64.609	48.766	0	(226)	(226)	(0,01)
RYL	07/2018	88	67	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	65.038	48.923	0	(448)	(448)	(0,02)
SSB	07/2018	758	570	2	(7)	(5)	0,00
UAG	07/2018	£ 44.741	\$ 59.159	89	0	89	0,00
UAG	08/2018	\$ 59.243	£ 44.741	0	(93)	(93)	0,00
				\$ 963	\$ (2.078)	\$ (1.115)	(0,05)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional SEK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte			% des
				Wertzunahme	Wertabnahme	Nettowertzunahme/(-abnahme)	
GLM	07/2018	\$ 82	SEK 715	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
MSB	07/2018	SEK 716	\$ 80	0	0	0	0,00
MSB	08/2018	\$ 80	SEK 716	1	0	1	0,00
RYL	07/2018	80	708	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2018	SEK 710	\$ 80	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	\$ 80	SEK 699	0	(2)	(2)	0,00
SCX	08/2018	80	710	0	0	0	0,00
				\$ 1	\$ (5)	\$ (4)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional SGD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte			% des
				Wertzunahme	Wertabnahme	Nettowertzunahme/(-abnahme)	
BOA	09/2018	\$ 45.282	SGD 60.130	\$ 0	\$ (1.109)	\$ (1.109)	(0,05)
CBK	09/2018	37.885	50.724	0	(622)	(622)	(0,02)
HUS	09/2018	380	509	0	(7)	(7)	0,00
SCX	09/2018	11.110	14.895	0	(168)	(168)	(0,01)
SSB	09/2018	SGD 511	\$ 383	8	0	8	0,00
				\$ 8	\$ (1.906)	\$ (1.898)	(0,08)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 5.129 0,23

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARK TWERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Fannie Mae, TBA			
3,000 % fällig am 01.08.2048	\$ 41.400	\$ (40.069)	(1,80)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (40.069)	(1,80)
Summe Anlagen		\$ 3.137.617	140,80
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (909.218)	(40,80)
Nettovermögen		\$ 2.228.399	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) Wertpapier per Emissionstermin.

(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) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 593.327 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 19.039 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 13.500 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(i) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 1.025	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.01.2022	\$ (1.048)	\$ 1.025	\$ 1.025	0,05
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.048)	\$ 1.025	\$ 1.025	0,05

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

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 120.559	\$ 3.041.538	\$ 9.902	\$ 3.171.999
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(2.784)	8.471	0	5.687
Leerverkäufe	0	(40.069)	0	(40.069)
Summen	\$ 117.775	\$ 3.009.940	\$ 9.902	\$ 3.137.617

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 729	\$ 3.114.924	\$ 6.066	\$ 3.121.719
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.101)	(5.119)	0	(6.220)
Leerverkäufe	0	(63.921)	0	(63.921)
Summen	\$ (372)	\$ 3.045.884	\$ 6.066	\$ 3.051.578

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	1,980 %	01.05.2018	02.07.2018	\$ (71.635)	\$ (71.875)	(3,23)
	1,980	25.05.2018	02.07.2018	(2.139)	(2.144)	(0,10)
	2,000	08.05.2018	09.07.2018	(126.783)	(127.163)	(5,71)
	2,000	21.06.2018	09.07.2018	(9.225)	(9.230)	(0,41)
	2,000	28.06.2018	09.07.2018	(31.000)	(31.005)	(1,39)
BPS	(0,450)	19.04.2018	19.07.2018	€ (15.045)	(17.550)	(0,79)
GRE	1,950	23.04.2018	23.07.2018	\$ (46.802)	(46.977)	(2,11)
	2,070	23.05.2018	23.07.2018	(83.648)	(83.835)	(3,76)
	2,170	18.06.2018	18.07.2018	(7.011)	(7.017)	(0,31)
	2,200	15.06.2018	05.07.2018	(22.487)	(22.508)	(1,01)
IND	1,980	03.05.2018	03.07.2018	(111.602)	(111.964)	(5,02)
	2,060	18.05.2018	18.07.2018	(6.387)	(6.402)	(0,29)
SCX	0,640	26.04.2018	26.07.2018	£ (23.009)	(30.414)	(1,36)
	2,120	05.06.2018	06.08.2018	\$ (27.608)	(27.650)	(1,24)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (595.734)</b>	<b>(26,73)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 215	\$ (270)	\$ (55)
BOA	(2.610)	6.540	3.930
BPS	1.647	(1.260)	387
BRC	(235)	280	45
CBK	(823)	1.770	947
CKL	(90)	0	(90)
DUB	(2.902)	2.660	(242)
FBF	21	(30)	(9)
GLM	886	(1.210)	(324)
GST	38	(30)	8
HUS	2.077	(1.940)	137
JPM	1.360	(1.150)	210
MSB	421	(290)	131
MYC	(379)	443	64
NGF	40	0	40
RBC	(19)	0	(19)
RYL	103	(130)	(27)
SCX	7.016	(10.270)	(3.254)
SOG	(45)	0	(45)
SSB	(2.654)	1.320	(1.334)
TOR	62	0	62
UAG	1.000	(1.110)	(110)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	120,20	98,38
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	11,94	42,68
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	10,20	0,99
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,12)	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,15	(0,01)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,23	(0,22)
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,80)	(2,91)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(26,73)	(34,22)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0,00	(0,97)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Real Return Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	47.944.720	\$ 480.029	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	35.977.326	\$ 360.200
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
<b>United Kingdom Gilt</b>			<b>United Kingdom Gilt</b>		
0,125 % fällig am 22.03.2026	£ 72.660	117.410	0,125 % fällig am 22.03.2026	£ 103.551	166.512
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>			<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>		
0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 118.008	115.492	0,125 % fällig am 15.04.2021 (b)	\$ 147.955	145.756
<b>Japan Treasury Bills</b>			<b>United Kingdom Gilt</b>		
2,350 % fällig am 15.09.2024	€ 42.149	59.535	0,125 % fällig am 22.03.2046	£ 27.114	59.035
<b>United Kingdom Gilt</b>			<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>		
0,125 % fällig am 10.08.2048	£ 25.069	56.536	2,375 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 50.227	55.848
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>			<b>U.S. Treasury Notes</b>		
0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	\$ 53.885	54.090	2,750 % fällig am 15.02.2024	51.800	52.382
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>			<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>		
0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	43.908	42.872	0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	52.298	52.351
<b>Japan Treasury Bills</b>			<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>		
0,000 % fällig am 01.05.2018	JPY 4.200.000	38.656	0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	37.357	36.488
<b>Japan Treasury Bills</b>			<b>U.S. Treasury Notes</b>		
0,000 % fällig am 30.07.2018	4.200.000	38.418	2,000 % fällig am 15.02.2025	35.510	33.828
<b>France Government International Bond</b>			<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>		
1,850 % fällig am 25.07.2027	€ 24.455	37.223	2,350 % fällig am 15.09.2024	€ 24.651	33.097
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>			<b>United Kingdom Gilt</b>		
0,125 % fällig am 15.04.2021 (b)	\$ 36.060	35.521	4,500 % fällig am 07.12.2042	£ 15.280	32.109
<b>U.S. Treasury Notes</b>			<b>U.S. Treasury Notes</b>		
2,250 % fällig am 31.12.2024	32.300	31.892	2,250 % fällig am 31.12.2024	\$ 32.300	31.905
<b>United Kingdom Gilt</b>			<b>France Government International Bond</b>		
4,500 % fällig am 07.12.2042	£ 15.280	31.851	0,100 % fällig am 01.03.2021	€ 25.624	31.415
<b>France Government International Bond</b>			<b>U.S. Treasury Notes</b>		
0,100 % fällig am 01.03.2025	€ 21.633	28.644	1,875 % fällig am 28.02.2022	\$ 30.200	29.435
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>			<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>		
0,125 % fällig am 15.04.2020 (b)	\$ 27.604	27.554	0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	29.146	28.304
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>			<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>		
1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)	25.382	25.490	0,100 % fällig am 15.05.2022	€ 22.004	27.247
<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>			<b>United Kingdom Gilt</b>		
0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	25.394	24.663	0,625 % fällig am 22.11.2042	£ 9.918	22.952
<b>United Kingdom Gilt</b>			<b>United Kingdom Gilt</b>		
4,250 % fällig am 07.03.2036	£ 13.000	24.393	0,750 % fällig am 22.03.2034	12.013	22.872
<b>Japan Treasury Bills</b>			<b>Japan Government International Bond</b>		
0,000 % fällig am 04.09.2018	JPY 2.571.100	24.238	0,100 % fällig am 10.03.2027	JPY 2.327.703	22.537
<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>			<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>		
0,100 % fällig am 15.05.2023	€ 18.256	23.259	0,100 % fällig am 15.05.2023	€ 18.349	22.422
<b>United Kingdom Gilt</b>			<b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>		
1,875 % fällig am 22.11.2022	£ 12.826	21.245	3,100 % fällig am 15.09.2026	14.465	21.861
			<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>		
			1,750 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 19.406	21.136
			<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>		
			3,625 % fällig am 15.04.2028 (b)	16.029	20.347
			<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>		
			0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	17.838	17.668
			<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities</b>		
			0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	17.186	16.894

(a) Der Global Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Nennbetrag des Wertpapiers wurde 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.









# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS
UDR, Inc. 3,500 % fällig am 15.01.2028	\$	2.940	0,00	Amgen, Inc. 4,000 % fällig am 13.09.2029	£	3.100	4,572	CH Robinson Worldwide, Inc. 4,200 % fällig am 15.04.2028	\$	4.790	4,715
4,625 % fällig am 10.01.2022		755	0,00	Andeavor Logistics LP 3,500 % fällig am 01.12.2022		1.084	1,060	Charles River Laboratories International, Inc. 5,500 % fällig am 01.04.2026		3.208	3,223
Ventas Realty LP 3,250 % fällig am 15.10.2026		700	0,00	4,250 % fällig am 01.12.2027		1.946	1,868	Charter Communications Operating LLC 3,579 % fällig am 23.07.2020		15.930	15,918
VEREIT Operating Partnership LP 3,950 % fällig am 15.08.2027		3.778	3,526	5,500 % fällig am 15.10.2019		1.198	1,229	4,043 % fällig am 01.02.2024 (c)		15.786	15,832
VICI Properties LLC 8,000 % fällig am 15.10.2023		19.498	21,740	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 2,200 % fällig am 01.08.2018		5.000	4,998	4,200 % fällig am 15.03.2028		12.421	11,651
Virgin Money Holdings UK PLC 8,750 % fällig am 10.11.2021 (i)(k)	£	1.240	1,709	Anthem, Inc. 4,101 % fällig am 01.03.2028		3.490	3,421	4,464 % fällig am 23.07.2022		12.402	12,566
Vornado Realty LP 3,500 % fällig am 15.01.2025	\$	3.856	3,696	AP Moller - Maersk A/S 1,750 % fällig am 16.03.2026	€	17.530	20,126	4,500 % fällig am 01.02.2024 (c)		9.202	9,204
Wells Fargo & Co. 2,125 % fällig am 20.12.2023	£	16.390	21,487	2,550 % fällig am 22.09.2019	\$	1.190	1,178	4,908 % fällig am 23.07.2025		6.984	7,063
3,000 % fällig am 23.10.2026		22.990	21,250	2,875 % fällig am 28.09.2020		2.170	2,142	Cheniere Energy Partners LP 5,250 % fällig am 01.10.2025		3.055	2,988
3,286 % fällig am 11.02.2022		52.580	53,138	3,875 % fällig am 28.09.2025		500	484	Chesapeake Energy Corp. 5,598 % fällig am 15.04.2019		1.896	1,896
3,469 % fällig am 24.01.2023		50.400	51,187	Aptiv PLC 3,150 % fällig am 19.11.2020		3.265	3,243	China Resources Gas Group Ltd. 4,500 % fällig am 05.04.2022		2.620	2,673
3,550 % fällig am 29.09.2025		10.500	10,188	Arrow Electronics, Inc. 3,250 % fällig am 08.09.2024		4.186	3,919	China Uranium Development Co. Ltd. 3,500 % fällig am 08.10.2018		7.630	7,641
3,584 % fällig am 22.05.2028		57.500	55,154	3,500 % fällig am 01.04.2022		14.875	14,682	Christian Dior SE 0,750 % fällig am 24.06.2021	€	1.900	2,253
3,589 % fällig am 31.10.2023		45.600	46,551	3,875 % fällig am 12.01.2028		10.570	9,924	1,375 % fällig am 19.06.2019		500	589
Welltower, Inc. 4,250 % fällig am 01.04.2026		1.600	1,586	Asciano Finance Ltd. 4,625 % fällig am 23.09.2020		4.160	4,219	Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. 6,500 % fällig am 15.11.2022	\$	2.467	2,529
4,250 % fällig am 15.04.2028		3.523	3,469	AutoNation, Inc. 3,350 % fällig am 15.01.2021		1.690	1,680	7,625 % fällig am 15.03.2020		13.620	13,586
Westfield America Management Ltd. 2,125 % fällig am 30.03.2025	£	4.440	5,789	5,500 % fällig am 01.02.2020		2.910	2,998	Cleveland-Cliffs, Inc. 4,875 % fällig am 15.01.2024		3.838	3,713
WeWork Cos., Inc. 7,875 % fällig am 01.05.2025 (m)	\$	7.666	7,379	Bacardi Ltd. 4,450 % fällig am 15.05.2025		14.900	14,871	CNH Industrial Capital LLC 3,375 % fällig am 15.07.2019		3.600	3,612
Weyerhaeuser Co. 7,375 % fällig am 01.10.2019		600	631	4,700 % fällig am 15.05.2028		18.200	17,935	3,875 % fällig am 15.10.2021		3.343	3,335
Woori Bank 2,875 % fällig am 02.10.2018		4.880	4,879	5,150 % fällig am 15.05.2038		5.100	4,828	4,375 % fällig am 06.11.2020		5.500	5,600
WP Carey, Inc. 4,250 % fällig am 01.10.2026		6.400	6,262	Baidu, Inc. 3,875 % fällig am 29.09.2023		13.700	13,624	4,875 % fällig am 01.04.2021		6.380	6,563
WPC Eurobond BV 2,125 % fällig am 15.04.2027	€	12.800	14,937	4,375 % fällig am 29.03.2028		4.400	4,350	CNPC General Capital Ltd. 2,750 % fällig am 14.05.2019		3.125	3,114
				BAT Capital Corp. 2,297 % fällig am 14.08.2020		1.590	1,555	Community Health Systems, Inc. 5,125 % fällig am 01.08.2021		11.201	10,417
				BAT International Finance PLC 2,750 % fällig am 15.06.2020		3.970	3,929	6,250 % fällig am 31.03.2023		64.233	59,175
		12.204.531	18,60	Baxalta, Inc. 2,875 % fällig am 23.06.2020		6.050	5,984	8,625 % fällig am 15.01.2024 (c)		29.200	29,346
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				BC Unlited Liability Co. 4,250 % fällig am 15.05.2024		40.650	38,617	Conagra Brands, Inc. 2,831 % fällig am 09.10.2020		21.410	21,314
AA Bond Co. Ltd. 2,750 % fällig am 31.07.2043	£	3.100	3,906	BMC Software Finance, Inc. 8,125 % fällig am 15.07.2021		141.171	144,524	Continental Airlines Pass-Through Trust 6,703 % fällig am 15.12.2022		312	335
2,875 % fällig am 31.07.2043		7.500	9,726	Board of Trustees of The Leland Stanford Junior University 3,647 % fällig am 01.05.2048		111.100	109,682	CSC Holdings LLC 5,375 % fällig am 01.02.2028		500	464
4,249 % fällig am 31.07.2043		9.610	13,095	Booking Holdings, Inc. 3,550 % fällig am 15.03.2028		4.552	4,341	7,625 % fällig am 15.07.2018		5.080	5,095
Air Canada Pass-Through Trust 3,700 % fällig am 15.07.2027	\$	2.690	2,568	Boral Finance Pty. Ltd. 3,000 % fällig am 01.11.2022		6.593	6,358	8,625 % fällig am 15.02.2019		4.415	4,553
Allergan Funding SCS 0,029 % fällig am 01.06.2019	€	1.351	1,579	Boston Scientific Corp. 2,850 % fällig am 15.05.2020		400	397	CSCEC Finance Cayman Ltd. 2,950 % fällig am 19.11.2020		3.400	3,354
3,000 % fällig am 12.03.2020		8.600	8,563	6,000 % fällig am 15.01.2020		12.380	12,903	CVS Health Corp. 3,700 % fällig am 09.03.2023		25.003	24,903
3,450 % fällig am 15.03.2022		16.730	16,476	Boxer Parent Co., Inc. (9,000 % bar oder 9,750 % PIK) 9,000 % fällig am 15.10.2019 (d)		29.350	29,350	4,300 % fällig am 25.03.2028		48.750	48,182
3,581 % fällig am 12.03.2020		8.153	8,243	Brambles USA, Inc. 5,350 % fällig am 01.04.2020		990	1,022	CVS Pass-Through Trust 4,163 % fällig am 11.08.2036		1.769	1,680
Allergan Sales LLC 5,000 % fällig am 15.12.2021		9.830	10,178	Broadcom Corp. 2,200 % fällig am 15.01.2021		1.000	969	4,704 % fällig am 10.01.2036		6.632	6,516
Allergan, Inc. 3,375 % fällig am 15.09.2020		6.550	6,565	2,375 % fällig am 15.01.2020		800	790	5,926 % fällig am 10.01.2034		959	1,034
Alliance Data Systems Corp. 4,500 % fällig am 15.03.2022	€	1.989	2,377	3,000 % fällig am 15.01.2022		50.867	49,517	6,036 % fällig am 10.12.2028		4.286	4,570
ALROSA Finance S.A. 7,750 % fällig am 03.11.2020	\$	1.500	1,614	3,625 % fällig am 15.01.2024		7.425	7,196	6,943 % fällig am 10.01.2030		7.751	8,726
Altice Financing S.A. 5,250 % fällig am 15.02.2023	€	31.040	37,460	3,875 % fällig am 15.01.2027		28.897	27,381	7,507 % fällig am 10.01.2032		8.190	9,616
6,625 % fällig am 15.02.2023		52.854	52,220	Caesars Resort Collection LLC 5,250 % fällig am 15.10.2025		734	696	8,353 % fällig am 10.07.2031		6.342	7,676
7,500 % fällig am 15.05.2026		11.175	10,836	California Institute of Technology 4,283 % fällig am 01.09.2116		9.100	8,885	D.R. Horton, Inc. 4,000 % fällig am 15.02.2020		600	606
Altice France S.A. 5,375 % fällig am 15.05.2022	€	69.670	83,733	Campbell Soup Co. 2,835 % fällig am 16.03.2020		15.170	15,129	DAE Funding LLC 4,000 % fällig am 01.08.2020		18.740	18,576
5,625 % fällig am 15.05.2024		54.980	66,704	2,971 % fällig am 15.03.2021		12.330	12,300	4,500 % fällig am 01.08.2022		16.113	15,670
6,000 % fällig am 15.05.2022		43.900	44,111	3,300 % fällig am 15.03.2021		10.232	10,196	5,000 % fällig am 01.08.2024		18.634	17,945
6,250 % fällig am 15.05.2024		7.500	7,312	3,650 % fällig am 15.03.2023		16.950	16,661	Daimler Finance North America LLC 3,350 % fällig am 04.05.2021		3.800	3,787
7,375 % fällig am 01.05.2026		120.023	117,797	3,950 % fällig am 15.03.2025		13.870	13,393	Danone S.A. 1,691 % fällig am 30.10.2019		4.900	4,818
Altice Luxembourg S.A. 7,250 % fällig am 15.05.2022	€	106.680	125,566	4,150 % fällig am 15.03.2028		16.220	15,475	Davidе Campari-Milano SpA 2,750 % fällig am 30.09.2020	€	800	984
7,750 % fällig am 15.05.2022		69.075	67,089	Central Nippon Expressway Co. Ltd. 2,803 % fällig am 15.02.2022		85.200	84,874	Dell International LLC 3,480 % fällig am 01.06.2019	\$	27.860	27,936
American Airlines Pass-Through Trust 3,350 % fällig am 15.04.2031		4.410	4,262	2,903 % fällig am 04.08.2020		73.050	73,240	4,420 % fällig am 15.06.2021		163.338	165,837
3,575 % fällig am 15.07.2029		1.835	1,786					5,450 % fällig am 15.06.2023		500	524
4,000 % fällig am 15.08.2030		7.111	7,023					Delta Air Lines, Inc. 2,875 % fällig am 13.03.2020		26.510	26,346
								3,625 % fällig am 15.03.2022		33.240	32,893
											0,05



































# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	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>Beschreibung</b>				<b>Beschreibung</b>				<b>Beschreibung</b>				
Qatar Government International Bond				<b>OPTIONSSCHEINE</b>				(12,877)% fällig am 14.09.2018 (f)(g)	ARS	89.964	3,271	0,01
3,875 % fällig am 23.04.2023	\$	41.700	0,06	Sequa Corp. - Exp. 28.04.2024	174.000	\$ 44	0,00	(6,771)% fällig am 14.09.2018 (f)(g)		113.910	4,142	0,01
5,103 % fällig am 23.04.2048		23.000	0,03	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				(5,317)% fällig am 14.09.2018 (f)(g)		50.260	1,827	0,00
<b>Republic of Greece Government International Bond</b>				Sequa Corp.				(3,247)% fällig am 12.10.2018 (f)(g)		122.780	4,342	0,01
3,500 % fällig am 30.01.2023	€	4.304	0,01	9,000 %	3.229	2.906	0,00	(2,723)% fällig am 12.10.2018 (f)(g)		49.390	1,747	0,00
3,750 % fällig am 30.01.2028		4.618	0,01	<b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>				(2,374)% fällig am 12.10.2018 (f)(g)		89.943	3,161	0,01
3,900 % fällig am 30.01.2033		9.948	0,02	<b>PIMCO Fixed Income Source</b>				(0,978)% fällig am 12.10.2018 (f)(g)		467.400	16,530	0,03
4,000 % fällig am 30.01.2037		6.211	0,01	ETFs plc - PIMCO US				(0,500)% fällig am 14.09.2018 (f)(g)		913.400	33,209	0,05
4,200 % fällig am 30.01.2042		3.488	0,01	Dollar Short Maturity				0,576 % fällig am 14.09.2018 (f)(g)		10.600	385	0,00
4,750 % fällig am 17.04.2019		80.088	0,15	Source UCITS ETF (I)	2.903.000	294.538	0,45	0,946 % fällig am 12.10.2018 (f)(g)		250.870	8,872	0,01
<b>Russia Government International Bond</b>				<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>				0,986 % fällig am 13.07.2018 (f)(g)		\$ 1.300	1,299	0,00
3,500 % fällig am 16.01.2019	\$	7.600	0,01	VICI Properties, Inc. (I)	5.793.243	119.573	0,18	1,154 % fällig am 14.09.2018 (f)(g)	ARS	7.100	258	0,00
5,000 % fällig am 29.04.2020		4.300	0,01	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				1,197 % fällig am 10.08.2018 (f)(g)	\$	14.300	14,239	0,02
11,000 % fällig am 24.07.2018		52.979	0,08	<b>COMMERCIAL PAPER</b>				1,298 % fällig am 24.08.2018 (f)(g)		4.200	4,176	0,01
<b>Saudi Government International Bond</b>				Bank of Montreal				1,457 % fällig am 12.10.2018 (f)(g)	ARS	201.100	7,112	0,01
2,375 % fällig am 26.10.2021		26.500	0,04	Bank of Nova Scotia				1,855 % fällig am 14.09.2018 (f)(g)	\$	6.882	6,827	0,01
2,875 % fällig am 04.03.2023		6.400	0,01	1,543 % fällig am 03.07.2018				2,480 % fällig am 12.10.2018 (f)(g)		58.910	58,261	0,09
4,000 % fällig am 17.04.2025		265.300	0,40	McCormick & Co.	84.500	64.226	0,10	2,788 % fällig am 27.07.2018 (f)(g)		96.129	95,858	0,15
4,500 % fällig am 17.04.2030		78.500	0,12	2,800 % fällig am 01.11.2018				3,120 % fällig am 28.09.2018 (f)(g)		89.835	88,975	0,14
4,500 % fällig am 26.10.2046		14.600	0,02	Muss neu klassifiziert werden				3,154 % fällig am 26.10.2018 (f)(g)		3.262	3,220	0,01
4,625 % fällig am 04.10.2047		63.100	0,09	1,910 % fällig am 31.12.2030				3,223 % fällig am 12.10.2018 (f)(g)	ARS	35.300	1,248	0,00
5,000 % fällig am 17.04.2049		119.400	0,18	Spectra Energy Partners				3,586 % fällig am 12.10.2018 (f)(g)		35.300	1,248	0,00
<b>Serbia Government International Bond</b>				2,750 % fällig am 09.07.2018	35.750	35.727	0,05	25,250 % fällig am 14.09.2018 (f)(g)		34.500	1,105	0,00
4,875 % fällig am 25.02.2020		25.142	0,04	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (o)</b>				25,350 % fällig am 14.09.2018 (f)(g)		46.100	1,477	0,00
7,250 % fällig am 28.09.2021		19.231	0,03	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				25,601 % fällig am 14.09.2018 (f)(g)		567.832	18,191	0,03
<b>Turkey Government International Bond</b>				Harris Corp.				25,800 % fällig am 19.09.2018 (f)(g)		90.173	2,868	0,00
5,625 % fällig am 30.03.2021		31.300	0,05	2,794 % fällig am 27.02.2019	42.240	42.274	0,07	39,900 % fällig am 19.09.2018 (f)(g)		479.440	15,247	0,02
7,500 % fällig am 07.11.2019		6.000	0,01	Holmes Master Issuer PLC				40,000 % fällig am 19.09.2018 (f)(g)	1.090.390	34,675	0,05	
<b>Venezuela Government International Bond</b>				2,443 % fällig am 15.01.2019	73.400	73.423	0,11			438.884	0,67	
6,000 % fällig am 09.12.2020 ^		6.175	0,00	Letras del Banco Central de la Republica Argentina				<b>GREECE TREASURY BILLS</b>				
7,000 % fällig am 31.03.2038 ^		12.564	0,01	25,150 % fällig am 17.10.2018				0,603 % fällig am 10.08.2018 (f)(g)	€	54.365	63,430	0,10
7,650 % fällig am 21.04.2025 ^		25.882	0,04	25,700 % fällig am 18.07.2018				0,706 % fällig am 02.11.2018 (f)(g)		53.810	62,635	0,10
7,750 % fällig am 13.10.2019 ^		5.850	0,01	25,800 % fällig am 18.07.2018				0,718 % fällig am 02.11.2018 (f)(g)		130	151	0,00
8,250 % fällig am 13.10.2024 ^		31.931	0,05	33,500 % fällig am 18.07.2018				0,800 % fällig am 13.07.2018 (f)(g)		7.706	8,998	0,01
9,000 % fällig am 07.05.2023 ^		12.716	0,01	37,800 % fällig am 21.11.2018				1,082 % fällig am 05.10.2018 (f)(g)		61.616	71,781	0,11
9,250 % fällig am 15.09.2027 ^		34.493	0,05	40,700 % fällig am 18.07.2018				1,267 % fällig am 15.03.2019 (f)(g)		106.288	123,262	0,19
9,250 % fällig am 07.05.2028 ^		39.477	0,06	<b>Nigeria Open Market Operation Bills</b>						330.257	0,51	
11,750 % fällig am 21.10.2026 ^		3.990	0,01	15,432 % fällig am 25.10.2018				<b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>				
		2.284.643	3,48	15,696 % fällig am 08.11.2018				15,284 % fällig am 04.10.2018 (f)(g)	NGN	384.300	1,036	0,00
				15,703 % fällig am 25.10.2018				15,450 % fällig am 04.10.2018 (f)(g)		1.265.400	3,410	0,01
<b>AKTIEN</b>				15,716 % fällig am 08.11.2018				15,501 % fällig am 29.11.2018 (f)(g)		2.048.200	5,410	0,01
<b>STAMMAKTIE</b>				15,737 % fällig am 08.11.2018				15,504 % fällig am 29.11.2018 (f)(g)		1.288.900	3,405	0,01
<b>LUXUSGÜTER</b>				15,798 % fällig am 08.11.2018								
Caesars Entertainment Corp. (e)	9.573.895	102.441	0,16	15,805 % fällig am 25.10.2018								
<b>ENERGIE</b>				Pepper Residential Securities Trust								
Dommo Energia S.A. (e)(I)	25.087.701	6.910	0,01	2,585 % fällig am 16.03.2019	\$	18.300	0,03					
Dommo Energia S.A. SP - ADR	4.731	175	0,00									
		7.085	0,01	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>								
<b>FINANZWERTE</b>				(14,311)% fällig am 14.09.2018 (f)(g)	ARS	61.400	0,00					
Eurobank Ergasias S.A. (e)	40.899.918	42.518	0,07	(12,971)% fällig am 14.09.2018 (f)(g)		78.707	0,00					
National Bank of Greece S.A. (e)	6.325.150	1.930	0,00									
TIG FinCo PLC (I)	5.234.172	8.292	0,01									
		52.740	0,08									
<b>INDUSTRIEWERTE</b>												
Sierra Hamilton Holder LLC (I)	2.210.032	796	0,00									
<b>VERSORGUNGUNTERNEHMEN</b>												
Eneva S.A. (e)(I)	18.057	56	0,00									
		163.118	0,25									

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKTWERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKTWERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS
15,542 % fällig am 11.10.2018 (f)(g)	NGN	229.600	\$ 617	0,00			
15,609 % fällig am 04.10.2018 (f)(g)		189.200	510	0,00			
15,683 % fällig am 11.10.2018 (f)(g)		450.000	1.209	0,00			
15,699 % fällig am 22.11.2018 (f)(g)		971.000	2.572	0,00			
15,965 % fällig am 04.10.2018 (f)(g)		100.000	269	0,00			
16,147 % fällig am 04.10.2018 (f)(g)		100.000	269	0,00			
			18.707	0,03			
Summe kurzfristige Instrumente		1.131.830	1,73				

## 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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	14.281	\$ 18.424	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	2	3	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	2	10	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	248	(516)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	15.544	17.659	0,02
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 35.580	0,05

## 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>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.06.2022	\$ 16.800	\$ 302	0,00
Ally Financial, Inc.	5,000	20.12.2022	49.115	(826)	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.06.2021	€ 32.000	(374)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2021	\$ 12.800	(46)	0,00
Chesapeake Energy Corp.	5,000	20.09.2018	1.110	(31)	0,00
Chesapeake Energy Corp.	5,000	20.12.2018	1.320	(29)	0,00
Chesapeake Energy Corp.	5,000	20.03.2019	500	(7)	0,00
Deutsche Bank AG	1,000	20.12.2018	€ 27.500	(101)	0,00
Deutsche Bank AG	1,000	20.06.2019	3.000	4	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2022	\$ 10.700	(180)	0,00
Navient Corp.	5,000	20.09.2020	600	(8)	0,00
Navient Corp.	5,000	20.12.2021	5.700	(2)	0,00
Navient Corp.	5,000	20.06.2022	16.200	245	0,00
Navient Corp.	5,000	20.12.2022	17.400	229	0,00
Novo Banco S.A.	5,000	20.12.2021	€ 1.600	361	0,00
Sprint Corp.	5,000	20.12.2021	\$ 2.100	(86)	0,00
				\$ (549)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-30 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2023	\$ 490.550	\$ 1.394	0,00

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.EM-20 5-Year Index	5,000 %	20.12.2018	\$ 26.228	\$ 295	0,00
CDX.EM-21 5-Year Index	5,000	20.06.2019	20.916	338	0,00
CDX.EM-24 5-Year Index	1,000	20.12.2020	10.580	324	0,00
CDX.EM-28 5-Year Index	1,000	20.12.2022	226.582	2.230	0,00
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000	20.06.2023	1.133.800	(22.293)	(0,03)
CDX.HY-21 5-Year Index	5,000	20.12.2018	23.529	(648)	0,00
CDX.HY-24 5-Year Index	5,000	20.06.2020	563.635	(9.663)	(0,01)
CDX.HY-25 5-Year Index	5,000	20.12.2020	722.496	(7.045)	(0,01)
CDX.HY-30 5-Year Index	5,000	20.06.2023	14.675	(125)	0,00
				\$ (36.587)	(0,05)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,970 %	02.01.2025	BRL	761.800	\$ (6.672)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,030	02.01.2025		281.700	(3.456)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,255	02.01.2025		415.200	(5.504)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	14,170	04.01.2021		149.400	316	0,00
Zahlung	3-Month CAD Bank Bill	3,400	20.06.2029	CAD	6.300	(187)	0,00
Erhalt	3-Month CAD Bank Bill	3,500	20.06.2044		4.000	72	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	20.06.2021	\$	796.800	13.705	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	07.12.2022		338.100	(12.145)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2025		3.539.600	(16.628)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,050	11.01.2023		1.739.000	(49.161)	(0,08)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,053	06.12.2022		1.801.000	(60.401)	(0,09)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,120	16.11.2022		504.100	(15.345)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,350	02.02.2023		5.000.000	(78.286)	(0,12)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,350	22.02.2023		3.889.000	(60.719)	(0,09)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,360	22.02.2023		3.838.000	(59.520)	(0,09)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,360	01.03.2023		1.962.000	(30.297)	(0,05)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,490	09.01.2028		1.448.600	(40.434)	(0,06)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048		1.550.300	117.775	0,18
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	19.09.2028	ZAR	1.510.200	(4.591)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,250	15.03.2024		10.200	21	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,300	15.03.2027		187.600	(403)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD	591.700	3.606	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	17.12.2019		12.400	(97)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027		1.880.290	7.692	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024		197.200	(274)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025		361.600	(1.024)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	15.03.2023		388.900	(2.739)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.06.2022		188.400	(2.636)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	11.12.2023		82.800	(977)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024		97.200	(1.025)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	18.06.2024		124.400	(1.964)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	€	907.700	(20.946)	(0,03)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.12.2028		244.000	(3.039)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	17.09.2024		149.000	(1.484)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	£	837.512	(11.556)	(0,02)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,000	20.09.2026	¥	32.150.000	(1.549)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.03.2026		18.230.000	(482)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028		89.350.000	(8.146)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	21.03.2028		26.590.000	(3.081)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,301	13.02.2028		10.140.000	(992)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,351	08.02.2028		7.300.000	(588)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,354	18.01.2028		25.650.000	(2.314)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,354	16.02.2028		12.850.000	(1.068)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,380	18.06.2028		17.780.000	(1.781)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,399	18.06.2028		4.540.000	(454)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,400	27.03.2029		12.800.000	(643)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,415	25.03.2029		5.890.000	(295)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,446	18.06.2029		12.360.000	(1.229)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029		1.153.127.000	(54.892)	(0,08)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	29.03.2029		12.820.000	(641)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,471	18.06.2029		12.360.000	(1.233)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,095	05.02.2021	MXN	1.357.900	(669)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,145	02.04.2020		82.200	(13)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,270	05.02.2020		180.900	(24)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,430	17.11.2021		413.600	(366)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,610	07.07.2021		423.400	(403)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,615	21.05.2021		719.400	(638)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,680	28.05.2021		303.800	(277)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,780	29.09.2022		579.430	(761)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,795	02.06.2023		245.200	(352)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,798	06.09.2021		1.768.100	(1.914)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,810	02.05.2022		189.300	(243)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,850	02.05.2022		607.900	(795)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,900	20.07.2021		1.652.600	(1.796)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,950	30.01.2026		752.200	(1.378)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,980	26.08.2024		87.900	(149)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,990	30.01.2026		816.500	(1.518)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,000	18.07.2022		1.700.000	(2.349)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	10.03.2026		1.660.900	(3.286)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,350	01.09.2023		351.400	(628)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,490	08.09.2026		1.322.100	(3.058)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,620	18.02.2030		94.500	(267)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,710	20.09.2029		87.500	(251)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,750	31.08.2021		714.400	(1.157)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,150	11.06.2027		2.193.600	(5.570)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,165	06.09.2032		266.600	(1.244)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,199	03.12.2021		194.600	(376)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,200	11.06.2027		1.587.300	(5.064)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,350	17.11.2021		198.300	(400)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,360	21.08.2037		285.500	(877)	0,00

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,370 %	11.10.2027	MXN 1.861.100	\$ (4.080)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,380	04.11.2026	36.300	(108)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,380	14.08.2037	111.200	93	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,388	17.11.2021	154.800	(316)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,480	18.06.2037	337.300	(1.421)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,498	19.06.2037	810.000	(3.363)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,520	18.04.2023	1.819.700	(1.360)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,530	18.04.2023	2.360.500	(1.714)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,530	21.04.2023	257.700	(188)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,538	23.02.2022	698.000	(1.529)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,545	18.04.2023	2.167.800	(1.522)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,603	14.04.2025	1.995.300	(1.656)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	23.01.2023	4.957.600	(1.434)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	15.04.2025	288.800	(242)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,640	03.01.2023	214.500	(104)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,645	03.01.2023	466.500	(222)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,670	05.03.2025	5.616.000	(3.456)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,700	02.05.2023	713.700	(113)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,710	26.02.2025	1.873.400	(1.207)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,710	07.03.2025	347.300	(190)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,715	07.03.2025	345.200	(185)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,745	05.01.2023	313.500	(87)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,800	28.12.2027	273.800	212	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,805	06.02.2023	760.000	(120)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,818	17.02.2027	816.800	(2.733)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,820	06.02.2023	870.300	67	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,865	27.12.2022	536.600	(19)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,865	02.02.2027	1.026.600	(3.466)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,875	16.12.2022	306.800	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,880	27.12.2022	7.579.800	(3.535)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,910	30.12.2027	967.500	377	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,984	10.12.2027	32.700	4	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,990	21.12.2027	14.700	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,005	21.12.2027	3.730.800	2.281	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,010	04.02.2027	448.800	(1.561)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,030	31.01.2028	450.400	(19)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,050	31.01.2028	679.600	121	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,090	15.01.2027	1.435.600	(5.062)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,103	04.01.2038	3.750.800	365	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,120	15.01.2027	293.600	(1.042)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,280	28.11.2036	690.000	(3.478)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,310	28.11.2036	1.066.400	(5.490)	(0,01)
					<b>\$ (511.041)</b>	<b>(0,78)</b>
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (546.783)</b>	<b>(0,83)</b>

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

#### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,700 %	18.07.2018	\$ 181.600	\$ (200)	\$ (104)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	831.800	(1.081)	(278)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.07.2018	1.849.500	(2.034)	(487)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	103,000	19.09.2018	169.500	(763)	(979)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	101,000	21.11.2018	581.700	(7.058)	(4.501)	(0,01)
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	117.800	(112)	(39)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	120.000	(206)	(16)	0,00
CBK	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	101,000	17.10.2018	150.800	(783)	(820)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	792.000	(950)	(264)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	200.500	(206)	(42)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	89.800	(128)	(99)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.07.2018	\$ 401.100	\$ (511)	\$ (134)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	147.900	(246)	(20)	0,00
GST	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	102,000	19.09.2018	166.900	(1.707)	(768)	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	172.900	(160)	(71)	0,00
MYC	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	104,500	19.09.2018	33.800	(238)	(306)	0,00
						\$ (16.383)	\$ (8.928)	(0,01)

### DEVIENOPTIOENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens	
BPS	Call - OTC USD versus TRY	TRY 5,150	20.05.2019	\$ 15.400	\$ (1.092)	\$ (1.057)	(0,01)	
	Put - OTC USD versus TRY	5,150	20.05.2019	15.400	(1.037)	(803)	0,00	
SOG	Call - OTC USD versus TRY	5,150	20.05.2019	4.800	(341)	(330)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	5,150	20.05.2019	4.800	(323)	(250)	0,00	
UBS	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,287	20.09.2018	£ 84.800	(714)	(600)	0,00	
						\$ (3.507)	\$ (3.040)	(0,01)

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens	
FAR	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4.000 % fällig am 01.08.2048	\$ 101,977	06.08.2018	\$ 195.200	\$ (488)	\$ (476)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4.000 % fällig am 01.08.2048	102,898	06.08.2018	194.500	(486)	(206)	0,00	
FBF	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4.000 % fällig am 01.07.2048	101,039	05.07.2018	468.500	(1.931)	(4.357)	(0,01)	
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4.000 % fällig am 01.08.2048	101,438	06.08.2018	225.900	(671)	(381)	0,00	
GSC	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4.000 % fällig am 01.08.2048	102,438	06.08.2018	225.900	(565)	(219)	0,00	
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2048	98,359	06.08.2018	223.400	(733)	(196)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2048	99,359	06.08.2018	223.400	(698)	(938)	(0,01)	
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2048	101,031	05.07.2018	291.500	(786)	(1)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2048	102,031	05.07.2018	291.500	(683)	(259)	0,00	
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	101,453	06.08.2018	233.500	(702)	(404)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	101,984	06.08.2018	195.200	(488)	(469)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	102,453	06.08.2018	233.500	(584)	(219)	0,00	
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	97,773	05.07.2018	209.000	(555)	0	0,00	
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	97,813	05.07.2018	241.800	(567)	0	0,00	
JPM	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	97,898	05.07.2018	428.000	(1.103)	0	0,00	
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	98,531	05.07.2018	455.000	(1.315)	(2)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	99,438	05.07.2018	166.000	(402)	(320)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	99,813	05.07.2018	241.800	(472)	(104)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	100,031	05.07.2018	193.400	(295)	(26)	0,00	
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2048	101,094	05.07.2018	250.000	(586)	(1)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2048	102,094	05.07.2018	250.000	(469)	(163)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	102,289	06.08.2018	444.800	(1.112)	(593)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	102,648	06.08.2018	222.300	(573)	(134)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.09.2048	101,703	06.09.2018	184.000	(532)	(826)	0,00	
						\$ (16.796)	\$ (10.294)	(0,02)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	UBS AG	(1,000) %	20.06.2024	\$ 19.300	\$ 1.254	\$ (1.218)	\$ 36	0,00
BPS	UBS AG	(1,000)	20.06.2024	7.000	458	(445)	13	0,00
					\$ 1.712	\$ (1.663)	\$ 49	0,00

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2022	\$ 22.300	\$ (732)	\$ (616)	\$ (1.348)	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	9.500	33	(79)	(46)	0,00	
	Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.	1,000	20.06.2020	100	(15)	15	0	0,00	
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2019	3.200	(108)	131	23	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2022	29.250	(466)	408	(58)	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.03.2019	4.300	(227)	236	9	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2020	2.220	(177)	178	1	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	2.400	(93)	83	(10)	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2024	6.800	(648)	427	(221)	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	2.700	(274)	177	(97)	0,00	
	BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.03.2019	1.900	(61)	60	(1)	0,00
		Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	22.900	(1.062)	(7)	(1.069)	0,00
		Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2019	3.900	(248)	229	(19)	0,00
Petrobras Global Finance BV		1,000	20.12.2019	6.950	(675)	592	(83)	0,00	
Petrobras Global Finance BV		1,000	20.03.2020	1.300	(216)	196	(20)	0,00	
Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2021	1.000	(280)	239	(41)	0,00		

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender		Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/	Nicht realisierte	Marktwert	% des	
		Festzinssatz	Fälligkeitsdatum		(erhaltene)	Wertzunahme/			
					Abschlussprämien	(-abnahme)		Nettvermögens	
BRC	Petrobras Global Finance BV	1,000 %	20.12.2021	\$ 400	\$ (61)	\$ 38	\$ (23)	0,00	
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	31.500	(1.413)	275	(1.138)	0,00	
	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.12.2022	15.100	1.701	(1.344)	357	0,00	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	57.900	(2.291)	(1.208)	(3.499)	(0,01)	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.03.2019	2.100	(12)	22	10	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	2.000	7	(17)	(10)	0,00	
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2023	20.700	(283)	(51)	(334)	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	37.500	(382)	(181)	(563)	0,00	
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	4.500	29	46	75	0,00	
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2019	19.400	(2.492)	2.260	(232)	0,00	
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2019	2.600	(163)	150	(13)	0,00	
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2021	5.800	(1.670)	1.431	(239)	0,00	
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.12.2021	3.000	(272)	193	(79)	0,00	
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2022	47.000	237	(22)	215	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.03.2019	600	(35)	36	1	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2019	2.600	(161)	167	6	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	74.450	(2.101)	1.779	(322)	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2020	10.400	(839)	844	5	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	22.400	(429)	134	(295)	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2024	6.300	(742)	537	(205)	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	4.100	(414)	267	(147)	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	20.400	(1.297)	998	(299)	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.100	(289)	196	(93)	0,00	
Springleaf Finance Corp.	5,000	20.09.2021	2.200	165	69	234	0,00		
Springleaf Finance Corp.	5,000	20.12.2022	4.500	510	(49)	461	0,00		
CBK	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.06.2022	18.000	1.153	(602)	551	0,00	
	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.12.2022	15.800	1.606	(1.232)	374	0,00	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	50.505	(1.969)	(1.083)	(3.052)	(0,01)	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	36.000	(381)	205	(176)	0,00	
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2019	2.100	(92)	104	12	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	53.850	(527)	(281)	(808)	0,00	
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2019	1.500	(164)	146	(18)	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2018	10.000	(307)	325	18	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.03.2019	8.078	(448)	465	17	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2019	14.900	(923)	956	33	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2020	14.080	(1.101)	1.108	7	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2024	5.700	(618)	432	(186)	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	6.400	(555)	325	(230)	0,00	
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2022	22.500	52	203	255	0,00	
	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	1,000	20.12.2021	€ 5.600	(209)	148	(61)	0,00	
	DUB	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.12.2022	\$ 24.900	2.639	(2.050)	589	0,00
		Brazil Government International Bond	1,000	20.09.2018	1.600	(68)	69	1	0,00
		Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	80.000	(2.892)	(1.942)	(4.834)	(0,01)
		Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	3.000	3	15	18	0,00
		Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	42.400	133	(340)	(207)	0,00
Indonesia Government International Bond		1,000	20.06.2019	1.200	(31)	40	9	0,00	
Peru Government International Bond		1,000	20.06.2022	22.500	208	66	274	0,00	
Petroleos Mexicanos		1,000	20.12.2021	900	(85)	61	(24)	0,00	
Petroleos Mexicanos		1,000	20.06.2022	13.500	(624)	136	(488)	0,00	
South Africa Government International Bond		1,000	20.12.2021	5.200	(361)	243	(118)	0,00	
FBF	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.12.2022	3.700	429	(341)	88	0,00	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	7.000	(270)	(153)	(423)	0,00	
GST	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	8.500	44	98	142	0,00	
	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.06.2022	18.000	1.153	(602)	551	0,00	
	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.12.2022	26.100	2.943	(2.326)	617	0,00	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.09.2018	9.200	(392)	398	6	0,00	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.03.2019	5.700	(193)	190	(3)	0,00	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	6.300	(258)	(123)	(381)	0,00	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	225.500	(10.949)	(5.628)	(16.577)	(0,03)	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.03.2019	2.100	(12)	22	10	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	31.000	(338)	187	(151)	0,00	
	Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.	1,000	20.06.2020	600	(91)	89	(2)	0,00	
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2023	38.000	(503)	(109)	(612)	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	311.200	(2.888)	(1.782)	(4.670)	(0,01)	
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2019	4.850	(521)	463	(58)	0,00	
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.03.2020	200	(30)	27	(3)	0,00	
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.09.2020	1.980	(288)	239	(49)	0,00	
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2021	10.013	(2.794)	2.381	(413)	0,00	
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2021	7.300	(1.251)	837	(414)	0,00	
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2022	16.500	(1.498)	322	(1.176)	0,00	
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2022	7.800	(443)	(255)	(698)	0,00	
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.12.2021	500	(46)	33	(13)	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2018	6.000	(246)	253	7	0,00	
Russia Government International Bond	1,000	20.03.2019	6.300	(214)	227	13	0,00		
Russia Government International Bond	1,000	20.06.2019	6.300	(390)	404	14	0,00		
Russia Government International Bond	1,000	20.03.2020	500	(93)	94	1	0,00		

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender			Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte		% des
		Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>		Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	
	Russia Government International Bond	1,000 %	20.06.2020	\$ 500	\$ (68)	\$ 69	\$ 1	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2020	2.700	(205)	206	1	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	387.450	(8.475)	3.378	(5.097)	(0,01)
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.500	(170)	121	(49)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	4.200	(268)	207	(61)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	19.700	(1.379)	934	(445)	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.12.2019	400	33	(7)	26	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.06.2022	12.700	1.119	249	1.368	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.12.2022	2.600	229	37	266	0,00
HUS	Argentine Republic Government International Bond	1,000	20.12.2018	13.100	139	24	163	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.09.2018	1.200	(51)	52	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	0	0	0	0	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	338.900	(21.474)	(3.439)	(24.913)	(0,04)
	Colombia Government International Bond	1,000	20.03.2019	2.100	(10)	20	10	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	44.700	159	(377)	(218)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2019	4.200	(172)	195	23	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2019	1.600	(49)	61	12	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2023	23.600	(312)	(68)	(380)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	537.250	(4.731)	(3.330)	(8.061)	(0,01)
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	5.000	30	54	84	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2019	14.060	(1.411)	1.243	(168)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.03.2020	2.600	(444)	404	(40)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.09.2020	1.120	(159)	131	(28)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2021	1.100	(315)	270	(45)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2022	10.000	(568)	(326)	(894)	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.12.2021	2.000	(183)	130	(53)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2018	9.000	(368)	378	10	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.03.2019	6.300	(266)	279	13	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2019	3.640	(148)	156	8	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2020	10.120	(782)	787	5	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	26.900	(122)	(232)	(354)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.640	(375)	256	(119)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	2.459	(336)	248	(88)	0,00
JPM	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	8.300	(514)	392	(122)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.03.2019	2.100	(9)	19	10	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2019	2.100	(92)	104	12	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2019	3.200	(110)	133	23	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2019	2.940	(272)	237	(35)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2021	2.300	(373)	243	(130)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2022	9.000	(703)	62	(641)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.03.2019	3.900	(118)	126	8	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2019	3.000	(218)	225	7	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2020	2.000	(222)	225	3	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2020	12.300	(976)	982	6	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	7.800	(304)	270	(34)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.700	(156)	101	(55)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.800	(339)	230	(109)	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.06.2022	3.130	279	58	337	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.12.2022	2.500	232	24	256	0,00
MYC	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.06.2022	9.000	592	(316)	276	0,00
	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.12.2022	32.300	3.653	(2.889)	764	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	19.000	(704)	(444)	(1.148)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2022	7.100	(84)	90	6	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	9.500	39	(85)	(46)	0,00
	Novo Banco S.A.	5,000	20.12.2021	€ 100	(28)	23	(5)	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	\$ 4.500	19	56	75	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2019	10.700	(990)	862	(128)	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2022	7.000	33	(1)	32	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2020	1.200	(149)	150	1	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	106.400	(391)	(1.009)	(1.400)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2023	54.900	(1.097)	75	(1.022)	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2022	67.700	156	612	768	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	2.100	(148)	101	(47)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2022	29.900	(627)	(591)	(1.218)	0,00
NGF	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2022	32.200	78	287	365	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	1.400	(86)	65	(21)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	10.100	(724)	496	(228)	0,00
UAG	Park Aerospace Holdings Ltd.	5,000	01.07.2020	11.600	679	(225)	454	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	200	(15)	10	(5)	0,00
					\$ (87.467)	\$ 4.109	\$ (83.358)	(0,13)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender			Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte		% des
		Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>		Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	
BOA	ABX.HE.AA.6-1 Index	0,320 %	25.07.2045	\$ 2.211	\$ (763)	\$ 631	\$ (132)	0,00
	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	83.253	(17.866)	11.354	(6.512)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	16.358	(375)	483	108	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	2.000	(5)	33	28	0,00

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110 %	25.05.2046	\$ 7.495	\$ (1.614)	\$ 1.028	\$ (586)	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	12.318	(438)	519	81	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	13.800	(464)	656	192	0,00
	Mexico Government International Bond	0,500	20.12.2022	5.875	15	(66)	(51)	0,00
CBK	PRIMEX.ARM.2-AAA SP BRC	4,580	25.12.2037	672	29	(20)	9	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	24.636	(884)	1.046	162	0,00
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	233.645	(4.705)	3.670	(1.035)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	645.100	(3.371)	(2.619)	(5.990)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	40.403	(1.295)	1.561	266	0,00
	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17.01.2047	6.800	(211)	250	39	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	6.800	(304)	325	21	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	88.800	(1.103)	1.071	(32)	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	360.700	(7.722)	6.123	(1.599)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	688.600	(4.427)	(1.967)	(6.394)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	92.139	(3.081)	3.688	607	0,00
	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17.01.2047	82.300	(2.842)	3.315	473	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	8.600	(467)	494	27	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	271.500	(12.648)	12.550	(98)	0,00
	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	2.035	(410)	251	(159)	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.180.550	(15.247)	10.015	(5.232)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	17.11.2059	33.000	(1.212)	1.066	(146)	0,00
JPS	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	18.11.2054	216.000	(1.013)	(993)	(2.006)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	11.05.2063	209.358	1.325	53	1.378	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.01.2047	4.200	(201)	225	24	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.10.2057	17.250	(904)	958	54	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.09.2058	370.575	(11.177)	11.043	(134)	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	17.11.2059	171.400	(2.957)	2.197	(760)	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	18.11.2054	171.700	(1.351)	(243)	(1.594)	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.10.2057	19.300	(858)	919	61	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	17.09.2058	59.800	(2.768)	2.746	(22)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	11.05.2063	10.150	(93)	160	67	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.10.2057	22.700	(1.248)	1.319	71	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.09.2058	25.000	(1.348)	1.339	(9)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	17.11.2059	66.700	(1.419)	1.123	(296)	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	18.11.2054	189.500	(1.129)	(631)	(1.760)	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	18.11.2054	175.300	(1.963)	335	(1.628)	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	11.05.2063	27.100	(984)	1.162	178	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.01.2047	6.800	(211)	250	39	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.09.2058	212.700	(11.339)	11.262	(77)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	1.200	(37)	54	17	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.192.695	(15.923)	10.637	(5.286)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	17.11.2059	9.400	(269)	227	(42)	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	18.11.2054	152.400	(785)	(630)	(1.415)	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	11.05.2063	321.650	2.066	50	2.116	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.10.2057	8.600	(471)	498	27	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.09.2058	673.100	(849)	606	(243)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	17.11.2059	15.500	(445)	376	(69)	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	27.100	(958)	1.136	178	0,00
					\$ (138.719)	\$ 101.635	\$(37.084)	(0,06)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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
GLM	Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,250 %	06.09.2019	MXN 165.000	\$ (23)	\$ (273)	\$ (296)	0,00

#### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

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 High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR	129.600	20.09.2018	\$ (661)	\$ (211)	\$ (872)	0,00
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR	41.600	20.09.2018	(201)	52	(149)	0,00
FBF	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR	23.000	20.09.2018	(113)	(4)	(117)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR	86.800	20.09.2018	\$ (446)	\$ (115)	\$ (561)	0,00
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	80.300	20.09.2018	(49)	962	913	0,00
JPM	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR	137.400	20.09.2018	(664)	145	(519)	0,00
							\$ (2.134)	\$ 829	\$ (1.305)	0,00

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07/2018	AUD 2.204.578	\$ 1.659.192	\$ 30.340	\$ 0	\$ 30.340	0,05
	07/2018	£ 220.000	292.884	2.429	0	2.429	0,00
	07/2018	\$ 20.393	AUD 26.878	0	(534)	(534)	0,00
BOA	07/2018	ARS 165.821	\$ 6.067	320	0	320	0,00
	07/2018	BRL 325.000	97.647	13.175	0	13.175	0,02
	07/2018	DKK 325.115	50.130	0	(816)	(816)	0,00
	07/2018	€ 3.207.125	3.764.670	20.190	0	20.190	0,03
	07/2018	£ 1.320.838	1.763.616	19.779	0	19.779	0,03
	07/2018	HKD 6.366	811	0	0	0	0,00
	07/2018	¥ 45.399.626	417.500	7.627	0	7.627	0,01
	07/2018	NZD 115.547	80.835	2.604	0	2.604	0,00
	07/2018	\$ 6.004	ARS 165.821	0	(311)	(311)	0,00
	07/2018	252.441	AUD 341.505	0	(120)	(120)	0,00
	07/2018	85.956	BRL 325.000	0	(1.483)	(1.483)	0,00
	07/2018	17.385	¥ 1.900.400	0	(228)	(228)	0,00
	08/2018	ARS 183.820	\$ 8.532	2.427	0	2.427	0,00
	08/2018	AUD 341.505	252.465	117	0	117	0,00
	08/2018	BRL 325.000	85.711	1.538	0	1.538	0,00
	08/2018	€ 300.381	SEK 3.118.787	0	(2.075)	(2.075)	0,00
	08/2018	\$ 444.561	MXN 9.065.787	12.748	(27)	12.721	0,02
	08/2018	593	ZAR 7.455	0	(52)	(52)	0,00
	08/2018	ZAR 37.573	\$ 2.845	116	0	116	0,00
	09/2018	ARS 90.173	4.096	1.187	0	1.187	0,00
	09/2018	\$ 54.313	RUB 3.398.809	0	(508)	(508)	0,00
	09/2018	2.323	SGD 3.084	0	(57)	(57)	0,00
BPS	07/2018	ARS 1.030.654	\$ 41.257	5.532	0	5.532	0,01
	07/2018	DKK 204.629	30.780	0	(1.285)	(1.285)	0,00
	07/2018	€ 5.443	6.299	0	(56)	(56)	0,00
	07/2018	PEN 400.000	122.065	2	(8)	(6)	0,00
	07/2018	\$ 60.170	ARS 1.616.208	0	(4.576)	(4.576)	(0,01)
	07/2018	5.938	¥ 650.700	0	(64)	(64)	0,00
	08/2018	105.130	MXN 2.000.000	0	(4.250)	(4.250)	(0,01)
	09/2018	16.175	AUD 21.022	0	(640)	(640)	0,00
	09/2018	1.303	HKD 10.200	0	(1)	(1)	0,00
	05/2019	2.309	TRY 11.912	0	(38)	(38)	0,00
BRC	07/2018	£ 453.222	\$ 603.221	4.883	(29)	4.854	0,01
	07/2018	\$ 1.587	£ 1.201	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	225.257	MXN 4.519.998	2.734	0	2.734	0,00
	09/2018	AUD 23.230	\$ 18.086	918	0	918	0,00
	09/2018	\$ 16.175	AUD 21.022	0	(640)	(640)	0,00
CBK	07/2018	ARS 35.327	\$ 1.634	409	0	409	0,00
	07/2018	CAD 255.018	195.888	2.024	0	2.024	0,00
	07/2018	DKK 1.356.626	225.621	13.386	(352)	13.034	0,02
	07/2018	€ 1.800.466	2.098.851	3	(3.287)	(3.284)	(0,01)
	07/2018	£ 399	529	2	0	2	0,00
	07/2018	¥ 56.674.626	522.488	10.822	0	10.822	0,02
	07/2018	PEN 322.469	98.720	310	0	310	0,00
	07/2018	\$ 278	ARS 7.265	0	(31)	(31)	0,00
	07/2018	2.422	DKK 15.735	44	0	44	0,00
	07/2018	1.520	€ 1.315	16	0	16	0,00
	07/2018	72.349	£ 54.375	0	(561)	(561)	0,00
	07/2018	2.531	MXN 51.178	64	0	64	0,00
	07/2018	13.009	RUB 848.137	507	0	507	0,00
	07/2018	317.939	TRY 1.340.127	0	(27.621)	(27.621)	(0,04)
	08/2018	ARS 3.741	\$ 173	49	0	49	0,00
	08/2018	MXN 1.069.349	53.689	0	(249)	(249)	0,00
	08/2018	\$ 14.344	ARS 296.203	0	(4.606)	(4.606)	(0,01)
	08/2018	470.915	¥ 51.315.626	0	(6.300)	(6.300)	(0,01)
	08/2018	269.871	MXN 5.323.565	1.459	(2.807)	(1.348)	0,00
	08/2018	127.082	RUB 7.946.516	0	(1.038)	(1.038)	0,00
	08/2018	76.665	TRY 337.025	0	(4.444)	(4.444)	(0,01)
	09/2018	SGD 1.139	\$ 838	1	0	1	0,00
	10/2018	\$ 5.737	ARS 172.250	0	(303)	(303)	0,00
	11/2018	NGN 396.624	\$ 1.047	0	(33)	(33)	0,00
DUB	07/2018	\$ 51.087	ARS 1.420.373	0	(1.854)	(1.854)	0,00
	07/2018	76.025	PEN 249.856	225	0	225	0,00
FBF	07/2018	ARS 3.166	\$ 114	4	0	4	0,00
	07/2018	PEN 191.576	58.418	0	(47)	(47)	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
	07/2018	\$ 113	ARS 3.166	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	07/2018	14.075	AUD 18.836	0	(158)	(158)	0,00
GLM	07/2018	ARS 384.848	\$ 14.175	836	0	836	0,00
	07/2018	CHF 27.140	27.426	93	0	93	0,00
	07/2018	€ 10.075	11.822	67	(8)	59	0,00
	07/2018	£ 553.160	736.346	6.036	0	6.036	0,01
	07/2018	\$ 14.033	ARS 384.848	0	(834)	(834)	0,00
	07/2018	1.077.641	AUD 1.467.055	6.299	(7)	6.292	0,01
	07/2018	80.461	€ 68.192	15	(858)	(843)	0,00
	07/2018	43.427	£ 32.591	1	(400)	(399)	0,00
	07/2018	3.801	¥ 416.100	0	(45)	(45)	0,00
	07/2018	32.676	RUB 2.037.896	0	(199)	(199)	0,00
	08/2018	AUD 1.448.134	\$ 1.063.763	0	(6.301)	(6.301)	(0,01)
	08/2018	\$ 5.541	MXN 110.481	32	0	32	0,00
	08/2018	138.615	RUB 8.734.679	0	(70)	(70)	0,00
	08/2018	207.859	TRY 902.267	0	(14.515)	(14.515)	(0,02)
	09/2018	SGD 12	\$ 9	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 407	CNH 2.602	0	(15)	(15)	0,00
HUS	10/2018	DKK 126.797	\$ 19.560	0	(453)	(453)	0,00
	07/2018	ARS 44.860	2.110	579	0	579	0,00
	07/2018	AUD 1.369	1.009	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	CHF 56	56	0	0	0	0,00
	07/2018	€ 1.060	1.234	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	£ 805	1.056	0	(7)	(7)	0,00
	07/2018	HKD 13.201	1.682	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	SGD 4.971	3.643	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	\$ 881	ARS 22.854	0	(93)	(93)	0,00
	07/2018	140.976	CAD 187.568	1.613	0	1.613	0,00
	07/2018	283.203	DKK 1.812.785	865	0	865	0,00
	07/2018	28.507	€ 24.607	222	0	222	0,00
	07/2018	4.886	£ 3.693	1	(11)	(10)	0,00
	07/2018	171.833	RUB 10.983.728	3.210	0	3.210	0,00
	08/2018	ARS 45.570	\$ 2.112	598	0	598	0,00
	08/2018	CAD 187.568	141.054	0	(1.606)	(1.606)	0,00
	08/2018	\$ 17.193	ARS 355.726	0	(5.498)	(5.498)	(0,01)
	08/2018	7.582	MXN 154.897	231	0	231	0,00
	08/2018	1.836	RUB 114.767	0	(16)	(16)	0,00
	08/2018	80.546	TRY 349.293	0	(5.698)	(5.698)	(0,01)
	08/2018	618	ZAR 7.862	0	(47)	(47)	0,00
	08/2018	ZAR 38.074	\$ 2.941	175	0	175	0,00
	09/2018	IDR 15.205.672	1.059	9	0	9	0,00
	09/2018	SGD 313	230	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 40.945	RUB 2.567.303	0	(304)	(304)	0,00
	09/2018	931	SGD 1.245	0	(16)	(16)	0,00
	10/2018	DKK 1.812.785	\$ 285.283	0	(814)	(814)	0,00
IND	10/2018	\$ 808	ARS 24.400	0	(38)	(38)	0,00
	07/2018	£ 200.000	\$ 266.294	2.244	0	2.244	0,00
JPM	09/2018	SGD 1.285	956	12	0	12	0,00
	07/2018	ARS 138.123	6.389	1.601	0	1.601	0,00
	07/2018	DKK 226.183	34.905	0	(538)	(538)	0,00
	07/2018	€ 24.778	28.902	0	(27)	(27)	0,00
	07/2018	£ 400.000	532.567	4.467	0	4.467	0,01
	07/2018	PEN 117.462	35.838	0	(9)	(9)	0,00
	07/2018	\$ 52.929	AUD 70.401	50	(963)	(913)	0,00
	07/2018	27.391	CHF 27.140	0	(58)	(58)	0,00
	07/2018	12.740	DKK 82.060	119	0	119	0,00
	07/2018	34.614	€ 29.547	49	(165)	(116)	0,00
	07/2018	78.844	£ 59.769	193	(127)	66	0,00
	07/2018	2.738	MXN 55.356	69	0	69	0,00
	08/2018	CHF 27.140	\$ 27.460	59	0	59	0,00
	08/2018	\$ 4.590	MXN 92.631	82	0	82	0,00
	08/2018	238.845	TRY 996.678	0	(25.270)	(25.270)	(0,04)
	08/2018	3.953	ZAR 50.452	0	(289)	(289)	0,00
	09/2018	9.888	ARS 210.125	0	(3.149)	(3.149)	0,00
	09/2018	11.905	RUB 745.323	0	(106)	(106)	0,00
	10/2018	NGN 2.470.158	\$ 6.575	0	(169)	(169)	0,00
MSB	11/2018	5.412.379	14.389	0	(310)	(310)	0,00
	07/2018	ARS 14.348	508	19	0	19	0,00
	07/2018	\$ 7.450	AUD 9.864	0	(162)	(162)	0,00
	07/2018	74.688	€ 64.693	843	0	843	0,00
	07/2018	3.373.669	¥ 372.246.812	0	(12.979)	(12.979)	(0,02)
	08/2018	€ 335	\$ 387	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	¥ 363.812.312	3.303.646	12.563	0	12.563	0,02
	08/2018	\$ 2.927	ARS 60.685	0	(924)	(924)	0,00
	09/2018	AUD 23.234	\$ 18.069	898	0	898	0,00
	09/2018	HKD 386	49	0	0	0	0,00
	10/2018	NGN 360.521	961	0	(25)	(25)	0,00
NGF	07/2018	ARS 6.702	236	7	0	7	0,00
RBC	07/2018	\$ 16.389	AUD 21.466	0	(529)	(529)	0,00
	08/2018	110.130	TRY 505.706	0	(1.991)	(1.991)	0,00
RYL	07/2018	HKD 7.170	\$ 914	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 3.551	HKD 27.800	0	(3)	(3)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
SCX	07/2018	£ 20.795	\$ 27.644	\$ 190	\$ 0	\$ 190	0,00
	07/2018	NZD 660.552	\$ 459.024	11.797	0	11.797	0,02
	07/2018	\$ 60.460	CAD 77.514	0	(1.534)	(1.534)	0,00
	07/2018	20.917	DKK 134.295	128	0	128	0,00
	07/2018	16.439	£ 12.409	20	(76)	(56)	0,00
	07/2018	6.294	¥ 684.300	0	(116)	(116)	0,00
	07/2018	43.434	PEN 143.158	255	0	255	0,00
	07/2018	61.643	RUB 4.000.000	2.103	0	2.103	0,00
	07/2018	224.233	TRY 947.368	0	(19.000)	(19.000)	(0,03)
	08/2018	SEK 233.155	\$ 26.207	61	0	61	0,00
	10/2018	NGN 981.233	\$ 2.609	0	(70)	(70)	0,00
	11/2018	482.805	\$ 1.282	0	(32)	(32)	0,00
SOG	07/2018	\$ 15.087	TRY 69.608	0	(7)	(7)	0,00
	08/2018	2.810	ARS 58.315	0	(885)	(885)	0,00
	09/2018	4.608	HKD 36.094	0	(1)	(1)	0,00
	05/2019	289	TRY 1.489	0	(5)	(5)	0,00
SSB	07/2018	CAD 97.438	\$ 75.450	1.378	0	1.378	0,00
	07/2018	DKK 893.620	\$ 149.597	9.564	0	9.564	0,01
	07/2018	¥ 273.824.060	2.523.217	51.100	0	51.100	0,08
	07/2018	\$ 2.219	CAD 2.874	0	(34)	(34)	0,00
	07/2018	139.339	£ 103.973	0	(2.069)	(2.069)	0,00
TOR	10/2018	304	DKK 1.961	6	0	6	0,00
UAG	07/2018	14.366	AUD 18.884	0	(414)	(414)	0,00
	07/2018	17.085	DKK 102.940	0	(954)	(954)	0,00
	07/2018	383.357	NZD 566.617	271	0	271	0,00
	08/2018	NZD 566.617	\$ 383.361	0	(272)	(272)	0,00
	08/2018	\$ 332.027	MXN 6.679.442	5.146	(259)	4.887	0,01
	08/2018	79.885	RUB 5.022.033	119	(347)	(228)	0,00
	08/2018	81.036	TRY 374.693	0	(912)	(912)	0,00
	09/2018	£ 18.656	\$ 24.682	0	(39)	(39)	0,00
	09/2018	\$ 263.458	INR 18.048.179	0	(2.692)	(2.692)	0,00
	09/2018	124.185	RUB 7.772.500	0	(1.143)	(1.143)	0,00
				\$ 284.286	\$ (188.014)	\$ 96.272	0,15

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional AUD (Hedged) Class, Investor AUD (Hedged) Class, Administrative AUD (Hedged) Class, Class E AUD (Hedged) und Class Z AUD (Hedged) 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	07/2018	\$ 220.159	AUD 292.527	\$ 0	\$ (4.026)	\$ (4.026)	(0,01)
BOA	07/2018	AUD 294.114	\$ 217.115	0	(191)	(191)	0,00
	08/2018	\$ 217.136	AUD 294.114	193	0	193	0,00
BRC	07/2018	673	887	0	(18)	(18)	0,00
GLM	07/2018	AUD 295.203	\$ 216.826	0	(1.284)	(1.284)	0,00
	07/2018	\$ 221.994	AUD 295.321	0	(3.796)	(3.796)	(0,01)
	08/2018	216.848	295.203	1.284	0	1.284	0,01
HUS	07/2018	AUD 3.940	\$ 2.941	30	0	30	0,00
	07/2018	\$ 4.120	AUD 5.459	5	(91)	(86)	0,00
JPM	07/2018	AUD 491	\$ 373	10	0	10	0,00
	07/2018	\$ 220.267	AUD 290.491	0	(5.638)	(5.638)	(0,01)
RBC	07/2018	AUD 242	\$ 183	3	0	3	0,00
	07/2018	\$ 1.306	AUD 1.778	7	0	7	0,00
RYL	07/2018	AUD 6.042	\$ 4.625	161	0	161	0,00
	07/2018	\$ 1.624	AUD 2.137	0	(46)	(46)	0,00
SCX	07/2018	2.704	3.653	1	(6)	(5)	0,00
SSB	07/2018	667	896	0	(5)	(5)	0,00
TOR	07/2018	AUD 1.665	\$ 1.262	32	0	32	0,00
	07/2018	\$ 403	AUD 543	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 1.726	\$ (15.103)	\$ (13.377)	(0,02)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional BRL (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 252.087	BRL 924.439	\$ 0	\$ (11.810)	\$ (11.810)	(0,02)
BPS	07/2018	BRL 1.221.646	\$ 327.790	10.265	0	10.265	0,02
	08/2018	\$ 326.773	BRL 1.221.646	0	(10.375)	(10.375)	(0,02)
BSS	07/2018	BRL 504.665	\$ 135.444	4.274	0	4.274	0,01
	07/2018	\$ 259.238	BRL 972.816	0	(6.388)	(6.388)	(0,01)
	08/2018	135.009	504.665	0	(4.304)	(4.304)	(0,01)
CBK	07/2018	BRL 511.956	\$ 136.227	3.161	0	3.161	0,00
	08/2018	\$ 135.769	BRL 511.956	0	(3.175)	(3.175)	0,00
DUB	07/2018	BRL 716.383	\$ 189.963	3.763	0	3.763	0,01
	07/2018	\$ 334.155	BRL 1.243.875	0	(10.852)	(10.852)	(0,02)
	09/2018	124.773	476.807	0	(1.703)	(1.703)	0,00
	10/2018	63.882	239.576	0	(2.180)	(2.180)	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
FBF	07/2018	BRL 463.917	\$ 124.308	\$ 3.729	\$ 0	\$ 3.729	0,01
	07/2018	\$ 18.007	BRL 67.274	0	(521)	(521)	0,00
GLM	08/2018	123.939	463.917	0	(3.788)	(3.788)	(0,01)
	07/2018	BRL 59.457	\$ 15.960	506	0	506	0,00
HUS	07/2018	\$ 133.203	BRL 499.917	0	(3.267)	(3.267)	(0,01)
	08/2018	12.740	48.327	0	(224)	(224)	0,00
JPM	07/2018	BRL 463.917	\$ 124.175	3.595	0	3.595	0,01
	07/2018	\$ 141.741	BRL 527.815	0	(4.553)	(4.553)	(0,01)
MSB	08/2018	123.810	463.917	0	(3.659)	(3.659)	(0,01)
	07/2018	BRL 1.053.374	\$ 279.661	6.601	(729)	5.872	0,01
SCX	07/2018	\$ 252.612	BRL 925.772	0	(11.989)	(11.989)	(0,02)
	08/2018	BRL 190.071	\$ 49.235	8	0	8	0,00
UAG	08/2018	\$ 62.621	BRL 234.949	0	(1.771)	(1.771)	0,00
	07/2018	BRL 1.673.605	\$ 447.230	12.233	0	12.233	0,02
UAG	07/2018	\$ 192.484	BRL 705.512	0	(9.110)	(9.110)	(0,01)
	08/2018	377.618	1.421.859	0	(9.366)	(9.366)	(0,01)
UAG	07/2018	218.588	801.498	0	(10.266)	(10.266)	(0,02)
				\$ 48.135	\$ (110.030)	\$ (61.895)	(0,09)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CAD (Hedged) Class 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
CBK	07/2018	\$ 41.374	CAD 53.863	\$ 0	\$ (427)	\$ (427)	0,00
HUS	07/2018	CAD 53.562	\$ 40.257	0	(461)	(461)	0,00
	07/2018	\$ 41.622	CAD 54.054	0	(530)	(530)	0,00
NAB	08/2018	40.279	53.562	459	0	459	0,00
	07/2018	CAD 53.562	\$ 40.269	0	(448)	(448)	0,00
RBC	08/2018	\$ 40.291	CAD 53.562	447	0	447	0,00
	07/2018	CAD 462	\$ 352	3	(2)	1	0,00
SCX	07/2018	\$ 42.055	CAD 53.926	0	(1.061)	(1.061)	0,00
SSB	07/2018	CAD 1.375	\$ 1.056	11	0	11	0,00
UAG	07/2018	52.884	39.803	0	(399)	(399)	0,00
	08/2018	\$ 39.824	CAD 52.884	397	0	397	0,00
				\$ 1.317	\$ (3.328)	\$ (2.011)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CHF (Hedged) Class und Class E CHF (Hedged) 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	07/2018	CHF 2.100	\$ 2.132	\$ 17	\$ 0	\$ 17	0,00
BPS	07/2018	\$ 182.785	CHF 180.011	0	(1.496)	(1.496)	(0,01)
	07/2018	CHF 3.973	\$ 3.993	0	(8)	(8)	0,00
BRC	07/2018	\$ 827	CHF 814	1	(8)	(7)	0,00
	07/2018	CHF 993	\$ 1.009	9	0	9	0,00
CBK	07/2018	\$ 115	CHF 112	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	182.666	180.423	0	(962)	(962)	0,00
GLM	07/2018	CHF 180.365	\$ 180.706	0	(940)	(940)	0,00
	07/2018	\$ 182.401	CHF 180.499	3	(623)	(620)	0,00
JPM	08/2018	181.164	180.365	935	0	935	0,00
	07/2018	CHF 179.486	\$ 181.143	383	0	383	0,00
RBC	07/2018	\$ 755	CHF 743	0	(6)	(6)	0,00
	08/2018	181.602	179.486	0	(390)	(390)	0,00
SSB	07/2018	300	295	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	CHF 710	\$ 720	6	(1)	5	0,00
UAG	07/2018	\$ 223	CHF 222	0	0	0	0,00
				\$ 1.354	\$ (4.439)	\$ (3.085)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Investor CNH (Hedged) Class und Class E CNH (Hedged) 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	09/2018	\$ 4.593	CNH 29.462	\$ 0	\$ (160)	\$ (160)	0,00
BPS	09/2018	CNH 571	\$ 88	3	0	3	0,00
GLM	09/2018	\$ 11.001	CNH 70.331	0	(419)	(419)	0,00
HUS	09/2018	3.834	24.412	0	(161)	(161)	0,00
JPM	09/2018	CNH 493	\$ 77	2	0	2	0,00
NGF	09/2018	\$ 13.239	CNH 84.529	0	(520)	(520)	0,00
RYL	09/2018	1.574	10.034	0	(64)	(64)	0,00
SCX	09/2018	62	400	0	(2)	(2)	0,00
UAG	09/2018	463	2.970	0	(16)	(16)	0,00
				\$ 5	\$ (1.342)	\$ (1.337)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class H Institutional EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) 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	07/2018	€ 3.922.460	\$ 4.530.441	\$ 0	\$ (49.229)	\$ (49.229)	(0,08)
	08/2018	\$ 4.540.428	€ 3.922.460	49.183	0	49.183	0,07
BPS	07/2018	€ 2.975.229	\$ 2.563.067	17.282	0	17.282	0,03
	07/2018	€ 10.469	\$ 12.200	48	(71)	(23)	0,00
CBK	07/2018	€ 2.775.855	\$ 3.215.920	2.088	(27.119)	(25.031)	(0,04)
	07/2018	\$ 2.925.868	€ 2.509.913	4.582	0	4.582	0,01
GLM	08/2018	€ 2.842.692	\$ 2.451.537	25.815	0	25.815	0,04
	07/2018	€ 54.769	\$ 64.154	381	(173)	208	0,00
HUS	07/2018	\$ 56.194	€ 48.118	0	(13)	(13)	0,00
	07/2018	€ 4.899.056	\$ 5.658.410	0	(61.486)	(61.486)	(0,09)
JPM	08/2018	\$ 5.670.902	€ 4.899.056	61.409	0	61.409	0,09
	07/2018	€ 3.130.981	\$ 3.642.410	0	(13.169)	(13.169)	(0,02)
MSB	07/2018	\$ 585.534	€ 501.983	556	0	556	0,00
	08/2018	\$ 3.650.548	€ 3.130.981	12.965	0	12.965	0,02
RBC	07/2018	€ 9.745.634	\$ 8.335.076	4.484	(18.495)	(14.011)	(0,02)
	07/2018	€ 14.467	\$ 16.762	0	(129)	(129)	0,00
RYL	07/2018	\$ 24.512	€ 21.045	59	0	59	0,00
	07/2018	€ 392.011	\$ 457.406	970	(1.257)	(287)	0,00
SCX	07/2018	\$ 359.473	€ 306.443	0	(1.685)	(1.685)	0,00
	07/2018	€ 334.795	\$ 392.556	1.884	(217)	1.667	0,00
SSB	07/2018	\$ 366.605	€ 313.322	0	(786)	(786)	0,00
	07/2018	1.625.214	1.398.245	7.308	0	7.308	0,01
TOR	07/2018	2.902.707	2.504.817	21.793	0	21.793	0,03
	07/2018	€ 1.664.665	\$ 1.932.926	0	(10.655)	(10.655)	(0,02)
UAG	07/2018	\$ 7.934.735	€ 6.850.594	63.680	0	63.680	0,10
	08/2018	1.937.246	1.664.665	10.554	0	10.554	0,02
				\$ 285.041	\$ (184.484)	\$ 100.557	0,15

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Administrative GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged) und Class R GBP (Hedged) 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	07/2018	£ 2.023	\$ 2.716	\$ 45	\$ 0	\$ 45	0,00
BOA	07/2018	\$ 272.263	£ 203.908	0	(3.054)	(3.054)	(0,01)
	07/2018	£ 2.475	\$ 3.281	16	(3)	13	0,00
BRC	07/2018	224.275	293.274	0	(2.824)	(2.824)	0,00
	07/2018	\$ 10.606	£ 7.961	0	(95)	(95)	0,00
CBK	08/2018	293.683	224.275	2.817	0	2.817	0,00
	07/2018	£ 4.676	\$ 6.232	60	0	60	0,00
GLM	07/2018	\$ 256.484	£ 193.579	0	(912)	(912)	0,00
	07/2018	74.639	55.879	2	(866)	(864)	0,00
RYL	07/2018	3.608	2.731	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	271.144	203.962	0	(1.863)	(1.863)	0,00
SSB	07/2018	£ 792	\$ 1.041	2	(8)	(6)	0,00
	07/2018	\$ 8.553	£ 6.414	0	(85)	(85)	0,00
UAG	07/2018	£ 222.826	\$ 294.632	446	0	446	0,00
	08/2018	\$ 295.049	£ 222.826	0	(464)	(464)	0,00
				\$ 3.388	\$ (10.176)	\$ (6.788)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutionell JPY (Hedged) Class und Class E JPY (Hedged) 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	07/2018	\$ 6.125	¥ 665.813	\$ 0	\$ (114)	\$ (114)	0,00
CBK	07/2018	¥ 666.892	\$ 6.048	27	0	27	0,00
	07/2018	\$ 64	¥ 7.008	0	(1)	(1)	0,00
MSB	08/2018	6.060	666.892	0	(27)	(27)	0,00
	07/2018	¥ 664.171	\$ 6.019	23	0	23	0,00
SCX	07/2018	\$ 6.049	¥ 656.260	0	(124)	(124)	0,00
	08/2018	6.031	664.171	0	(23)	(23)	0,00
SSB	07/2018	¥ 665.369	\$ 6.037	30	0	30	0,00
	08/2018	\$ 6.029	¥ 663.179	0	(30)	(30)	0,00
07/2018	6.149	667.352	0	(125)	(125)	0,00	
				\$ 80	\$ (444)	\$ (364)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional NOK (Hedged) Class 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	07/2018	NOK 384.659	\$ 46.871	\$ 0	\$ (324)	\$ (324)	0,00
	07/2018	\$ 46.684	NOK 380.507	2	0	2	0,00
	08/2018	46.922	384.613	324	0	324	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
BRC	07/2018	\$ 28	\$ 227	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	07/2018	165	1.340	0	0	0	0,00
DUB	07/2018	25	205	0	0	0	0,00
GLM	07/2018	NOK 156	\$ 19	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 31	NOK 251	0	0	0	0,00
HUS	07/2018	NOK 1.142	\$ 140	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 46.950	NOK 384.415	216	(1)	215	0,00
SCX	07/2018	NOK 383.337	\$ 47.012	0	(21)	(21)	0,00
	07/2018	\$ 46.646	NOK 384.016	470	0	470	0,00
	08/2018	47.069	383.337	20	0	20	0,00
SSB	07/2018	NOK 9.406	\$ 1.156	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 1.416	NOK 11.559	2	0	2	0,00
				\$ 1.035	\$ (346)	\$ 689	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional SGD (Hedged) Class, Investor SGD (Hedged) Class, Administrative SGD (Hedged) Class und Class E SGD (Hedged) 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	09/2018	SGD 11.830	\$ 8.838	149	0	149	0,00
BOA	09/2018	\$ 1.228.868	SGD 1.631.814	0	(30.092)	(30.092)	(0,04)
CBK	09/2018	SGD 16.082	\$ 11.960	146	0	146	0,00
	09/2018	\$ 244.343	SGD 327.151	0	(4.009)	(4.009)	(0,01)
GLM	09/2018	SGD 3.105	\$ 2.336	55	0	55	0,00
	09/2018	\$ 3.820	SGD 5.119	0	(59)	(59)	0,00
HUS	09/2018	SGD 4.769	\$ 3.581	78	0	78	0,00
IND	09/2018	14.278	10.621	132	0	132	0,00
JPM	09/2018	27.684	20.546	209	0	209	0,00
NGF	09/2018	\$ 414.997	SGD 554.737	0	(7.472)	(7.472)	(0,01)
RYL	09/2018	SGD 4.216	\$ 3.110	13	0	13	0,00
	09/2018	\$ 2.505	SGD 3.339	0	(52)	(52)	0,00
SCX	09/2018	352.583	472.697	0	(5.327)	(5.327)	(0,01)
SSB	09/2018	SGD 30.071	\$ 22.510	418	0	418	0,00
	09/2018	\$ 2.574	SGD 3.512	7	0	7	0,00
UAG	09/2018	SGD 3.996	\$ 2.998	63	0	63	0,00
	09/2018	\$ 317.785	SGD 423.862	0	(6.404)	(6.404)	(0,01)
				\$ 1.270	\$ (53.415)	\$ (52.145)	(0,08)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ (87.740)</b>	<b>(0,14)</b>

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVERMOGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHORDEN</b>			
Freddie Mac, TBA			
3,500 % fallig am 01.07.2048	\$ 22.000	\$ (21.886)	(0,03)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (21.886)</b>	<b>(0,03)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 75.206.484</b>	<b>114,64</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (9.605.923)</b>	<b>(14,64)</b>
<b>Nettovermogen</b>		<b>\$ 65.600.561</b>	<b>100,00</b>

## ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Reines Kapitalwertpapier.

(c) Wertpapier per Emissionstermin.

(d) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.

(e) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.

(f) Nullkuponwertpapier.

(g) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.

(h) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(i) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.

(j) Mit dem Fonds verbunden.

(k) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Siehe Erlauterungen

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

### (l) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Carrington Mortgage Loan Trust 1,000 % fällig am 21.12.2059	16.05.2018	\$ 313.285	\$ 310.186	0,47
Carrington Mortgage Loan Trust 5,260 % fällig am 21.12.2059	16.05.2018	15.684	15.529	0,02
Dommo Energia S.A	21.12.2017 - 26.12.2017	655	6.910	0,01
Eneva S.A.	21.12.2017	78	56	0,00
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 4,150 % fällig am 06.03.2019	16.01.2018	28.730	28.603	0,04
Sierra Hamilton Holder LLC	31.07.2017	560	796	0,00
TIG FinCo PLC	06.04.2015 - 20.07.2017	7.122	8.292	0,01
VICI Properties, Inc.	07.05.2014 - 06.11.2017	80.161	119.573	0,18
		<b>\$ 446.275</b>	<b>\$ 489.945</b>	<b>0,73</b>

(m) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 5.072.021 als Sicherheiten verpfändet.

(n) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 199.214 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 1.088.276 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 432.450 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

### (o) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
NOM	1,950 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 8.000	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044	\$ (8.147)	\$ 8.000	\$ 8.000	0,01
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	38.170	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	(38.935)	38.170	38.170	0,06
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (47.082)</b>	<b>\$ 46.170</b>	<b>\$ 46.170</b>	<b>0,07</b>

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 516.776	\$ 73.725.122	\$ 1.585.415
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	35.580	(634.986)	463	(598.943)
Leerverkäufe	0	(21.886)	0	(21.886)
<b>Summen</b>	<b>\$ 552.356</b>	<b>\$ 73.068.250</b>	<b>\$ 1.585.878</b>	<b>\$ 75.206.484</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 700.119	\$ 72.387.055	\$ 444.321
Einlagen bei Kreditinstituten	0	250.483	0	250.483
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(6.381)	54.289	732	48.640
Leerverkäufe	0	(4.400)	0	(4.400)
<b>Summen</b>	<b>\$ 693.738</b>	<b>\$ 72.687.427</b>	<b>\$ 445.053</b>	<b>\$ 73.826.218</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 der Wertpapieranlagen.

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

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BCY	1,850 %	18.06.2018	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (7.283)	\$ (7.288)	(0,01)
				(38.697)	(38.739)	(0,06)
BOM	2,160	19.06.2018	12.07.2018	(3.080)	(3.082)	(0,01)
BOS	(1,000)	07.02.2018	TBD <sup>(1)</sup>	(2.777)	(2.766)	0,00
				(48.250)	(48.391)	(0,07)
				(47.563)	(47.662)	(0,07)
				(120.983)	(121.272)	(0,19)
				(1.167)	(1.167)	0,00

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten	
					aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
	2,110 %	13.06.2018	13.07.2018	\$ (103.275)	\$ (103.384)	(0,16)
	2,170	29.06.2018	12.07.2018	(1.167)	(1.167)	0,00
	2,180	18.06.2018	18.07.2018	(5.214)	(5.218)	(0,01)
	2,180	20.06.2018	05.07.2018	(24.750)	(24.767)	(0,04)
	2,250	18.06.2018	18.07.2018	(158.038)	(158.166)	(0,24)
CIB	2,110	23.05.2018	23.07.2018	(17.191)	(17.230)	(0,03)
	2,200	18.06.2018	12.07.2018	(350.057)	(350.335)	(0,53)
GRE	1,920	17.04.2018	17.07.2018	(209.355)	(210.192)	(0,32)
	1,990	27.04.2018	27.07.2018	(286.500)	(287.529)	(0,44)
	2,040	19.06.2018	17.07.2018	(15.015)	(15.025)	(0,02)
	2,050	19.06.2018	16.07.2018	(66.028)	(66.073)	(0,10)
	2,060	19.06.2018	17.07.2018	(22.523)	(22.538)	(0,04)
JPS	1,970	20.04.2018	20.07.2018	(585.750)	(588.058)	(0,90)
	1,990	25.04.2018	25.07.2018	(211.781)	(212.566)	(0,32)
RBC	2,000	23.04.2018	23.07.2018	(258.953)	(259.946)	(0,40)
RCY	2,000	14.05.2018	23.07.2018	(289.125)	(289.896)	(0,44)
	2,000	18.05.2018	06.07.2018	(99.750)	(99.994)	(0,15)
	2,080	17.05.2018	17.07.2018	(388.500)	(389.510)	(0,59)
	2,110	17.05.2018	17.07.2018	(236.191)	(236.814)	(0,36)
	2,110	07.06.2018	17.07.2018	(60.352)	(60.437)	(0,09)
	2,130	29.05.2018	30.07.2018	(58.198)	(58.312)	(0,09)
	2,160	21.06.2018	23.07.2018	(354.384)	(354.597)	(0,54)
	2,180	18.06.2018	18.07.2018	(482.500)	(482.880)	(0,74)
	2,350	29.06.2018	05.07.2018	(64.200)	(64.208)	(0,10)
SCX	2,170	14.06.2018	14.08.2018	(316.381)	(316.706)	(0,48)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (4.945.915)</b>	<b>(7,54)</b>

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

#### Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkaufgeschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	2,500 %	28.06.2018	05.07.2018	\$ (4.855)	\$ (4.856)	(0,01)
GSC	2,000	14.06.2018	13.07.2018	(178.773)	(178.942)	(0,27)
	2,100	29.06.2018	13.07.2018	(13.408)	(13.410)	(0,02)
<b>Summe Rückkaufgeschäfte</b>					<b>\$ (197.208)</b>	<b>(0,30)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 130 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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 28.403	\$ (35.660)	\$ (7.257)
BOA	19.440	(62.790)	(43.350)
BPS	1.880	20.070	21.950
BRC	2.392	(4.300)	(1.908)
BSS	(6.418)	6.020	(398)
CBK	(27.616)	36.250	8.634
DUB	(24.266)	2.520	(21.746)
FAR	(682)	610	(72)
FBF	(13.036)	13.020	(16)
GLM	(19.120)	17.620	(1.500)
GSC	(2.486)	2.630	144
GST	(34.628)	34.300	(328)
HUS	(46.958)	49.700	2.742
IND	2.388	(4.470)	(2.082)
JPM	(38.381)	42.480	4.099
JPS	(2.315)	2.320	5
MEI	129	(260)	(131)
MSB	(20.149)	100.060	79.911
MYC	(6.925)	3.823	(3.102)
NAB	(1)	0	(1)
NGF	(7.869)	9.150	1.281
RBC	(2.582)	3.090	508
RYL	(1.965)	62	(1.903)
SAL	(7.012)	7.420	408
SCX	(23.448)	27.600	4.152
SOG	(1.478)	1.480	2
SSB	67.470	(47.460)	20.010
TOR	21.829	1.310	23.139
UAG	56.264	27.660	83.924
UBS	(600)	0	(600)

<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 der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

---

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	62,39	51,27
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	31,93	40,22
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	21,27	10,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,05	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,83)	(0,03)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,14)	0,11
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,03)	(0,01)
Einlagezertifikate	0,00	0,35
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(7,54)	(0,33)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,30)	(0,01)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Income Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		
	1.253.616.482	\$ 12.551.334		1.253.820.843	\$ 12.553.500
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 01.05.2018	¥ 324.160.000	2.976.674	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.10.2024	\$ 801.400	784.769
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	202.990.000	1.896.502	United States Treasury Note/Bond 2,250 % fällig am 31.12.2024	596.100	585.605
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	104.645.000	986.491	United States Treasury Note/Bond 2,750 % fällig am 15.11.2047	430.900	400.121
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.05.2018	101.771.800	940.228	Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.02.2048	399.866	396.367
Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.09.2047	\$ 612.293	615.845	United States Treasury Note/Bond 2,500 % fällig am 31.01.2025	366.100	359.978
United States Treasury Note/Bond 2,250 % fällig am 31.12.2024	596.100	586.246	Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.11.2047	354.778	351.784
UK Treasury Bill 0,000 % fällig am 20.04.2018	£ 415.357	579.734	Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.09.2047	347.392	344.461
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 3,762 % fällig am 25.06.2048	\$ 531.122	543.781	United States Treasury Note/Bond 2,750 % fällig am 28.02.2025	332.900	332.484
QNB Finance Ltd 3,705 % fällig am 12.02.2020	518.200	518.200	U.S. Treasury Bonds 2,750 % fällig am 15.08.2047	291.740	280.167
United States Treasury Note/Bond 2,750 % fällig am 15.11.2047	434.730	413.202	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.06.2024	284.600	273.660
Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.02.2048	401.937	402.819	Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.12.2047	267.667	268.169
QNB Finance Ltd 3,713 % fällig am 07.02.2020	371.400	371.400	Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.01.2048	255.373	254.204
Saudi Government International Bond 4,000 % fällig am 17.04.2025	365.300	361.914	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.07.2024	200.400	193.024
United States Treasury Note/Bond 2,500 % fällig am 31.01.2025	366.100	361.291	Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.12.2047	139.477	138.590
Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.11.2047	356.631	356.809	Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.03.2048	135.964	134.732
Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.01.2048	354.807	354.659	BXP Mortgage Trust 0,000 % fällig am 13.06.2039	102.500	105.502
United States Treasury Note/Bond 2,750 % fällig am 28.02.2025	332.900	331.236	Motel 6 Trust 2,993 % fällig am 15.08.2034	104.204	104.204
Carrington Mortgage Loan Trust 1,000 % fällig am 21.12.2059	€ 265.800	313.285	Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.11.2047	98.369	97.539
Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.12.2047	\$ 269.754	272.269	Saudi Government International Bond 4,000 % fällig am 17.04.2025	97.600	96.249

(a) Der Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Strategy 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 UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>VORSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>AT&amp;T, Inc.</b>				<b>2,236 % fällig am 25.09.2036</b>			
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				<b>2,975 % fällig am 01.06.2021</b>				<b>\$ 271 \$ 262 0,29</b>			
<b>AerCap Ireland Capital DAC</b>				<b>5,150 % fällig am 15.02.2050</b>				<b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust</b>			
<b>4,625 % fällig am 30.10.2020</b>				<b>5,200 % fällig am 15.03.2020</b>				<b>2,621 % fällig am 25.02.2036</b>			
<b>\$ 200 \$ 204 0,23</b>				<b>200 206 0,23</b>				<b>3,763 % fällig am 25.06.2035</b>			
<b>American Honda Finance Corp.</b>				<b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b>				<b>29 29 0,03</b>			
<b>2,713 % fällig am 05.11.2021</b>				<b>2,636 % fällig am 03.09.2019</b>				<b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b>			
<b>20 20 0,02</b>				<b>160 160 0,18</b>				<b>2,401 % fällig am 25.07.2036</b>			
<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b>				<b>Petrobras Global Finance BV</b>				<b>2,871 % fällig am 25.09.2035</b>			
<b>6,750 % fällig am 18.02.2020 (e)(g)</b>				<b>5,299 % fällig am 27.01.2025</b>				<b>2,961 % fällig am 25.09.2035</b>			
<b>€ 200 243 0,27</b>				<b>106 98 0,11</b>				<b>Home Equity Asset Trust</b>			
<b>Bank of America Corp.</b>				<b>5,999 % fällig am 27.01.2028</b>				<b>2,946 % fällig am 25.08.2034</b>			
<b>4,600 % fällig am 21.10.2025</b>				<b>7,250 % fällig am 17.03.2044</b>				<b>34 33 0,04</b>			
<b>MXN 5.000 326 0,36</b>				<b>Sempra Energy</b>				<b>HSI Asset Securitization Corp. Trust</b>			
<b>5,875 % fällig am 15.03.2028 (e)</b>				<b>2,791 % fällig am 15.03.2021</b>				<b>2,251 % fällig am 25.05.2037</b>			
<b>\$ 60 59 0,07</b>				<b>100 100 0,11</b>				<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>			
<b>Barclays PLC</b>				<b>Verizon Communications, Inc.</b>				<b>2,751 % fällig am 25.01.2035</b>			
<b>8,250 % fällig am 15.12.2018 (e)(g)</b>				<b>3,376 % fällig am 15.02.2025</b>				<b>134 132 0,15</b>			
<b>200 203 0,23</b>				<b>259 248 0,27</b>				<b>Navigent Student Loan Trust</b>			
<b>BRFKredit A/S</b>				<b>Summe Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>3,241 % fällig am 25.02.066</b>			
<b>2,500 % fällig am 01.10.2047</b>				<b>9,105 10,09</b>				<b>81 83 0,09</b>			
<b>DKK 9 1 0,00</b>				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>			
<b>Deutsche Bank AG</b>				<b>Fannie Mae, TBA</b>				<b>3,171 % fällig am 25.03.2035</b>			
<b>4,250 % fällig am 14.10.2021</b>				<b>3,500 % fällig am 01.07.2048</b>				<b>700 705 0,78</b>			
<b>\$ 150 148 0,16</b>				<b>18.800 18.699 20,72</b>				<b>Residential Asset Securities Corp. Trust</b>			
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>				<b>4,000 % fällig am 01.08.2048</b>				<b>2,421 % fällig am 25.04.2036</b>			
<b>2,876 % fällig am 31.10.2022</b>				<b>7,400 7,534 8,35</b>				<b>100 99 0,11</b>			
<b>100 98 0,11</b>				<b>26,233 29,07</b>				<b>Structured Asset Investment Loan Trust</b>			
<b>2,876 % fällig am 31.10.2022</b>				<b>US-SCHATZOBLIGATIONEN</b>				<b>2,311 % fällig am 25.12.2035</b>			
<b>200 203 0,22</b>				<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)</b>				<b>718 716 0,79</b>			
<b>ING Bank NV</b>				<b>0,125 % fällig am 15.04.2019</b>				<b>VOLT LLC</b>			
<b>2,625 % fällig am 05.12.2022</b>				<b>0,125 % fällig am 15.04.2020</b>				<b>3,125 % fällig am 25.09.2047</b>			
<b>100 98 0,11</b>				<b>0,125 % fällig am 15.04.2022</b>				<b>4,375 % fällig am 27.11.2045</b>			
<b>International Lease Finance Corp.</b>				<b>0,125 % fällig am 15.07.2024</b>				<b>17 17 0,02</b>			
<b>6,250 % fällig am 15.05.2019</b>				<b>0,125 % fällig am 15.07.2026</b>				<b>4,417 4,89</b>			
<b>100 102 0,11</b>				<b>2,331 2,234 2,48</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>			
<b>Lincoln Finance Ltd.</b>				<b>3,358 3,267 3,62</b>				<b>Argentina Government International Bond</b>			
<b>6,875 % fällig am 15.04.2021</b>				<b>421 414 0,46</b>				<b>6,875 % fällig am 26.01.2027</b>			
<b>€ 200 242 0,27</b>				<b>633 615 0,68</b>				<b>200 177 0,20</b>			
<b>Lloyds Banking Group PLC</b>				<b>2,736 2,678 2,97</b>				<b>34,188 % fällig am 03.04.2022</b>			
<b>7,000 % fällig am 27.06.2019 (e)(g)</b>				<b>103 104 0,11</b>				<b>ARS 298 9 0,01</b>			
<b>£ 400 539 0,60</b>				<b>504 503 0,56</b>				<b>40,000 % fällig am 21.06.2020</b>			
<b>Nationwide Building Society</b>				<b>1,722 1,720 1,91</b>				<b>Australia Government International Bond</b>			
<b>10,250 % (e)</b>				<b>2,214 2,203 2,44</b>				<b>0,750 % fällig am 21.11.2027 (d)</b>			
<b>4 741 0,82</b>				<b>2,150 2,153 2,39</b>				<b>AUD 611 454 0,50</b>			
<b>Navient Corp.</b>				<b>1,094 1,132 1,25</b>				<b>1,250 % fällig am 21.02.2022 (d)</b>			
<b>4,875 % fällig am 17.06.2019</b>				<b>3,331 3,386 3,75</b>				<b>3,000 % fällig am 20.09.2025 (d)</b>			
<b>\$ 100 101 0,11</b>				<b>808 884 0,98</b>				<b>756 576 0,64</b>			
<b>5,500 % fällig am 15.01.2019</b>				<b>2,298 2,519 2,79</b>				<b>1,033 891 0,99</b>			
<b>100 101 0,11</b>				<b>3,894 4,319 4,79</b>				<b>Bonos de la Tesorería de la República</b>			
<b>Nordea Kredit Realkreditaktieselskab</b>				<b>746 877 0,97</b>				<b>1,500 % fällig am 01.03.2026</b>			
<b>2,500 % fällig am 01.10.2047</b>				<b>436 583 0,65</b>				<b>CLP 13,583 21 0,02</b>			
<b>DKK 4 1 0,00</b>				<b>133 175 0,19</b>				<b>Canadian Government Real Return Bond</b>			
<b>Nykredit Realkredit A/S</b>				<b>31,813 35,26</b>				<b>0,500 % fällig am 01.12.2050 (d)</b>			
<b>2,500 % fällig am 01.10.2047</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>CAD 205 162 0,18</b>			
<b>27 4 0,00</b>				<b>Banc of America Funding Trust</b>				<b>1,250 % fällig am 01.12.2047 (d)</b>			
<b>Realkredit Danmark A/S</b>				<b>6,000 % fällig am 25.03.2034</b>				<b>4,250 % fällig am 01.12.2021 (d)</b>			
<b>17 3 0,00</b>				<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>				<b>Colombian TES</b>			
<b>Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.</b>				<b>3,480 % fällig am 20.04.2035</b>				<b>3,500 % fällig am 10.03.2021</b>			
<b>€ 420 497 0,55</b>				<b>Grecale RMBS SRL</b>				<b>COP 518,137 183 0,20</b>			
<b>Toronto-Dominion Bank</b>				<b>0,172 % fällig am 27.01.2061</b>				<b>Cyprus Government International Bond</b>			
<b>2,250 % fällig am 15.03.2021</b>				<b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>				<b>€ 30 37 0,04</b>			
<b>\$ 200 196 0,22</b>				<b>2,684 % fällig am 20.06.2035</b>				<b>7,750 % fällig am 27.06.2024</b>			
<b>UBS Group Funding Switzerland AG</b>				<b>JPMorgan Mortgage Trust</b>				<b>80 103 0,12</b>			
<b>4,128 % fällig am 14.04.2021</b>				<b>3,814 % fällig am 25.06.2035</b>				<b>60 77 0,09</b>			
<b>800 826 0,92</b>				<b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>				<b>103 103 0,10</b>			
<b>4,956 5,49</b>				<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>				<b>70 93 0,10</b>			
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>2,421 % fällig am 25.01.2045</b>				<b>Denmark Government International Bond</b>			
<b>Altice Luxembourg S.A.</b>				<b>3,364 % fällig am 25.09.2033</b>				<b>0,100 % fällig am 15.11.2023 (d)</b>			
<b>7,250 % fällig am 15.05.2022</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>DKK 3,083 524 0,58</b>			
<b>€ 400 471 0,52</b>				<b>Asset-Backed Funding Certificates Trust</b>				<b>France Government International Bond</b>			
<b>BAT Capital Corp.</b>				<b>2,691 % fällig am 25.10.2034</b>				<b>€ 601 741 0,82</b>			
<b>2,945 % fällig am 14.08.2020</b>				<b>Bayview Opportunity Master Fund Trust</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2021 (d)</b>			
<b>\$ 100 100 0,11</b>				<b>3,721 % fällig am 28.02.2033</b>				<b>1,027 1,308 1,45</b>			
<b>BAT International Finance PLC</b>				<b>CIT Mortgage Loan Trust</b>				<b>0,100 % fällig am 01.03.2025 (d)</b>			
<b>2,750 % fällig am 15.06.2020</b>				<b>3,441 % fällig am 25.10.2037</b>				<b>0,100 % fällig am 01.03.2028 (d)</b>			
<b>400 396 0,44</b>				<b>152 153 0,17</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>Central Nippon Expressway Co. Ltd.</b>				<b>100 99 0,11</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>2,903 % fällig am 04.08.2020</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>200 201 0,22</b>				<b>Asset-Backed Funding Certificates Trust</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>Deil International LLC</b>				<b>2,691 % fällig am 25.10.2034</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>3,480 % fällig am 01.06.2019</b>				<b>Bayview Opportunity Master Fund Trust</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>400 401 0,45</b>				<b>3,721 % fällig am 28.02.2033</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>Dominion Energy Gas Holdings LLC</b>				<b>100 100 0,11</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>2,926 % fällig am 15.06.2021</b>				<b>100 99 0,11</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>100 100 0,11</b>				<b>2,666 2,96</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>eBay, Inc.</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>2,750 % fällig am 30.01.2023</b>				<b>Asset-Backed Funding Certificates Trust</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>100 96 0,11</b>				<b>2,691 % fällig am 25.10.2034</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>Enbridge, Inc.</b>				<b>Bayview Opportunity Master Fund Trust</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>2,737 % fällig am 10.01.2020</b>				<b>3,721 % fällig am 28.02.2033</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>200 200 0,22</b>				<b>100 99 0,11</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>Mitsubishi Corp.</b>				<b>2,666 2,96</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>2,625 % fällig am 14.07.2022</b>				<b>2,691 % fällig am 25.10.2034</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>300 291 0,32</b>				<b>Bayview Opportunity Master Fund Trust</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>Time Warner Cable LLC</b>				<b>3,721 % fällig am 28.02.2033</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>8,250 % fällig am 01.04.2019</b>				<b>100 99 0,11</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>300 311 0,35</b>				<b>2,666 2,96</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>Wind Tre SpA</b>				<b>2,666 2,96</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>2,625 % fällig am 20.01.2023</b>				<b>2,666 2,96</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			
<b>€ 100 99 0,11</b>				<b>2,666 2,96</b>				<b>0,100 % fällig am 25.07.2047 (d)</b>			



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Strategy 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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09/2018	8	\$ (2)	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	1	(1)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 115,000 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	22	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 139,750 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	31	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 162,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	16	(16)	(0,02)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 180,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	33	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 183,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	16	0	0,00
E-mini S&P 500 Index September Futures	Short	09/2018	16	36	0,04
Euro-Bobl September Futures	Short	09/2018	31	(25)	(0,03)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	30	26	0,03
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	1	2	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	19	(38)	(0,04)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 144,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	59	0	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 157,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	8	4	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2018	68	(37)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	38	6	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09/2018	77	(83)	(0,09)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09/2018	50	(136)	(0,15)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	6	(22)	(0,03)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	25	(58)	(0,07)
				\$ (344)	(0,38)

### OPTIONSKAUF

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	\$ 120,500	24.08.2018	58	£ 1	\$ 0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	121,500	24.08.2018	1	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	124,000	24.08.2018	9	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note October 2018 Futures	107,000	21.09.2018	13	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note October 2018 Futures	107,500	21.09.2018	7	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	106,500	24.08.2018	6	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	133,000	24.08.2018	34	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	137,000	24.08.2018	1	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	117,000	24.08.2018	1	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	118,000	24.08.2018	3	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	175,000	24.08.2018	21	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	119,000	24.08.2018	3	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2018 Futures	196,000	24.08.2018	1	0	0	0,00
				£ 1	\$ 0	0,00

### OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOE S&P 500	\$ 2.725,000	20.07.2018	1	\$ 2	\$ 3	0,00
Put - CBOE S&P 500	2.650,000	21.09.2018	1	10	5	0,01
Put - CBOE S&P 500	2.650,000	21.12.2018	1	12	9	0,01
Put - CBOE S&P 500	2.700,000	15.03.2019	2	20	24	0,03
Call - EUREX EURO STOXX 50	3.650,000	21.12.2018	6	4	2	0,00
Call - EUREX EURO STOXX 50	3.750,000	21.12.2018	5	6	1	0,00
				\$ 54	\$ 44	0,05

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	\$ 141,000	27.07.2018	2	\$ (2)	\$ 0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	142,000	27.07.2018	3	(2)	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	143,000	27.07.2018	8	(6)	(3)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	145,000	27.07.2018	4	(2)	(4)	(0,01)
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	146,000	27.07.2018	5	(3)	(3)	(0,01)
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2018 Futures	146,500	27.07.2018	4	(3)	(2)	0,00
				\$ (18)	\$ (12)	(0,02)

## OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOE S&P 500	\$ 2.675,000	20.07.2018	2	\$ (2)	\$ (4)	0,00
Put - CBOE S&P 500	2.400,000	21.09.2018	2	(10)	(3)	0,00
Put - CBOE S&P 500	2.350,000	21.12.2018	4	(22)	(13)	(0,01)
Put - CBOE S&P 500	2.550,000	21.12.2018	1	(10)	(6)	(0,01)
Put - CBOE S&P 500	2.600,000	15.03.2019	2	(15)	(18)	(0,02)
Put - EUREX EURO STOXX 50	3.200,000	21.12.2018	6	(4)	(6)	(0,01)
Put - EUREX EURO STOXX 50	3.250,000	21.12.2018	5	(6)	(6)	(0,01)
				\$ (69)	\$ (56)	(0,06)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (368)	(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-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Altria Group, Inc.	(1,000) %	20.06.2021	£ 100	£ 1	0,00

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	1,000 %	20.06.2019	€ 100	\$ 0	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-30 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2023	\$ 600	\$ 3	0,00
iTraxx Europe Main 26 5-Year Index	(1,000)	20.12.2021	€ 700	(4)	(0,01)
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	2.400	23	0,03
				\$ 22	0,02

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-30 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 2.900	\$ (1)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000 %	15.12.2047	\$ 610	\$ 56	0,06
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,499	20.12.2047	480	(8)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,650	02.01.2025	BRL 5.600	(51)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,945	02.01.2025	11.200	(105)	(0,12)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,970	02.01.2025	1.600	(14)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,300	02.01.2025	33.500	(336)	(0,37)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,970	04.01.2027	2.100	6	0,01
Erhalt	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	NZD 200	(5)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	20.06.2020	\$ 3.100	2	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.12.2026	70	2	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	6.200	(20)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,000	27.07.2026	800	11	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,150	19.06.2048	400	29	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	10.500	(298)	(0,33)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	5.500	(43)	(0,05)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,500	19.12.2023	400	(11)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027	800	38	0,04
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,670	19.11.2023	300	(4)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,681	12.12.2023	300	(4)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	3,100	17.04.2028	220	1	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.09.2020	£ 600	(3)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	440	(8)	(0,01)
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,500	21.03.2068	310	25	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	260	6	0,01
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 190.000	(5)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	90.000	(1)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,380 %	18.06.2028	¥ 180.000	\$ (2)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	350.000	(15)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,500	21.12.2045	10.800	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,200	11.06.2027	MXN 2.700	(9)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,480	18.06.2037	2.750	(12)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,733	25.02.2027	15.400	(35)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,310	28.11.2036	3.000	(15)	(0,02)
Erhalt	CPTFEMU	1,477	15.05.2023	€ 300	(1)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,505	26.06.2021	200	0	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,535	15.06.2023	800	0	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,535	15.03.2028	700	(5)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	340	(8)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,678	24.05.2021	\$ 800	14	0,02
Erhalt	CPURNSA	1,845	24.05.2026	200	(6)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,550	26.07.2021	200	1	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,603	12.09.2021	150	0	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,730	26.07.2026	200	(1)	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,780	15.09.2026	600	(3)	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,801	12.09.2026	150	(1)	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,805	12.09.2026	600	(3)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,955	25.07.2024	1.300	37	0,04
Zahlung	CPURNSA	2,070	23.03.2019	80	0	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,070	04.10.2019	1.700	(16)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,102	20.07.2027	200	(5)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,143	25.04.2020	10	0	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,150	25.09.2027	300	(8)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,156	17.10.2027	300	(7)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,180	20.09.2027	290	(6)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,220	13.04.2023	1.380	5	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,263	27.04.2023	80	0	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,263	09.05.2023	300	1	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,281	10.05.2023	460	0	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,353	09.05.2028	300	0	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,360	09.05.2028	450	0	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,364	10.05.2028	460	1	0,00
Zahlung	FRCPXTOB	1,345	15.06.2021	€ 660	0	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,575	15.01.2028	40	0	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,590	15.02.2028	870	(2)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,606	15.02.2028	130	0	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,910	15.01.2038	190	2	0,00
Erhalt	UKRPI	3,100	15.06.2031	£ 300	13	0,02
Erhalt	UKRPI	3,190	15.04.2030	400	11	0,01
Erhalt	UKRPI	3,350	15.05.2030	600	17	0,02
Zahlung	UKRPI	3,428	15.03.2047	250	(18)	(0,02)
Erhalt	UKRPI	3,470	15.09.2032	360	11	0,01
Erhalt	UKRPI	3,530	15.10.2031	100	1	0,00
Zahlung	UKRPI	3,585	15.10.2046	160	(10)	(0,01)
					\$ (814)	(0,90)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (792)</b>	<b>(0,88)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

OPTIONSKAUF								
BARRIER-OPTIONEN								
Kontrahent	Beschreibung	Barrierewert	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC S&P 500 D&I @ 2,615.300	EURUSD 1,200	\$ 2.615	15.03.2019	169	\$ 5	\$ 10	0,01

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettvermögens
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,765 %	16.07.2018	\$ 900	\$ 10	\$ 16	0,02

## OPTIONEN AUF INDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettvermögens
JPM	Call - OTC EURO STOXX 50	€ 3.400,000	20.07.2018	€ 0	\$ 3	\$ 3	0,00

## VERKAUFSOPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.07.2018	\$ 600	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	€ 1.200	(2)	(2)	0,00
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	\$ 400	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	400	(1)	(1)	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 2.400	(5)	(6)	(0,01)
						\$ (10)	\$ (10)	(0,01)

## DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
CBK	Call - OTC USD versus MXN	MXN 21,100	22.08.2018	\$ 730	\$ (8)	\$ (4)	0,00

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	€ 300	\$ (14)	\$ (1)	0,00
JPM	Cap - OTC YOY CPURNSA	233,707	Maximal [(3 + 0,000 %) - (Index Final/Index Initial)] oder 0	10.04.2020	\$ 700	0	0	0,00
	Floor - OTC YOY CPURNSA	233,707	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	10.04.2020	700	0	0	0,00
	Floor - OTC YOY CPURNSA	234,812	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	24.03.2020	800	(9)	(1)	0,00
						\$ (23)	\$ (2)	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,250 %	04.12.2018	\$ 1.800	\$ (10)	\$ (7)	(0,01)

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

## OPTIONEN AUF INDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens	
FBF	Put - OTC EURO STOXX Banks	€ 110,000	20.07.2018	€ 2	\$ (2)	\$ (4)	(0,01)	
	Call - OTC MSCI Emerging Markets	\$ 1.100,000	20.07.2018	\$ 0	(2)	(1)	0,00	
JPM	Call - OTC EURO STOXX 50	€ 3.450,000	20.07.2018	€ 0	(3)	(3)	0,00	
						\$ (7)	\$ (8)	(0,01)

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 Nettvermögens
BOA	Spain Government International Bond	1,000 %	20.03.2019	\$ 100	\$ (1)	\$ 1	\$ 0	0,01
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2021	200	(14)	9	(5)	(0,01)
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	100	(6)	1	(5)	(0,01)
					\$ (21)	\$ 11	\$ (10)	(0,01)

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 Nettvermögens
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)	(0,01)
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(12)	10	(2)	0,00
					\$ (44)	\$ 38	\$ (6)	(0,01)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Strategy Fund (Forts.)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,285) %	16.02.2020	ILS 2.360	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,963	16.02.2028	500	0	1	1	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	300	0	0	0	0,00
BRC	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,374)	20.06.2020	1.270	0	1	1	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	270	0	(1)	(1)	0,00
GLM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	970	0	0	0	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,270)	21.03.2020	1.450	0	1	1	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	210	0	0	0	0,00
HUS	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,370)	20.06.2020	770	0	0	0	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	160	0	0	0	0,00
JPM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	(0,420)	20.06.2020	1.200	0	0	0	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	2,078	20.06.2028	260	0	0	0	0,00
MYC	Erhalt	CPURNSA	2,058	12.05.2025	\$ 400	0	(6)	(6)	(0,01)
	Erhalt	CPURNSA	1,788	18.07.2026	600	0	(32)	(32)	(0,04)
	Erhalt	CPURNSA	1,810	19.07.2026	600	0	(31)	(31)	(0,03)
	Erhalt	CPURNSA	1,800	20.07.2026	600	0	(32)	(32)	(0,03)
	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	50	0	(3)	(3)	0,00
						\$ 0	\$ (102)	\$ (102)	(0,11)

## 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
BNP	Erhalt	AMZX Index	464	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 582	25.01.2019	\$ 0	\$ (21)	\$ (21)	(0,02)
BPS	Erhalt	BCOMF1T Index	5.071	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	1.807	15.08.2018	0	(7)	(7)	(0,01)
	Erhalt	BCOMTR Index	2.967	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	535	15.08.2018	0	(2)	(2)	0,00
	Erhalt	S&P Banks Select Industry Index	74	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	115	15.11.2018	0	(4)	(4)	(0,01)
	Erhalt	AMZX Index	1.136	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.399	28.11.2018	0	(24)	(24)	(0,03)
CBK	Erhalt	BCOMF1T Index	7.818	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	2.785	15.08.2018	0	(11)	(11)	(0,01)
DUB	Erhalt	DWRTFT Index	642	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	6.127	06.06.2019	0	(236)	(236)	(0,26)
GST	Erhalt	BCOMF1T Index	2.064	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	735	15.08.2018	0	(3)	(3)	(0,01)
	Erhalt	BCOMTR Index	420	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	76	15.08.2018	0	0	0	0,00
JPM	Erhalt	BCOMF1T Index	8.547	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	3.046	15.08.2018	0	(12)	(12)	(0,01)
	Erhalt	JMABDEWU Index	16.384	0,300	2.497	15.08.2018	0	7	7	0,01
MYI	Erhalt	TRNGLU Index	793	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	3.587	11.10.2018	0	34	34	0,04
	Erhalt	TRNGLU Index	1.356	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	6.128	06.06.2019	0	62	62	0,07
						\$ 0	\$ (217)	\$ (217)	(0,24)	

## TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

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	Noble Midstream Partners LP	3.131	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 156	16.07.2018	\$ 0	\$ 4	\$ 4	0,00
	Erhalt	Enterprise Products Partners LP	31.150	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	874	19.09.2018	0	(13)	(13)	(0,02)
	Erhalt	Golar LNG Partners LP	5.327	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	83	15.01.2019	0	0	0	0,00
	Erhalt	Phillips 66 Partners LP	10.630	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	546	15.01.2019	0	(4)	(4)	0,00
	Erhalt	Crestwood Equity Partners LP	9.293	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	291	15.02.2019	0	4	4	0,00
	Erhalt	DCP Midstream LP	16.449	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	631	15.02.2019	0	19	19	0,02
	Erhalt	Andeavor Logistics LP	3.185	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	138	15.03.2019	0	(3)	(3)	0,00

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
	Erhalt	NuStar Energy LP	4.508	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 106	15.03.2019	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	(0,01)
	Erhalt	Antero Midstream Partners LP	12.332	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	374	15.04.2019	0	(10)	(10)	(0,01)
	Erhalt	Energy Transfer Partners LP	51.895	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	960	15.04.2019	0	28	28	0,03
	Erhalt	MPLX LP	30.899	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.065	15.04.2019	0	(11)	(11)	(0,01)
	Erhalt	NGL Energy Partners LP	10.490	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	130	15.04.2019	0	1	1	0,00
	Erhalt	ONOEK, Inc.	6.626	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	449	15.04.2019	0	13	13	0,01
	Erhalt	Plains All American Pipeline LP	45.250	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.095	15.04.2019	0	(27)	(27)	(0,03)
	Erhalt	Targa Resources Corp.	5.246	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	244	15.04.2019	0	15	15	0,02
	Erhalt	Western Gas Partners LP	14.020	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	689	15.04.2019	0	(11)	(11)	(0,01)
	Erhalt	Williams Partners LP	7.964	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	318	15.04.2019	0	5	5	0,01
	Erhalt	Cheniere Energy Partners LP	2.471	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	89	15.05.2019	0	0	0	0,00
	Erhalt	Enable Midstream Partners LP	8.951	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	147	15.05.2019	0	6	6	0,01
	Erhalt	Magellan Midstream Partners LP	10.275	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	701	15.05.2019	0	8	8	0,01
	Erhalt	Rice Midstream Partners LP	8.018	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	147	15.05.2019	0	(11)	(11)	(0,01)
	Erhalt	Valero Energy Partners LP	3.295	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	130	15.05.2019	0	(4)	(4)	(0,01)
CBK	Erhalt	Tallgrass Equity Partners LP	4.339	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	187	15.04.2019	0	1	1	0,00
GST	Erhalt	Williams Cos., Inc.	15.814	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	422	19.09.2018	0	7	7	0,01
	Erhalt	EQT Midstream Partners LP	5.163	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	287	15.02.2019	0	(21)	(21)	(0,02)
	Erhalt	Enable Midstream Partners LP	9.439	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	154	15.04.2019	0	7	7	0,01
	Erhalt	Energy Transfer Partners LP	18.776	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	347	15.04.2019	0	10	10	0,01
	Erhalt	Enterprise Products Partners LP	21.718	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	609	15.04.2019	0	(9)	(9)	(0,01)
MYI	Erhalt	AmeriGas Partners LP	3.021	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	126	27.11.2018	0	2	2	0,00
							\$ 0	\$ 2	\$ 2	0,00

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	09/2018	\$ 95	THB 3.036	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
BOA	07/2018	BRL 24.343	\$ 6.438	112	0	112	0,12
	07/2018	\$ 123	ARS 3.192	0	(12)	(12)	(0,01)
	07/2018	2.831	AUD 3.835	3	0	3	0,00
	08/2018	AUD 3.835	\$ 2.831	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	\$ 6.420	BRL 24.343	0	(116)	(116)	(0,13)
BPS	07/2018	ARS 6.130	\$ 221	11	0	11	0,01
	07/2018	€ 10.305	11.952	0	(79)	(79)	(0,09)
	07/2018	\$ 228	ARS 6.262	0	(11)	(11)	(0,01)
	07/2018	568	¥ 61.700	0	(11)	(11)	(0,01)
	08/2018	ZAR 1.324	\$ 104	8	0	8	0,01
	09/2018	\$ 33	IDR 467.931	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	471	INR 32.142	0	(6)	(6)	(0,01)
BRC	08/2018	1.536	MXN 29.343	0	(56)	(56)	(0,06)
	09/2018	KRW 259.221	\$ 234	1	0	1	0,00
CBK	07/2018	£ 7.299	9.670	34	0	34	0,04
	07/2018	RUB 36.570	578	0	(4)	(4)	(0,01)
	07/2018	\$ 127	€ 110	1	0	1	0,00
	07/2018	20	TRY 94	0	0	0	0,00
	08/2018	MXN 1.098	\$ 54	0	(2)	(2)	0,00
DUB	07/2018	ARS 10.026	359	12	0	12	0,01
	07/2018	TRY 260	53	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	\$ 28	ARS 704	0	(4)	(4)	0,00
FBF	07/2018	€ 10	\$ 12	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 308	COP 885.302	0	(6)	(6)	(0,01)
GLM	07/2018	AUD 3.835	\$ 2.883	49	0	49	0,06
	07/2018	€ 221	257	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	£ 126	168	2	0	2	0,00
	07/2018	PEN 783	239	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 789	€ 676	0	0	0	0,00
	07/2018	104	£ 77	0	(2)	(2)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens	
HUS	09/2018	INR 31.557	\$ 458	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00	
	07/2018	\$ 124	€ 107	1	0	1	0,00	
	07/2018	580	RUB 36.570	3	0	3	0,00	
	08/2018	€ 360	\$ 447	25	0	25	0,03	
	08/2018	MXN 1.498	75	0	(1)	(1)	0,00	
	08/2018	RUB 36.570	577	0	(3)	(3)	0,00	
	08/2018	\$ 678	RUB 42.354	0	(6)	(6)	(0,01)	
	08/2018	ZAR 621	\$ 49	4	0	4	0,00	
	09/2018	CNH 6.153	967	41	0	41	0,05	
	09/2018	TWD 3.260	110	2	0	2	0,00	
JPM	10/2018	€ 20	25	1	0	1	0,00	
	07/2018	BRL 496	132	3	0	3	0,00	
	07/2018	CAD 1.167	900	13	0	13	0,02	
	07/2018	€ 70	87	6	0	6	0,01	
	07/2018	¥ 120.000	1.104	19	0	19	0,02	
	07/2018	NZD 941	662	25	0	25	0,03	
	07/2018	\$ 162	CLP 101.755	0	(5)	(5)	(0,01)	
	07/2018	884	€ 762	5	0	5	0,01	
	07/2018	112	£ 84	0	(1)	(1)	0,00	
	08/2018	ILS 249	\$ 70	2	0	2	0,00	
MSB	07/2018	CAD 300	231	3	0	3	0,00	
	07/2018	¥ 50.000	460	8	0	8	0,01	
	07/2018	\$ 6.759	BRL 24.839	0	(303)	(303)	(0,34)	
	08/2018	10	ARS 217	0	(3)	(3)	0,00	
	09/2018	ARS 905	\$ 41	11	0	11	0,01	
	09/2018	MYR 121	30	0	0	0	0,00	
	NGF	09/2018	KRW 145.102	131	0	0	0	0,00
		09/2018	SGD 495	365	1	0	1	0,00
	RYL	09/2018	TWD 11.039	365	1	0	1	0,00
		10/2018	€ 60	75	4	0	4	0,01
SCX	07/2018	CAD 600	464	8	0	8	0,01	
	07/2018	COP 614.272	216	7	0	7	0,01	
SOG	07/2018	£ 369	489	1	0	1	0,00	
	08/2018	\$ 1.045	TRY 4.666	0	(45)	(45)	(0,05)	
	09/2018	IDR 2.591.295	\$ 182	3	0	3	0,00	
	09/2018	KRW 433.605	403	13	0	13	0,01	
	09/2018	\$ 52	CNY 333	0	(2)	(2)	0,00	
	07/2018	DKK 3.485	\$ 579	33	0	33	0,04	
	08/2018	\$ 264	ILS 951	0	(3)	(3)	0,00	
	09/2018	196	HKD 1.537	0	0	0	0,00	
	07/2018	10.451	€ 8.978	31	0	31	0,03	
	08/2018	€ 8.978	\$ 10.474	0	(31)	(31)	(0,03)	
SSB	09/2018	\$ 452	IDR 6.336.941	0	(14)	(14)	(0,02)	
	07/2018	¥ 61.700	\$ 562	5	0	5	0,01	
TOR	08/2018	\$ 563	¥ 61.700	0	(5)	(5)	(0,01)	
	07/2018	10.093	£ 7.633	0	(15)	(15)	(0,02)	
UAG	08/2018	£ 7.633	\$ 10.107	16	0	16	0,02	
				\$ 531	\$ (759)	\$ (228)	(0,25)	

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional EUR (Partially Hedged) Class und Class E EUR (Partially Hedged) 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	07/2018	\$ 3.668	€ 3.125	\$ 0	\$ (20)	\$ (20)	(0,02)
BPS	07/2018	16.350	14.097	108	0	108	0,12
BRC	07/2018	€ 151	\$ 177	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	128	150	1	0	1	0,00
GLM	07/2018	274	321	0	0	0	0,00
MSB	07/2018	13.437	15.519	0	(169)	(169)	(0,19)
	08/2018	\$ 15.553	€ 13.437	169	0	169	0,19
RBC	07/2018	€ 137	\$ 159	0	(1)	(1)	0,00
RYL	07/2018	38	44	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	455	534	3	0	3	0,00
SOG	09/2018	\$ 37	HKD 291	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	€ 13.313	\$ 15.497	0	(46)	(46)	(0,05)
	07/2018	\$ 16.437	€ 14.126	55	0	55	0,06
	08/2018	15.532	13.313	45	0	45	0,05
TOR	07/2018	AUD 48	\$ 36	1	0	1	0,00
				\$ 382	\$ (236)	\$ 146	0,16

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Partially Hedged) Class 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	07/2018	\$ 262	£ 196	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
BRC	07/2018	£ 790	\$ 1.033	0	(10)	(10)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	08/2018	\$ 1.034	£ 790	\$ 10	\$ 0	\$ 10	0,01
SCX	07/2018	1.048	791	0	(4)	(4)	0,00
UAG	07/2018	1.048	789	0	(7)	(7)	(0,01)
	07/2018	£ 785	\$ 1.037	2	0	2	0,00
	08/2018	\$ 1.039	£ 785	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 12	\$ (26)	\$ (14)	(0,01)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (431)	(0,47)

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKTWERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Fannie Mae, TBA 3,000 % fällig am 01.07.2048	\$ 4.800	\$ (4.650)	(5,15)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (4.650)	(5,15)
Summe Anlagen		\$ 113.710	126,02
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (23.476)	(26,02)
Nettovermögen		\$ 90.234	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

- (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) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 4.552 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 1.784 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 491 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

## (i) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 132	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	\$ (137)	\$ 132	\$ 132	0,15
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (137)	\$ 132	\$ 132	0,15

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

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 15.519	\$ 104.432	\$ 0	\$ 119.951
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(356)	(1.245)	10	(1.591)
Leerverkäufe	0	(4.650)	0	(4.650)
<b>Summen</b>	<b>\$ 15.163</b>	<b>\$ 98.537</b>	<b>\$ 10</b>	<b>\$ 113.710</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Strategy Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 11.900	\$ 103.160	\$ 0	\$ 115.060
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	29	142	12	183
Leerverkäufe	0	(6.601)	0	(6.601)
<b>Summen</b>	<b>\$ 11.929</b>	<b>\$ 96.701</b>	<b>\$ 12</b>	<b>\$ 108.642</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 der Wertpapieranlagen.

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

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
GRE	2,060 %	01.06.2018	17.07.2018	\$ (4.563)	\$ (4.571)	(5,07)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (4.571)</b>	<b>(5,07)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (4)	\$ 0	\$ (4)
BNP	(21)	0	(21)
BOA	(33)	0	(33)
BPS	(21)	0	(21)
BRC	(55)	0	(55)
CBK	4	0	4
CKL	(6)	0	(6)
DUB	(232)	(520)	(752)
FBF	(10)	0	(10)
GLM	50	0	50
GST	(15)	0	(15)
HUS	62	0	62
JPM	71	0	71
MSB	(284)	260	(24)
MYC	(91)	0	(91)
MYI	98	10	108
NGF	2	0	2
RBC	(1)	0	(1)
RYL	4	0	4
SCX	(19)	0	(19)
SOG	30	0	30
SSB	40	0	40
TOR	1	0	1
UAG	(1)	0	(1)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	113,53	72,20
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	15,81	54,01
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	3,59	2,35
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,41)	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,88)	(0,25)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,47)	0,43
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,15)	(7,38)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(5,07)	(6,61)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Inflation Strategy Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)		
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>				
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)				
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$	5.863	5.754	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)	\$	3.257	3.191
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£	1.533	2.488	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)		3.165	3.083
Japan Treasury Bills 1,750 % fällig am 15.01.2028	\$	1.973	2.186	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b)		2.804	2.786
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028		1.907	1.889	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)		2.810	2.744
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€	1.178	1.675	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b)		2.073	2.251
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£	741	1.667	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2021 (b)		2.226	2.188
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)	\$	1.569	1.575	United States Treasury Note 2,750 % fällig am 15.02.2028		1.907	1.887
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 01.05.2018	¥	170.000	1.565	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)		1.637	1.623
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.07.2018		170.000	1.555	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£	883	1.397
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$	1.545	1.499	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2046		564	1.225
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)		1.305	1.293	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2023	€	778	951
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2025	€	814	1.078	United Kingdom Gilt 4,500 % fällig am 07.12.2042	£	430	904
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2023		774	986	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€	601	835
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	¥	104.100	981	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,100 % fällig am 15.09.2026		510	770
	<b>AKTIEN</b>			Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2027	¥	70.561	684
Simon Property Group Inc		5.810	947	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$	519	613
Source Physical Gold P-ETC		7.415	905	France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2021	€	494	607
	<b>PARI (000S)</b>			U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.12.2022	\$	600	587
United Kingdom Gilt 4,500 % fällig am 07.12.2042	£	430	896	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2044	£	275	585
Japan Treasury Bills 1,850 % fällig am 25.07.2027	¥	570	871				
United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 20.04.2018	GBP	500	698				

(a) Der Inflation Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund

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>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>HSBC Holdings PLC</b> 2,926 % fällig am 18.05.2021	\$ 3.800	\$ 3.807	0,27	<b>UBS AG</b> 2,450 % fällig am 01.12.2020	\$ 3.900	\$ 3.817	0,27
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>HSBC USA, Inc.</b> 2,965 % fällig am 13.11.2019	4.200	4.220	0,29	2,639 % fällig am 07.12.2018	2.300	2.302	0,16
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				<b>ING Bank NV</b> 2,050 % fällig am 17.08.2018	4.000	3.998	0,28	2,639 % fällig am 28.05.2019	5.600	5.608	0,39
<b>ABN AMRO Bank NV</b> 2,100 % fällig am 18.01.2019	\$ 6.600	\$ 6.583	0,46	<b>International Lease Finance Corp.</b> 5,875 % fällig am 01.04.2019	6.400	6.532	0,46	2,901 % fällig am 08.06.2020	4.800	4.816	0,34
2,995 % fällig am 18.01.2019	250	251	0,02	<b>7,125 % fällig am 01.09.2018</b>	700	705	0,05	<b>UBS Group Funding Switzerland AG</b> 4,128 % fällig am 14.04.2021	6.700	6.919	0,48
<b>AIG Global Funding</b> 2,797 % fällig am 25.06.2021	3.100	3.103	0,22	<b>8,250 % fällig am 15.12.2020</b>	4.515	4.981	0,35	<b>Unibail-Rodamco SE</b> 3,118 % fällig am 16.04.2019	9.900	9.943	0,70
<b>Ally Financial, Inc.</b> 3,250 % fällig am 05.11.2018	800	801	0,06	<b>John Deere Capital Corp.</b> 1,950 % fällig am 08.01.2019	4.584	4.570	0,32	<b>Wells Fargo &amp; Co.</b> 2,150 % fällig am 15.01.2019	5.300	5.283	0,37
8,000 % fällig am 31.12.2018	600	613	0,04	<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b> 2,250 % fällig am 23.01.2020	300	296	0,02	<b>Wells Fargo Bank N.A.</b> 2,964 % fällig am 06.12.2019	2.600	2.618	0,18
<b>American Express Credit Corp.</b> 2,375 % fällig am 26.05.2020 (g)	13.851	13.654	0,96	<b>2,350 % fällig am 28.01.2019</b>	2.300	2.297	0,16				
2,684 % fällig am 03.05.2019	2.400	2.405	0,17	<b>3,780 % fällig am 01.03.2021</b>	5.000	5.141	0,36				
<b>American Tower Corp.</b> 2,800 % fällig am 01.06.2020	7.100	7.042	0,49	<b>6,300 % fällig am 23.04.2019</b>	700	720	0,05				
<b>Australia &amp; New Zealand Banking Group Ltd.</b> 2,781 % fällig am 17.05.2021	3.900	3.895	0,27	<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b> 2,605 % fällig am 13.02.2020	5.800	5.800	0,41	<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
3,300 % fällig am 17.05.2021	4.000	4.003	0,28	<b>2,702 % fällig am 26.04.2021</b>	8.000	8.004	0,56	<b>Adani Ports &amp; Special Economic Zone Ltd.</b> 3,500 % fällig am 29.07.2020	4.200	4.154	0,29
<b>Banco de Galicia y Buenos Aires S.A.</b> 25,980 % fällig am 26.04.2020	ARS 51.000	1.461	0,10	<b>Lloyds Bank PLC</b> 2,853 % fällig am 07.05.2021	4.100	4.107	0,29	<b>Andeavor Logistics LP</b> 5,500 % fällig am 15.10.2019	1.382	1.418	0,10
<b>Banco Santander Mexico S.A.</b> 25,500 % fällig am 17.07.2019	172.100	5.253	0,37	<b>Macquarie Bank Ltd.</b> 3,479 % fällig am 29.07.2020 (g)	8.600	8.707	0,61	<b>Anthem, Inc.</b> 2,500 % fällig am 21.11.2020	2.600	2.557	0,18
<b>Banco Santander S.A.</b> 3,459 % fällig am 12.04.2023	\$ 4.000	3.998	0,28	<b>Manufacturers &amp; Traders Trust Co.</b> 2,300 % fällig am 30.01.2019	1.700	1.696	0,12	<b>BAT Capital Corp.</b> 2,945 % fällig am 14.08.2020	4.900	4.918	0,34
<b>Bank of America Corp.</b> 2,600 % fällig am 15.01.2019	6.000	5.997	0,42	<b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b> 3,061 % fällig am 02.03.2023	8.400	8.423	0,59	<b>Bayer U.S. Finance LLC</b> 2,965 % fällig am 25.06.2021	3.100	3.106	0,22
3,108 % fällig am 05.03.2024	7.000	6.981	0,49	<b>Mizuho Financial Group, Inc.</b> 3,108 % fällig am 05.03.2023	4.300	4.302	0,30	<b>Becton Dickinson and Co.</b> 2,133 % fällig am 06.06.2019	300	299	0,02
6,875 % fällig am 15.11.2018	100	102	0,01	<b>MUFG Bank Ltd</b> 2,350 % fällig am 08.09.2019	2.800	2.779	0,19	<b>Boston Scientific Corp.</b> 2,850 % fällig am 15.05.2020	2.200	2.185	0,15
<b>Barclays PLC</b> 4,463 % fällig am 10.08.2021	3.700	3.842	0,27	<b>Nasdaq, Inc.</b> 2,722 % fällig am 22.03.2019	100	100	0,01	<b>Campbell Soup Co.</b> 2,835 % fällig am 16.03.2020	7.200	7.181	0,50
<b>Capital One Financial Corp.</b> 2,400 % fällig am 30.10.2020	4.100	4.001	0,28	<b>Navient Corp.</b> 4,875 % fällig am 17.06.2019	400	402	0,03	<b>Central Nippon Expressway Co. Ltd.</b> 2,803 % fällig am 15.02.2022	7.000	6.973	0,49
<b>Citibank N.A.</b> 2,678 % fällig am 01.05.2020	6.700	6.707	0,47	<b>Nordea Bank AB</b> 4,875 % fällig am 27.01.2020	1.100	1.130	0,08	<b>2,903 % fällig am 04.08.2020</b>	2.400	2.406	0,17
3,050 % fällig am 01.05.2020	6.700	6.699	0,47	<b>Nykredit Realcredit A/S</b> 1,000 % fällig am 01.07.2018	DKK 104.600	16.393	1,15	<b>Charter Communications Operating LLC</b> 3,579 % fällig am 23.07.2020	3.700	3.697	0,26
<b>Citigroup, Inc.</b> 3,056 % fällig am 27.10.2022	5.400	5.389	0,38	<b>Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.</b> 2,771 % fällig am 17.05.2021	\$ 4.800	4.815	0,34	<b>4,464 % fällig am 23.07.2022</b>	600	608	0,04
3,714 % fällig am 30.03.2021	5.200	5.316	0,37	<b>Piper Jaffray Cos.</b> 5,060 % fällig am 09.10.2018	1.000	1.005	0,07	<b>Conagra Brands, Inc.</b> 2,831 % fällig am 09.10.2020	2.000	1.991	0,14
<b>Citizens Bank N.A.</b> 2,300 % fällig am 03.12.2018	2.900	2.896	0,20	<b>Private Export Funding Corp.</b> 2,100 % fällig am 19.12.2019	12.000	11.903	0,83	<b>CVS Health Corp.</b> 2,957 % fällig am 09.03.2020	5.100	5.121	0,36
2,500 % fällig am 14.03.2019	1.000	998	0,07	<b>QNB Finance Ltd.</b> 3,705 % fällig am 12.02.2020	9.900	9.947	0,70	<b>D.R. Horton, Inc.</b> 3,750 % fällig am 01.03.2019	1.400	1.404	0,10
<b>Commonwealth Bank of Australia</b> 1,750 % fällig am 02.11.2018	1.200	1.197	0,08	<b>Reliance Standard Life Global Funding</b> 2,500 % fällig am 15.01.2020	1.900	1.880	0,13	<b>Daimler Finance North America LLC</b> 2,000 % fällig am 03.08.2018	7.000	6.997	0,49
<b>Compass Bank</b> 3,057 % fällig am 11.06.2021	3.900	3.900	0,27	<b>Royal Bank of Scotland Group PLC</b> 3,885 % fällig am 25.06.2024	3.800	3.795	0,27	<b>2,375 % fällig am 01.08.2018</b>	4.100	4.099	0,29
<b>Credit Agricole S.A.</b> 3,379 % fällig am 24.04.2023	4.450	4.440	0,31	<b>6,400 % fällig am 21.10.2019</b>	2.600	2.698	0,19	<b>2,753 % fällig am 04.05.2020</b>	4.100	4.100	0,29
<b>Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.</b> 4,645 % fällig am 16.04.2021	3.900	4.077	0,28	<b>Santander UK PLC</b> 2,920 % fällig am 01.06.2021	3.900	3.899	0,27	<b>2,785 % fällig am 12.02.2021</b>	3.150	3.152	0,22
<b>Deutsche Bank AG</b> 2,850 % fällig am 10.05.2019	3.900	3.867	0,27	<b>Skandinaviska Enskilda Banken AB</b> 2,903 % fällig am 13.09.2019	5.000	5.024	0,35	<b>Dell International LLC</b> 3,480 % fällig am 01.06.2019	4.300	4.312	0,30
4,263 % fällig am 10.05.2019	8.000	8.039	0,56	<b>SMBC Trust Account</b> 3,531 % fällig am 09.04.2021	5.000	5.004	0,35	<b>Delta Air Lines, Inc.</b> 3,400 % fällig am 19.04.2021	800	797	0,06
<b>Dexia Credit Local S.A.</b> 2,500 % fällig am 25.01.2021	5.100	5.039	0,35	<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b> 2,703 % fällig am 17.01.2020	6.000	6.001	0,42	<b>Diageo Capital PLC</b> 2,566 % fällig am 18.05.2020	1.800	1.801	0,13
<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b> 2,597 % fällig am 04.11.2019	2.200	2.182	0,15	<b>3,025 % fällig am 19.10.2018</b>	7.000	7.011	0,49	<b>3,000 % fällig am 18.05.2020</b>	2.200	2.204	0,15
2,681 % fällig am 09.01.2020	1.700	1.685	0,12	<b>Svenska Handelsbanken AB</b> 2,800 % fällig am 24.05.2021	3.800	3.802	0,27	<b>Discovery Communications LLC</b> 3,035 % fällig am 20.09.2019	1.500	1.507	0,11
3,331 % fällig am 09.01.2020	1.500	1.511	0,11	<b>Synchrony Financial</b> 3,584 % fällig am 03.02.2020	5.100	5.149	0,36	<b>Dominion Energy Gas Holdings LLC</b> 2,500 % fällig am 15.12.2019	2.300	2.280	0,16
5,750 % fällig am 01.02.2021	900	945	0,07	<b>Toyota Motor Credit Corp.</b> 1,700 % fällig am 19.02.2019	7.898	7.856	0,55	<b>eBay, Inc.</b> 2,150 % fällig am 05.06.2020	500	491	0,03
<b>General Motors Financial Co., Inc.</b> 3,100 % fällig am 15.01.2019	2.000	2.002	0,14	<b>2,000 % fällig am 24.10.2018</b>	5.100	5.092	0,36	<b>Energy Transfer Partners LP</b> 4,150 % fällig am 01.10.2020	350	354	0,02
3,200 % fällig am 13.07.2020	2.200	2.191	0,15	<b>U.S. Bank N.A.</b> 2,682 % fällig am 26.04.2021	6.700	6.704	0,47	<b>6,700 % fällig am 01.07.2018</b>	1.800	1.800	0,13
3,908 % fällig am 15.01.2020	6.700	6.805	0,48	<b>3,150 % fällig am 26.04.2021</b>	6.700	6.718	0,47	<b>Equifax, Inc.</b> 3,200 % fällig am 15.08.2021	4.700	4.716	0,33
4,408 % fällig am 15.01.2019	1.900	1.919	0,13					<b>ERAC USA Finance LLC</b> 2,800 % fällig am 01.11.2018	3.500	3.500	0,25
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b> 3,080 % fällig am 23.02.2023	3.500	3.489	0,24					<b>GATX Corp.</b> 3,083 % fällig am 05.11.2021	3.700	3.719	0,26
3,400 % fällig am 25.04.2019	3.000	3.019	0,21					<b>General Motors Co.</b> 3,500 % fällig am 02.10.2018	2.000	2.004	0,14
3,443 % fällig am 15.11.2018 (g)	12.735	12.783	0,89					<b>Georgia-Pacific LLC</b> 2,539 % fällig am 15.11.2019	4.800	4.770	0,33
3,541 % fällig am 15.09.2020	3.800	3.858	0,27								
3,720 % fällig am 23.04.2021	3.200	3.271	0,23								
6,000 % fällig am 15.06.2020	2.000	2.104	0,15								
<b>Harley-Davidson Financial Services, Inc.</b> 2,831 % fällig am 21.05.2020	4.000	4.009	0,28								



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration 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>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>			
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				Palmer Square CLO Ltd.				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
3,739 % fällig am 25.12.2034	\$ 44	\$ 45	0,00	0,000 % fällig am 15.08.2026 (c)	\$ 3.600	\$ 3.600	0,25	PIMCO Fixed Income Source ETFs plc			
3,755 % fällig am 25.01.2035	52	53	0,00	Palmer Square Loan Funding Ltd.				- PIMCO US Dollar Short Maturity			
4,163 % fällig am 25.03.2035	2.360	2.405	0,17	3,010 % fällig am 15.07.2026	4.200	4.184	0,29	Source UCITS ETF (f)	734.360	\$ 74.508	5,22
		50.282	3,52	Prestige Auto Receivables Trust							
				1,460 % fällig am 15.07.2020	986	985	0,07				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>RAAC Trust</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				2,571 % fällig am 25.03.2037	456	458	0,03	<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
3,066 % fällig am 25.11.2033	1.410	1.391	0,10	Red & Black Auto Germany UG				American Electric Power, Inc.	\$ 3.900	3.895	0,27
Adams Mill CLO Ltd.				0,130 % fällig am 15.01.2027	€ 6.072	7.132	0,50	Bank of Montreal			
3,448 % fällig am 15.07.2026	5.300	5.304	0,37	Santander Drive Auto Receivables Trust				1,525 % fällig am 05.07.2018	CAD 6.000	4.560	0,32
Ally Auto Receivables Trust				1,490 % fällig am 18.02.2020	\$ 29	29	0,00	Bank of Nova Scotia			
1,490 % fällig am 15.11.2019	2.059	2.056	0,15	Silver Arrow Compartment Silver Arrow UK				1,543 % fällig am 03.07.2018	6.000	4.561	0,32
2,720 % fällig am 17.05.2021	4.600	4.600	0,32	SLC Student Loan Trust				Boston Scientific Corp.			
American Express Credit Account Master Trust				2,441 % fällig am 15.09.2026	\$ 2.751	2.746	0,19	2,430 % fällig am 11.07.2018	\$ 3.800	3.797	0,27
1,640 % fällig am 15.12.2021	8.300	8.229	0,58	2,451 % fällig am 15.03.2027	2.782	2.774	0,20	2,950 % fällig am 07.08.2018	3.900	3.890	0,27
AmeriCredit Automobile Receivables Trust				2,503 % fällig am 15.05.2023	6.865	6.862	0,48	2,500 % fällig am 13.08.2018	3.900	3.888	0,27
2,315 % fällig am 19.07.2021	2.800	2.801	0,20	SLM Student Loan Trust				Energy Transfer Partners			
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				2,450 % fällig am 25.10.2024	1.802	1.801	0,13	2,800 % fällig am 03.07.2018	3.000	2.999	0,21
3,111 % fällig am 25.10.2034	3.100	3.137	0,22	2,450 % fällig am 26.01.2026	5.710	5.696	0,40	2,950 % fällig am 16.07.2018	3.800	3.796	0,27
BA Credit Card Trust				2,510 % fällig am 25.10.2029	4.045	4.028	0,28	Entergy Corp.			
2,453 % fällig am 15.06.2021	8.000	8.013	0,56	2,860 % fällig am 25.04.2024	2.695	2.700	0,19	2,430 % fällig am 12.07.2018	3.800	3.797	0,27
Caim CLO BV				2,960 % fällig am 25.10.2029	5.000	5.009	0,35	General Motors Fincial Co., Inc.			
0,650 % fällig am 20.10.2028	€ 3.000	3.506	0,25	Soundview Home Loan Trust				2,470 % fällig am 19.07.2018	900	899	0,06
Capital One Multi-Asset Execution Trust				2,241 % fällig am 25.03.2037	584	568	0,04	Hitachi Capital America			
2,523 % fällig am 15.02.2022	\$ 3.300	3.309	0,23	South Carolina Student Loan Corp.				2,450 % fällig am 13.07.2018	4.200	4.196	0,29
CARDS Trust				3,300 % fällig am 03.09.2024	877	885	0,06	HSBC Bank Canada			
2,443 % fällig am 18.04.2022	5.000	5.006	0,35	Structured Asset Investment Loan Trust				1,584 % fällig am 04.07.2018	CAD 6.000	4.560	0,32
2,773 % fällig am 15.07.2021	3.300	3.305	0,23	3,066 % fällig am 25.10.2033	435	435	0,03	Marriott International			
CarMax Auto Owner Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				2,320 % fällig am 19.07.2018	\$ 3.900	3.895	0,27
2,730 % fällig am 16.08.2021	4.200	4.197	0,29	2,251 % fällig am 25.03.2036	477	477	0,03	McKesson Corp.			
Chase Issuance Trust				2,766 % fällig am 25.11.2035	1.000	1.004	0,07	2,400 % fällig am 19.07.2018	3.100	3.096	0,22
2,493 % fällig am 16.11.2020	8.000	8.011	0,56	Venture CLO Ltd.				Rockwell Collins, Inc.			
CIFC Funding Ltd.				3,119 % fällig am 28.02.2026	4.100	4.083	0,29	2,350 % fällig am 17.07.2018	3.900	3.896	0,27
3,128 % fällig am 15.04.2027	5.200	5.186	0,36	VOLT LLC				Spectra Energy Partners			
Countrywide Asset-Backed Certificates				3,125 % fällig am 25.06.2047	1.249	1.243	0,09	2,750 % fällig am 09.07.2018	4.300	4.297	0,30
3,141 % fällig am 25.11.2034	2.332	2.340	0,16	3,250 % fällig am 25.05.2047	2.700	2.687	0,19	UDR, Inc.			
CPS Auto Trust				4,375 % fällig am 27.11.2045	594	601	0,04	2,400 % fällig am 13.07.2018	2.500	2.498	0,18
1,500 % fällig am 15.06.2020	980	977	0,07	Voya CLO Ltd.				Virginia Electric & Power Co.			
Credit Acceptance Auto Loan Trust				3,080 % fällig am 25.07.2026	5.200	5.184	0,36	2,580 % fällig am 23.07.2018	8.000	7.988	0,56
3,470 % fällig am 17.05.2027	2.400	2.407	0,17	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust							
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				2,351 % fällig am 25.05.2036	873	873	0,06				
2,711 % fällig am 25.01.2032	20	20	0,00	WhiteHorse Ltd.							
Discover Card Execution Note Trust				3,010 % fällig am 17.04.2027	4.000	3.993	0,28				
2,503 % fällig am 15.07.2021	1.600	1.603	0,11	3,563 % fällig am 03.02.2025	758	759	0,05	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (h)</b>			
ECMC Group Student Loan Trust				World Omni Auto Receivables Trust							
2,841 % fällig am 27.02.2068	4.144	4.153	0,29	1,950 % fällig am 15.03.2019	1.459	1.459	0,10				
Evans Grove CLO Ltd.				World Omni Automobile Lease Securitization Trust							
3,239 % fällig am 28.05.2028	3.900	3.900	0,27	2,590 % fällig am 16.11.2020	5.000	4.991	0,35				
Figueroa CLO Ltd.											
0,000 % fällig am 15.01.2027 (c)	3.600	3.600	0,25			195.176	13,66				
First Franklin Mortgage Loan Trust				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
2,811 % fällig am 25.05.2035	\$ 148	149	0,01	Agence Francaise de Developpement							
Ford Credit Auto Lease Trust				2,750 % fällig am 22.03.2021	6.600	6.557	0,46				
1,560 % fällig am 15.11.2019	1.167	1.165	0,08	Argentina Government International Bond							
2,213 % fällig am 15.11.2019	1.668	1.668	0,12	34,188 % fällig am 03.04.2022	ARS 103.500	3.274	0,23				
2,710 % fällig am 15.12.2020	4.200	4.198	0,29	Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER							
Fremont Home Loan Trust				4,000 % fällig am 06.03.2020	101.900	3.518	0,24				
2,796 % fällig am 25.04.2035	1.806	1.816	0,13	Cyprus Government International Bond							
Marathon Ltd.				3,875 % fällig am 06.05.2022	€ 4.900	6.285	0,44				
0,000 % fällig am 15.06.2028 (c)	2.300	2.303	0,16	Japan Finance Organization for Municipalities							
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				2,000 % fällig am 08.09.2020	\$ 6.700	6.551	0,46				
2,796 % fällig am 25.08.2035	1.075	1.081	0,08	Republic of Greece Government International Bond							
MP CLO Ltd.				4,750 % fällig am 17.04.2019	€ 3.300	3.970	0,28				
3,195 % fällig am 18.04.2027	4.300	4.296	0,30	Spain Government International Bond							
Navient Private Education Loan Trust				4,000 % fällig am 30.04.2020	8.900	11.196	0,78				
3,273 % fällig am 15.12.2028	1.643	1.664	0,12								
Navient Student Loan Trust						41.351	2,89				
2,391 % fällig am 26.07.2066	454	454	0,03								
Neinet Student Loan Trust				<b>INVESTMENTFONDS</b>							
2,440 % fällig am 23.08.2027	3.797	3.794	0,27	PIMCO Funds: Global Investors							
3,980 % fällig am 25.11.2024	3.942	4.004	0,28	Series plc - US Short-Term Fund (f)	2.934.867	29.789	2,09				
NYMT Residential											
4,000 % fällig am 25.03.2021	396	399	0,03								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>				<b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>			
(0,180)% fällig am 23.07.2018 (d)(e)	¥ 3.410.000	\$ 30.788	2,15	15,104 % fällig am 06.12.2018 (d)(e)	NGN 1.172.200	\$ 3.088	0,22
(0,160)% fällig am 20.08.2018 (d)(e)	550.000	4.966	0,35	Summe kurzfristige Instrumente		342.967	24,02
(0,157)% fällig am 27.08.2018 (d)(e)	1.790.000	16.164	1,13				
(0,153)% fällig am 27.08.2018 (d)(e)	930.000	8.398	0,59	<b>AKTIEN</b>			
(0,143)% fällig am 27.08.2018 (d)(e)	2.450.000	22.123	1,55	<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
(0,141)% fällig am 06.08.2018 (d)(e)	14.010.000	126.499	8,86	<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (f)</b>			
(0,139)% fällig am 20.08.2018 (d)(e)	990.000	8.939	0,62	3.474.463		34.790	2,43
(0,120)% fällig am 13.08.2018 (d)(e)	500.000	4.515	0,32	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt		\$ 1.968.464	137,82
		222.392	15,57				

## 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 Euribor December Futures	Long	12/2018	271	\$ 27	0,00
3-Month Euribor September Futures	Long	09/2018	482	35	0,00
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2019	680	18	0,00
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2020	433	(103)	(0,01)
90-Day Eurodollar June Futures	Long	06/2019	1.696	(671)	(0,05)
90-Day Eurodollar June Futures	Short	06/2020	1.065	131	0,01
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2019	940	(1.669)	(0,12)
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03/2020	646	59	0,01
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2019	151	(6)	0,00
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09/2020	1.359	98	0,01
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 166,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	180	0	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	409	591	0,04
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	482	(814)	(0,06)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09/2018	1.442	211	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	348	65	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09/2018	1.144	(89)	(0,01)
				\$ (2.117)	(0,15)

## OPTIONSKAUF

## OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	\$ 133,000	24.08.2018	431	\$ 3	\$ 1	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	137,000	24.08.2018	387	3	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	137,500	24.08.2018	84	1	0	0,00
				\$ 7	\$ 1	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (2.116)	(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
Deutsche Bank AG	1,000 %	20.06.2019	€ 2.600	\$ 4	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.03.2019	\$ 1.300	(11)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2018	€ 600	(4)	0,00
				\$ (11)	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.IG-30 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 72.200	\$ (293)	(0,02)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,500 %	02.01.2020	BRL	330.700	\$ (492)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,750	02.01.2020		135.000	(189)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,660	04.01.2021		94.500	(177)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	\$	19.600	111	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027		22.400	136	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	£	23.600	(418)	(0,03)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.03.2026	¥	6.270.000	(104)	(0,01)
						\$ (1.133)	(0,08)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ (1.437)</b>	<b>(0,10)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.07.2018	\$ 1.600	\$ (2)	\$ (1)	0,00
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	1.500	(1)	0	0,00
						\$ (3)	\$ (1)	0,00

## DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens	
CBK	Call - OTC USD versus RUB	RUB 66,490	17.08.2018	\$ 4.050	\$ (37)	\$ (21)	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	66,550	17.08.2018	4.050	(39)	(21)	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	66,190	24.08.2018	2.900	(24)	(20)	0,00	
DUB	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,326	13.07.2018	£ 2.400	(15)	(25)	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	RUB 66,090	27.08.2018	\$ 2.900	(26)	(22)	0,00	
GLM	Call - OTC USD versus MXN	MXN 21,940	16.08.2018	4.000	(39)	(8)	0,00	
	Call - OTC USD versus MXN	21,920	21.08.2018	4.000	(40)	(9)	0,00	
HUS	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,332	12.07.2018	£ 3.326	(22)	(48)	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	RUB 65,962	24.08.2018	\$ 7.100	(61)	(52)	(0,01)	
JPM	Call - OTC USD versus MXN	MXN 21,200	05.07.2018	4.567	(39)	(1)	0,00	
	Call - OTC USD versus MXN	20,500	06.07.2018	8.000	(92)	(15)	0,00	
MSB	Call - OTC USD versus MXN	21,250	11.07.2018	1.133	(11)	(1)	0,00	
	Call - OTC USD versus MXN	21,850	17.08.2018	5.200	(53)	(12)	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	RUB 66,383	02.07.2018	5.600	(48)	0	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	66,600	09.07.2018	6.400	(60)	(2)	0,00	
WST	Put - OTC AUD versus USD	\$ 0,722	20.08.2018	AUD 18.200	(78)	(71)	(0,01)	
						\$ (684)	\$ (328)	(0,02)

## 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
CBK	Mexico Government International Bond	1,000 %	20.12.2018	\$ 3.400	\$ (3)	\$ 13	\$ 10	0,00
JPM	PSEG Power LLC	1,000	20.12.2018	3.500	22	(6)	16	0,00
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2018	3.000	(6)	15	9	0,00
					\$ 13	\$ 22	\$ 35	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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 Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07/2018	DKK 126.080	\$ 19.234	\$ 0	\$ (524)	\$ (524)	(0,04)
	07/2018	\$ 15.462	AUD 20.945	14	0	14	0,00
	08/2018	AUD 20.945	\$ 15.463	0	(14)	(14)	0,00
	08/2018	CAD 5.300	4.104	72	0	72	0,01
	08/2018	€ 6.213	7.671	386	0	386	0,03
	08/2018	¥ 21.431.000	196.664	2.684	0	2.684	0,19
	08/2018	SEK 431.490	49.814	1.427	0	1.427	0,10
	08/2018	\$ 8.942	€ 7.568	0	(78)	(78)	(0,01)
	08/2018	\$ 2.097	RUB 132.714	8	0	8	0,00
BPS	07/2018	ARS 344.684	\$ 13.272	1.411	0	1.411	0,10
	07/2018	BRL 11	3	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 9.546	ARS 262.050	0	(463)	(463)	(0,03)
	08/2018	€ 35.887	\$ 42.039	8	0	8	0,00
	08/2018	¥ 1.790.000	16.508	288	0	288	0,02
	08/2018	\$ 3.883	€ 3.323	9	0	9	0,00
	08/2018	\$ 1.796	£ 1.349	0	(12)	(12)	0,00
	09/2018	263	INR 17.994	0	(3)	(3)	0,00
BRC	07/2018	ARS 45.379	\$ 1.701	150	0	150	0,01
	08/2018	MXN 50.720	2.415	0	(143)	(143)	(0,01)
	08/2018	\$ 3.118	MXN 59.457	0	(119)	(119)	(0,01)
CBK	07/2018	CAD 6.000	\$ 4.641	80	0	80	0,01
	07/2018	DKK 85.212	13.117	0	(236)	(236)	(0,02)
	07/2018	¥ 3.410.000	31.921	1.094	0	1.094	0,08
	07/2018	RUB 178.546	2.823	0	(22)	(22)	0,00
	07/2018	\$ 7.622	CAD 9.967	1	(46)	(46)	0,00
	07/2018	18.669	£ 14.091	0	(65)	(65)	(0,01)
	07/2018	10.873	MXN 219.892	275	0	275	0,02
	08/2018	€ 7.106	\$ 8.439	116	0	116	0,01
	08/2018	¥ 570.000	5.236	76	0	76	0,01
	08/2018	MXN 107.220	5.363	0	(45)	(45)	0,00
	08/2018	\$ 20.956	€ 17.996	121	0	121	0,01
	08/2018	3.829	£ 2.888	0	(9)	(9)	0,00
DUB	07/2018	ARS 179.417	\$ 6.433	214	0	214	0,01
	07/2018	\$ 2.158	BRL 8.009	0	(76)	(76)	(0,01)
	08/2018	MXN 205.087	\$ 10.149	0	(195)	(195)	(0,01)
GLM	10/2018	DKK 53.830	8.709	213	0	213	0,01
	07/2018	AUD 20.945	15.745	270	0	270	0,02
	07/2018	BRL 15.995	4.201	44	0	44	0,00
	07/2018	CAD 4.713	3.638	55	0	55	0,00
	07/2018	RUB 11.970	187	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	\$ 2.115	BRL 7.998	0	(36)	(36)	0,00
	08/2018	€ 42.279	\$ 50.473	983	(28)	955	0,07
	08/2018	£ 162	214	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	¥ 889.300	8.061	9	0	9	0,00
	08/2018	MXN 52.469	2.631	0	(15)	(15)	0,00
	08/2018	\$ 2.080	BRL 7.998	0	(9)	(9)	0,00
	08/2018	10.696	€ 9.092	14	(61)	(47)	0,00
	08/2018	4.556	£ 3.407	0	(50)	(50)	0,00
	08/2018	7.027	¥ 772.300	0	(34)	(34)	0,00
	08/2018	1.286	RUB 81.507	6	0	6	0,00
HUS	07/2018	DKK 46.600	\$ 7.304	1	0	1	0,00
	07/2018	€ 3.400	4.132	162	0	162	0,01
	07/2018	RUB 938.229	14.678	0	(274)	(274)	(0,02)
	07/2018	\$ 7.304	DKK 46.600	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	578	€ 499	5	0	5	0,00
	07/2018	20.286	RUB 1.278.629	91	0	91	0,01
	08/2018	MXN 50.687	\$ 2.455	0	(102)	(102)	(0,01)
	08/2018	RUB 1.360.136	21.477	0	(97)	(97)	(0,01)
	08/2018	\$ 730	RUB 45.629	0	(6)	(6)	0,00
	03/2019	€ 4.400	\$ 5.623	379	0	379	0,03
JPM	07/2018	¥ 220.000	2.022	33	0	33	0,00
	07/2018	RUB 149.885	2.346	0	(43)	(43)	0,00
	07/2018	\$ 16.930	DKK 105.646	0	(375)	(375)	(0,03)
	07/2018	2.011	¥ 220.000	0	(21)	(21)	0,00
	07/2018	11.763	MXN 237.844	296	0	296	0,02
	08/2018	£ 29.991	\$ 40.736	1.065	0	1.065	0,07
	08/2018	¥ 7.840.300	71.767	771	0	771	0,05
	08/2018	SEK 42.870	4.906	98	0	98	0,01
	08/2018	\$ 26.553	¥ 2.915.500	0	(156)	(156)	(0,01)
	08/2018	480	ZAR 6.131	0	(35)	(35)	0,00
	12/2018	NGN 1.134.949	\$ 3.004	0	(73)	(73)	(0,01)
MSB	08/2018	¥ 310.000	2.811	3	0	3	0,00
	09/2018	THB 3.921	123	5	0	5	0,00
RBC	07/2018	CAD 12.000	9.254	132	0	132	0,01
	08/2018	\$ 74.319	SEK 645.200	0	(1.967)	(1.967)	(0,14)
RYL	08/2018	€ 1.400	\$ 1.729	87	0	87	0,01
SCX	08/2018	1.200	1.509	105	0	105	0,01
	08/2018	£ 301	401	3	0	3	0,00
	08/2018	\$ 22.229	€ 18.917	0	(73)	(73)	(0,01)
SSB	08/2018	37.334	¥ 4.071.900	0	(466)	(466)	(0,03)
UAG	07/2018	£ 14.091	\$ 18.632	28	0	28	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	08/2018	¥ 550.000	\$ 5.066	\$ 85	\$ 0	\$ 85	0,01
	08/2018	\$ 18.659	£ 14.091	0	(29)	(29)	0,00
	08/2018	17.581	RUB 1.104.417	0	(63)	(63)	(0,01)
	08/2018	2.126	SEK 18.550	0	(46)	(46)	0,00
	04/2019	€ 3.300	\$ 4.159	215	0	215	0,01
				\$ 13.592	\$ (6.115)	\$ 7.477	0,53

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional AUD (Hedged) Class 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	07/2018	AUD 17	\$ 13	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2018	\$ 13	AUD 17	0	0	0	0,00
BOA	07/2018	AUD 1	\$ 0	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 0	AUD 1	0	0	0	0,00
GLM	07/2018	AUD 18	\$ 14	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 13	AUD 17	0	0	0	0,00
	08/2018	0	1	0	0	0	0,00
JPM	07/2018	AUD 16	\$ 12	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 13	AUD 17	0	0	0	0,00
RBC	07/2018	0	0	0	0	0	0,00
TOR	07/2018	AUD 0	\$ 0	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class R EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 78.974	€ 67.278	\$ 0	\$ (423)	\$ (423)	(0,03)
BPS	07/2018	29.945	25.818	199	0	199	0,01
BRC	07/2018	€ 78	\$ 92	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 87	€ 75	1	0	1	0,00
CBK	07/2018	€ 8.245	\$ 9.560	17	(84)	(67)	0,00
	07/2018	\$ 1.622	€ 1.378	0	(13)	(13)	0,00
GLM	07/2018	€ 3.241	\$ 3.787	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 164	€ 142	1	0	1	0,00
MSB	07/2018	€ 86.605	\$ 100.029	0	(1.087)	(1.087)	(0,08)
	08/2018	\$ 100.250	€ 86.605	1.087	0	1.087	0,08
RBC	07/2018	€ 113	\$ 131	0	(1)	(1)	0,00
RYL	07/2018	2.097	2.459	11	(1)	10	0,00
SCX	07/2018	848	996	7	(1)	6	0,00
	07/2018	\$ 103.629	€ 89.454	813	0	813	0,06
SSB	07/2018	€ 86.186	\$ 100.329	0	(297)	(297)	(0,02)
	07/2018	\$ 104.232	€ 89.573	349	0	349	0,02
	08/2018	100.552	86.186	293	0	293	0,02
				\$ 2.781	\$ (1.907)	\$ 874	0,06

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) 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	07/2018	£ 36	\$ 48	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07/2018	\$ 1.705	£ 1.296	5	0	5	0,00
BOA	07/2018	5.940	4.448	0	(67)	(67)	(0,01)
BPS	07/2018	£ 14	\$ 18	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 411	£ 312	1	0	1	0,00
BRC	07/2018	£ 5.005	\$ 6.545	0	(63)	(63)	0,00
	07/2018	\$ 262	£ 198	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	6.551	5.003	63	0	63	0,00
CBK	07/2018	£ 10	\$ 13	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 5.985	£ 4.517	0	(21)	(21)	0,00
GLM	07/2018	£ 61	\$ 82	1	0	1	0,00
SCX	07/2018	63	84	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 5.964	£ 4.486	0	(41)	(41)	0,00
SSB	07/2018	£ 136	\$ 183	3	0	3	0,00
UAG	07/2018	4.971	6.572	10	0	10	0,00
	08/2018	\$ 6.582	£ 4.971	0	(10)	(10)	0,00
				\$ 85	\$ (203)	\$ (118)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional ILS (Hedged) Class 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	08/2018	\$ 49	ILS 174	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
JPM	08/2018	48	171	0	(1)	(1)	0,00
SOG	08/2018	48	173	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional NOK (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 1.700	NOK 13.856	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
CBK	06/2018	1.757	13.962	0	(51)	(51)	(0,01)
FBF	06/2018	1.753	13.977	0	(45)	(45)	0,00
HUS	06/2018	NOK 13.976	\$ 1.705	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	\$ 1.707	NOK 13.976	3	0	3	0,00
MSB	06/2018	1.749	13.977	0	(41)	(41)	0,00
SCX	06/2018	NOK 14.024	\$ 1.702	0	(12)	(12)	0,00
	07/2018	\$ 1.698	NOK 13.976	13	0	13	0,00
				\$ 16	\$ (157)	\$ (141)	(0,01)
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ 7.795</b>	<b>0,55</b>

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Barclays Bank PLC 1,940 % fällig am 04.09.2018	\$ 2.500	\$ 2.499	0,18
Credit Suisse AG 2,722 % fällig am 28.09.2018	5.200	5.205	0,36
<b>Summe Einlagenzertifikate</b>		<b>\$ 7.704</b>	<b>0,54</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 1.980.410</b>	<b>138,66</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (552.127)</b>	<b>(38,66)</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 1.428.283</b>	<b>100,00</b>

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

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

(a) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Reines Kapitalwertpapier.

(c) Wertpapier per Emissionstermin.

(d) Nullkuponwertpapier.

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 119.373 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 11.357 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 3.800 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(h) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 3.282	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.01.2022	\$ (3.348)	\$ 3.282	\$ 3.282	0,23
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (3.348)</b>	<b>\$ 3.282</b>	<b>\$ 3.282</b>	<b>0,23</b>

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

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

## Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 139.087	\$ 1.819.773	\$ 9.604	\$ 1.968.464
Einlagen bei Kreditinstituten	0	7.704	0	7.704
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(2.117)	6.359	0	4.242
<b>Summen</b>	<b>\$ 136.970</b>	<b>\$ 1.833.836</b>	<b>\$ 9.604</b>	<b>\$ 1.980.410</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 168.544	\$ 1.772.986	\$ 0	\$ 1.941.530
Einlagen bei Kreditinstituten	0	21.020	0	21.020
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(902)	(25.103)	0	(26.005)
<b>Summen</b>	<b>\$ 167.642</b>	<b>\$ 1.768.903</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 1.936.545</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 der Wertpapieranlagen.

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	2,200 %	26.06.2018	26.07.2018	\$ (7.890)	\$ (7.892)	(0,55)
	2,220	26.06.2018	26.07.2018	(2.092)	(2.093)	(0,15)
	2,230	25.06.2018	25.07.2018	(10.857)	(10.861)	(0,76)
	2,330	25.06.2018	25.07.2018	(14.208)	(14.213)	(1,00)
IND	2,010	09.05.2018	09.07.2018	(23.777)	(23.847)	(1,67)
	2,030	10.05.2018	10.07.2018	(13.472)	(13.512)	(0,95)
SCX	2,410	25.06.2018	25.07.2018	(41.617)	(41.634)	(2,91)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (114.052)</b>	<b>(7,99)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 6	\$ 0	\$ 6
BOA	3.479	(3.000)	479
BPS	1.437	(1.150)	287
BRC	(111)	270	159
CBK	1.136	(830)	306
DUB	109	(710)	(601)
FBF	(45)	0	(45)
GLM	1.131	(3.090)	(1.959)
HUS	57	(310)	(253)
JPM	1.559	(1.710)	(151)
MSB	(48)	0	(48)
MYC	9	0	9
RBC	(1.836)	2.370	534
RYL	97	(20)	77
SCX	815	220	1.035
SOG	(1)	0	(1)
SSB	(118)	940	822
UAG	190	0	190
WST	(71)	0	(71)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	48,89	49,80
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	70,41	52,54
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	18,52	9,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,15)	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,10)	0,07
Freiverkehrsfinanzderivate	0,55	(1,52)
Einlagenzertifikate	0,54	1,21
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(7,99)	0,00

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Average Duration Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 06.08.2018	¥ 14.010.000	127.437	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.04.2018	BRL 120.100	36.294
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 07.05.2018	13.690.000	125.546	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	¥ 3.740.000	35.665
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 27.08.2018	5.170.000	47.262	Nordea Hypotek AB 2,250 % fällig am 19.06.2019	SEK 198.400	25.174
U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.05.2020	\$ 41.500	40.623	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,350 % fällig am 15.06.2020	€ 13.200	14.851
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	¥ 3.740.000	33.042	Sveriges Sakerställda Obligationer AB 4,000 % fällig am 18.09.2019	SEK 80.000	10.509
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 23.07.2018	3.410.000	31.778	Swedbank Hypotek AB 3,750 % fällig am 19.06.2019	80.200	10.351
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 23.04.2018	3.410.000	30.745	Towers CQ SRL 0,627 % fällig am 28.12.2033	€ 8.378	9.770
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.06.2018	3.270.000	30.558	Intesa Sanpaolo SpA 3,875 % fällig am 15.01.2019	\$ 9.700	9.713
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 28.05.2018	2.450.000	22.929	Bank Nederlandse Gemeenten NV 2,125 % fällig am 14.12.2020	6.700	6.601
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % fällig am 15.05.2018	€ 18.400	22.395	Cisco Systems Inc 1,600 % fällig am 28.02.2019	5.827	5.792
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2018	¥ 13.800	17.189	Toyota Motor Credit Corp 2,622 % fällig am 13.04.2021	4.300	4.301
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,350 % fällig am 15.06.2020	€ 13.200	15.333	QUALCOMM, Inc. 3,000 % fällig am 20.05.2022	3.500	3.477
Spain Government Bond 4,000 % fällig am 30.04.2020	8.900	11.184	Chevron Corp 1,790 % fällig am 16.11.2018	3.100	3.091
QNB Finance Ltd 3,705 % fällig am 12.02.2020	\$ 9.900	9.900	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.07.2018	¥ 220.000	2.002
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.05.2018	¥ 1.040.000	9.588	UnitedHealth Group, Inc. 1,900 % fällig am 16.07.2018	\$ 1.300	1.299
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	990.000	9.203	Cyprus Government International Bond 3,875 % fällig am 06.05.2022	€ 700	907
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.08.2018	990.000	8.947	Argentina Treasury Bills 0,000 % fällig am 19.09.2018	ARS 16.800	738
Greece Treasury Bills 0,000 % fällig am 31.08.2018	7.300	8.848	Imperial Brands Finance PLC 2,950 % fällig am 21.07.2020	\$ 700	705
Intesa Sanpaolo SpA 3,875 % fällig am 15.01.2019	\$ 8.500	8.586	Fannie Mae 5,000 % fällig am 01.10.2023	94	100

(a) Der Low Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

30. Juni 2018

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>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>Barclays Bank PLC</b>				<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>			
				7,625 % fällig am 21.11.2022 (f)	\$ 1.200	\$ 1.294	0,23	0,129 % fällig am 16.12.2020	€ 2.400	\$ 2.802	0,50
				10,179 % fällig am 12.06.2021	1.000	1.155	0,21	0,672 % fällig am 27.07.2021	600	712	0,13
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>Barclays PLC</b>				<b>Groupe Bruxelles Lambert S.A.</b>			
<b>Altran Technologies S.A.</b>				2,375 % fällig am 06.10.2023				5,750 % fällig am 24.01.2022			
2,750 % fällig am 20.03.2025	€ 1.321	\$ 1.534	0,27	3,200 % fällig am 10.08.2021	£ 500	490	0,09	1,875 % fällig am 19.06.2025	€ 1.700	1.994	0,36
<b>Dell, Inc.</b>				<b>BGC Partners, Inc.</b>				<b>Grupo Aval Ltd.</b>			
4,100 % fällig am 07.09.2023	\$ 172	171	0,03	5,125 % fällig am 27.05.2021	1.100	1.122	0,20	4,750 % fällig am 26.09.2022	\$ 700	696	0,12
<b>Delos Finance SARL</b>				<b>BOC Aviation Ltd.</b>				<b>HSBC Holdings PLC</b>			
4,084 % fällig am 06.10.2023	600	601	0,11	5,375 % fällig am 09.12.2019	100	102	0,02	2,926 % fällig am 18.05.2021	3.000	3.005	0,54
<b>FinCo LLC</b>				<b>Cantor Fitzgerald LP</b>				<b>HSBC USA, Inc.</b>			
4,094 % fällig am 27.12.2022	257	258	0,05	6,500 % fällig am 17.06.2022	850	903	0,16	3,950 % fällig am 18.05.2024	3.000	2.991	0,54
<b>HCA, Inc.</b>				<b>Caterpillar Financial Services Corp.</b>				<b>ICICI Bank Ltd.</b>			
4,094 % fällig am 13.03.2025	120	120	0,02	7,875 % fällig am 15.10.2019	4.000	4.184	0,75	2,250 % fällig am 23.06.2019	100	99	0,02
<b>Las Vegas Sands, LLC</b>				<b>Cboe Global Markets, Inc.</b>				<b>Industrial &amp; Commercial Bank of China Ltd.</b>			
3,844 % fällig am 27.03.2025	292	291	0,05	2,510 % fällig am 15.05.2020	2.900	2.902	0,52	0,221 % fällig am 12.10.2020	€ 2.000	2.337	0,42
<b>Ortho-Clinical Diagnostics S.A.</b>				<b>Cetin Finance BV</b>				<b>ING Bank NV</b>			
5,336 % fällig am 30.06.2025	97	97	0,02	1,950 % fällig am 28.06.2019	2.100	2.081	0,37	2,450 % fällig am 16.03.2020	\$ 300	296	0,05
<b>RPI Finance Trust</b>				<b>CIT Group, Inc.</b>				<b>International Lease Finance Corp.</b>			
4,334 % fällig am 27.03.2023	97	97	0,02	4,23 % fällig am 06.12.2021	€ 1.200	1.443	0,26	5,800 % fällig am 25.09.2023	700	743	0,13
		3.169	0,57	<b>Citigroup, Inc.</b>				<b>Jefferies Finance LLC</b>			
				3,875 % fällig am 19.02.2019				6,875 % fällig am 15.04.2022			
				<b>Commonwealth Bank of Australia</b>				7,375 % fällig am 01.04.2020			
				2,650 % fällig am 26.10.2020				3,750 % fällig am 12.01.2023			
				3,309 % fällig am 24.07.2023				6,875 % fällig am 29.03.2021			
				<b>CNP Assurances</b>				<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>			
				7,500 % fällig am 18.10.2018				2,550 % fällig am 29.10.2020			
				(d)(f)				2,877 % fällig am 09.03.2021			
				<b>Cooperatieve Rabobank UA</b>				2,980 % fällig am 01.06.2021			
				2,250 % fällig am 14.01.2020				<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>			
				6,875 % fällig am 19.03.2020 (f)				2,925 % fällig am 23.09.2019			
				<b>Credit Agricole S.A.</b>				<b>Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.</b>			
				8,125 % fällig am 19.09.2033 (f)				3,950 % fällig am 30.06.2022			
				<b>Credit Suisse Group AG</b>				<b>KSA Sukuk Ltd.</b>			
				2,997 % fällig am 14.12.2023				2,894 % fällig am 20.04.2022			
				3,574 % fällig am 09.01.2023				<b>LeasePlan Corp. NV</b>			
				<b>Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.</b>				2,875 % fällig am 22.01.2019			
				2,750 % fällig am 26.03.2020				<b>Lincoln Finance Ltd.</b>			
				3,125 % fällig am 10.12.2020				6,875 % fällig am 15.04.2021			
				3,800 % fällig am 15.09.2022				<b>Lloyds Bank PLC</b>			
				3,800 % fällig am 09.06.2023				2,853 % fällig am 07.05.2021			
				<b>Crown Castle International Corp.</b>				<b>Lloyds Banking Group PLC</b>			
				3,400 % fällig am 15.02.2021				2,907 % fällig am 07.11.2023			
				<b>Danske Bank A/S</b>				<b>LoanCore Capital Markets LLC</b>			
				3,386 % fällig am 12.09.2023				6,875 % fällig am 01.06.2020			
				<b>DBS Group Holdings Ltd.</b>				<b>Metropolitan Life Global Funding</b>			
				2,811 % fällig am 08.06.2020				2,050 % fällig am 12.06.2020			
				<b>Deutsche Bank AG</b>				<b>Mitsubishi UFJ Trust &amp; Banking Corp.</b>			
				1,750 % fällig am 16.12.2021				2,650 % fällig am 19.10.2020			
				2,850 % fällig am 10.05.2019				<b>Mizuho Bank Ltd.</b>			
				3,150 % fällig am 22.01.2021				2,450 % fällig am 16.04.2019			
				3,300 % fällig am 16.11.2022				<b>MUFU Americas Holdings Corp.</b>			
				3,312 % fällig am 13.07.2020				2,250 % fällig am 10.02.2020			
				4,250 % fällig am 14.10.2021				<b>MUFU Bank Ltd</b>			
				<b>Digital Realty Trust LP</b>				2,350 % fällig am 08.09.2019			
				3,400 % fällig am 01.10.2020				<b>MUFU Bank Ltd.</b>			
				<b>ERP Operating LP</b>				3,200 % fällig am 26.02.2023			
				2,375 % fällig am 01.07.2019				<b>MUFU Union Bank N.A.</b>			
				<b>Fastighets AB Balder</b>				2,625 % fällig am 26.09.2018			
				1,125 % fällig am 14.03.2022				<b>Multibank, Inc.</b>			
				<b>Flagstar Bancorp, Inc.</b>				4,375 % fällig am 09.11.2022			
				6,125 % fällig am 15.07.2021				<b>Nasdaq, Inc.</b>			
				<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>				2,722 % fällig am 22.03.2019			
				2,793 % fällig am 02.11.2020				<b>National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.</b>			
				2,835 % fällig am 05.04.2021				10,375 % fällig am 01.11.2018			
				3,185 % fällig am 12.08.2019				<b>Natwest Markets PLC</b>			
				<b>Fortress Transportation &amp; Infrastructure Investors LLC</b>				0,079 % fällig am 02.03.2020			
				6,750 % fällig am 15.03.2022				<b>Navient Corp.</b>			
				<b>Franshion Brilliant Ltd.</b>				4,875 % fällig am 17.06.2019			
				5,750 % fällig am 19.03.2019				5,500 % fällig am 15.01.2019			
				<b>GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.</b>				5,875 % fällig am 25.03.2021			
				2,342 % fällig am 15.11.2020				25			
				<b>General Motors Financial Co., Inc.</b>				25			
				3,582 % fällig am 04.10.2019				0,00			
				4,408 % fällig am 15.01.2019				0,00			





# Aufstellung der Wertpapiieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit 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
<b>BESCHREIBUNG</b>											
Petrobras Global Finance BV 8,375 % fällig am 10.12.2018	\$ 2.700	\$ 2.757	0,49	Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social 4,000 % fällig am 14.04.2019	\$ 500	\$ 502	0,09	15,151 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	NGN 53.000	\$ 143	0,03
Petronas Global Sukuk Ltd. 2,707 % fällig am 18.03.2020	500	495	0,09	Canada Government International Bond 0,750 % fällig am 01.09.2020	CAD 1.400	1.037	0,19	15,380 % fällig am 20.09.2018 (a)(b)	18.000	49	0,01
Plains All American Pipeline LP 2,600 % fällig am 15.12.2019	1.900	1.881	0,34	1,750 % fällig am 01.03.2019	45	34	0,01	15,400 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	18.000	48	0,01
Progress Energy, Inc. 4,875 % fällig am 01.05.2021	1.300	1.353	0,24	Export-Import Bank of India 3,875 % fällig am 02.10.2019	\$ 400	403	0,07	15,448 % fällig am 20.09.2018 (a)(b)	18.000	49	0,01
7,500 % fällig am 15.03.2020	1.100	1.136	0,20	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,700 % fällig am 15.09.2018 (c)	€ 104	122	0,02	15,450 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	23.000	62	0,01
PPL WEM Ltd. 5,375 % fällig am 01.05.2021	1.300	1.353	0,24	2,100 % fällig am 15.09.2021 (c)	167	208	0,04	15,498 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	30.000	81	0,01
7,250 % fällig am 15.12.2019	1.100	1.127	0,20	Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd. 2,875 % fällig am 02.10.2018	\$ 1.400	1.399	0,25	15,501 % fällig am 29.11.2018 (a)(b)	30.900	81	0,01
7,050 % fällig am 04.05.2020	100	103	0,02	Korea National Oil Corp. 4,250 % fällig am 08.10.2019	AUD 2.130	1.595	0,29	15,504 % fällig am 29.11.2018 (a)(b)	23.700	62	0,01
Sprint Capital Corp. 6,900 % fällig am 01.05.2019	800	818	0,15	Province of Alberta 1,000 % fällig am 15.11.2021	£ 100	131	0,02	15,566 % fällig am 29.11.2018 (a)(b)	8.300	22	0,00
Sprint Communications, Inc. 7,000 % fällig am 15.08.2020	100	104	0,02	Province of Ontario 4,000 % fällig am 02.06.2021	CAD 2.600	2.071	0,37	15,603 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	30.000	81	0,01
Sprint Corp. 7,125 % fällig am 15.06.2024	25	25	0,00	Qatar Government International Bond 3,875 % fällig am 23.04.2023	\$ 4.300	4.305	0,77	15,683 % fällig am 11.10.2018 (a)(b)	10.000	27	0,01
7,250 % fällig am 15.09.2021	1.100	1.147	0,21	Saudi Government International Bond 2,875 % fällig am 04.03.2023	2.400	2.312	0,41	15,699 % fällig am 22.11.2018 (a)(b)	35.900	95	0,02
State Grid Overseas Investment Ltd. 2,250 % fällig am 04.05.2020	300	294	0,05	United Kingdom Gilt 2,000 % fällig am 22.07.2020	£ 1.000	1.355	0,24	15,777 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	50.000	135	0,02
3,750 % fällig am 02.05.2023	1.300	1.303	0,23					16,147 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	30.000	81	0,01
		48.542	8,70					19,005 % fällig am 09.08.2018 (a)(b)	30.000	82	0,02
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		483.253	86,58			20.390	3,65	24,941 % fällig am 19.07.2018 (a)(b)	30.000	83	0,02
									1.606	0,29	
								Summe kurzfristige Instrumente	9.707	1,74	
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>AKTIEN</b>				<b>AKTIEN</b>			
<b>Fannie Mae, TBA</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>				<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
3,000 % fällig am 01.07.2048	600	581	0,10	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c.	5.163	59	0,01	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	8.038	80	0,02
3,500 % fällig am 01.07.2048	2.400	2.389	0,43	- PIMCO China Bond Fund (e)				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt	\$ 656.085	117,55	
		2.970	0,53								
<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>AKTIEN</b>			
<b>U.S. Treasury Notes</b>				<b>PENSIONSGESCHÄFTE (I)</b>							
1,000 % fällig am 30.11.2018 (g)	12.800	12.744	2,28		547	0,10					
1,250 % fällig am 31.03.2019 (g)(h)(i)	54.500	54.091	9,69	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>							
1,500 % fällig am 31.12.2018 (g)	6.000	5.980	1,07	<b>Nigeria Open Market Operation Bills</b>							
2,500 % fällig am 31.05.2020 (g)(h)(i)	46.900	46.883	8,40	11,180 % fällig am 13.12.2018	NGN 55.826	146	0,03				
2,625 % fällig am 15.05.2021 (h)(i)	12.800	12.802	2,30	15,190 % fällig am 23.08.2018	38.000	103	0,02				
		132.500	23,74	15,302 % fällig am 06.09.2018	53.000	143	0,03				
				15,398 % fällig am 06.09.2018	30.000	81	0,01				
				15,696 % fällig am 08.11.2018	8.400	22	0,00				
				15,703 % fällig am 25.10.2018	39.000	104	0,02				
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				15,716 % fällig am 08.11.2018	5.900	16	0,00				
<b>GSR Mortgage Loan Trust</b>				<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>							
3,678 % fällig am 25.09.2035	8	8	0,00	2,549 % fällig am 28.11.2018	\$ 3.700	3.686	0,66				
<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>						4.301	0,77				
3,757 % fällig am 25.11.2034	26	26	0,01	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>							
6,378 % fällig am 25.09.2034	976	1.073	0,19	(2,723) % fällig am 12.10.2018 (a)(b)	ARS 110	4	0,00				
<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>				(0,978) % fällig am 12.10.2018 (a)(b)		700	25	0,01			
2,145 % fällig am 25.01.2047	377	367	0,07	(0,500) % fällig am 14.09.2018 (a)(b)		22.000	800	0,14			
3,648 % fällig am 25.01.2033	10	10	0,00	25,350 % fällig am 14.09.2018 (a)(b)		6.000	192	0,03			
		1.484	0,27	25,500 % fällig am 14.09.2018 (a)(b)		18.000	577	0,10			
				25,601 % fällig am 14.09.2018 (a)(b)		6.500	208	0,04			
								1.806	0,32		
				<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>							
				11,767 % fällig am 25.09.2018 (a)(b)	EGP 27.000	1.447	0,26				
				<b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>							
				11,724 % fällig am 01.11.2018 (a)(b)	NGN 79.700	211	0,04				
				15,056 % fällig am 29.11.2018 (a)(b)		32.900	87	0,02			
				15,104 % fällig am 06.12.2018 (a)(b)		48.100	127	0,02			

## 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	09/2018	450	\$ 185	0,03
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09/2018	197	(22)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	215	40	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	99	64	0,01
				<u>\$ 267</u>	<u>0,05</u>

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 117,500	27.07.2018	121	\$ (21)	\$ (2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	120,500	27.07.2018	121	(30)	(40)	(0,01)
				<u>\$ (51)</u>	<u>\$ (42)</u>	<u>(0,01)</u>
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					<u>\$ 225</u>	<u>0,04</u>

## 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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Constellation Energy Group, Inc.	(1,000) %	20.12.2020	\$ 450	\$ 4	0,00
Dow Chemical Co.	(1,000)	20.12.2020	100	(1)	0,00
Kinder Morgan Energy Partners LP	(1,000)	20.03.2019	100	0	0,00
				<u>\$ 3</u>	<u>0,00</u>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000 %	20.12.2022	\$ 2.900	\$ 1	0,00
Carrefour	1,000	20.06.2023	€ 00	0	0,00
Daimler AG	1,000	20.12.2020	500	0	0,00
Deutsche Bank AG	1,000	20.06.2019	400	1	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2021	\$ 900	48	0,01
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.06.2022	200	8	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2021	400	2	0,00
Prudential Financial, Inc.	1,000	20.12.2020	200	2	0,00
Prudential Financial, Inc.	1,000	20.06.2021	600	7	0,00
Sherwin Williams Co.	1,000	20.06.2022	700	1	0,00
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.12.2022	1.600	(8)	0,00
Simon Property Group LP	1,000	20.06.2022	1.500	34	0,01
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2019	1.600	(5)	0,00
				<u>\$ 91</u>	<u>0,02</u>

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2022	€ 13.400	\$ 161	0,03

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,035 %	02.01.2020	BRL 52.300	\$ (202)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,500	02.01.2020	86.000	(197)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,033	04.01.2021	16.000	(88)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.06.2027	\$ 2.250	28	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	€ 200	(5)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	£ 3.200	(32)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	HUF 1.604.100	(260)	(0,05)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,380	18.06.2028	¥ 350.000	(34)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,399	18.06.2028	350.000	(34)	(0,01)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,610 %	07.07.2021	MXN 6.300	\$ (24)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,738	25.04.2023	10.300	(46)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,740	24.04.2023	26.700	(119)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,615	27.02.2023	129.600	(71)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,635	28.02.2023	27.800	(14)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,730	25.02.2027	14.600	(49)	(0,01)
					\$ (1.147)	(0,21)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (892)</b>	<b>(0,16)</b>

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* 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	Kosten	Marktwert	% des Nettvermögens
BOA	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,940 %	18.02.2020	\$ 13.650	\$ 100	\$ 83	0,01
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,000	27.11.2018	37.200	91	3	0,00
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,000	04.12.2018	9.000	19	1	0,00
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,258	18.09.2019	1.700	52	57	0,01
							\$ 262	\$ 144	0,02

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens	
BOA	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,700 %	18.07.2018	\$ 2.600	\$ (3)	\$ (1)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	4.400	(5)	(1)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,700	15.08.2018	500	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.08.2018	1.700	(2)	(1)	0,00	
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	2.900	(3)	(1)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	2.300	(2)	(1)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	3.700	(4)	(4)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	1,000	15.08.2018	€ 3.300	(6)	(3)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Kauf	0,500	19.09.2018	18.700	(19)	(1)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	18.700	(55)	(70)	(0,02)	
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 700	(1)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 3.400	(7)	(9)	0,00	
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.07.2018	\$ 2.400	(3)	(1)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	1.000	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.08.2018	4.600	(5)	(4)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	1.100	(1)	(1)	0,00	
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	€ 3.500	(9)	(13)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	3.400	(7)	(9)	0,00	
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 1.600	(3)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	€ 1.400	(3)	(3)	0,00	
GST	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.07.2018	\$ 2.400	(3)	(1)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	€ 1.300	(3)	(3)	0,00	
JPM	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	\$ 600	(1)	0	0,00	
MEI	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 4.000	(8)	(10)	0,00	
							\$ (155)	\$ (138)	(0,02)

### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
BOA	Call - OTC USD versus BRL	BRL 3,700	12.07.2018	\$ 5.523	\$ (49)	\$ (227)	(0,04)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,086 %	18.02.2020	\$ 1.300	\$ (100)	\$ (96)	(0,02)
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180	27.11.2018	2.600	(24)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,200	27.11.2018	2.600	(33)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,210	27.11.2018	2.600	(34)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,173	04.12.2018	1.900	(19)	(1)	0,00
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,940	18.09.2019	7.300	(52)	(107)	(0,02)
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,770	02.07.2018	2.800	(3)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,010	02.07.2018	2.800	(3)	0	0,00
							\$ (268)	\$ (209)	(0,04)

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
CBK	Argentine Republic Government International Bond	5,000 %	20.06.2022	\$ 500	\$ 44	\$ (29)	\$ 15	0,00
GST	Petroleos Mexicanos	1,000	20.09.2020	100	(5)	4	(1)	0,00
HUS	China Government International Bond	1,000	20.09.2020	0	0	0	0	0,00
	China Government International Bond	1,000	20.06.2021	0	0	0	0	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.300	(11)	(8)	(19)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2022	300	(27)	6	(21)	0,00
JPM	AP Moller - Maersk	1,000	20.06.2022	€ 500	(3)	7	4	0,00
	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC	1,000	20.06.2022	2.800	23	53	76	0,01
UAG	Park Aerospace Holdings Ltd.	5,000	01.07.2020	\$ 300	18	(6)	12	0,00
					\$ 39	\$ 27	\$ 66	0,01

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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
FBF	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,280 %	14.11.2021	CLP 4.436.700	\$ 0	\$ (66)	\$ (66)	(0,01)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07/2018	€	200	\$	234	\$ 1	0,00
	07/2018	\$	7.899	AUD	10.700	7	0,00
	07/2018		141	PLN	486	0	(11)
	08/2018	AUD	10.700	\$	7.899	0	(7)
	09/2018	SGD	1.658		1.249	31	0
	01/2019	\$	38	EGP	712	0	(1)
BPS	07/2018	ARS	44.514	\$	1.612	84	0,01
	07/2018	BRL	8.297		2.189	33	0,01
	07/2018	€	36.697		42.563	0	(282)
	07/2018	\$	1.533	ARS	42.090	0	(74)
	08/2018	HUF	36.648	\$	141	11	0,00
	09/2018	ARS	14.083		479	27	0,00
BRC	07/2018		44.396		1.664	146	0,03
	08/2018	\$	5.602	MXN	106.833	0	(213)
	07/2018	£	13.618	\$	18.042	63	0,01
CBK	07/2018	\$	49	MXN	996	1	0,00
	07/2018		3.280	RUB	207.424	26	0,00
	08/2018	MXN	7.093	\$	347	0	(11)
	08/2018	RUB	93.418		1.447	0	(35)
	11/2018	NGN	7.959		21	0	(1)
	07/2018	ARS	42.090		1.509	50	0,01
DUB	07/2018	BRL	545		144	2	0,00
	07/2018	TRY	17.892		3.628	0	(248)
	07/2018	BRL	528		139	2	0,00
FBF	08/2018	MXN	16.781		837	0	(9)
	09/2018	INR	87.210		1.256	0	(4)
	07/2018	AUD	10.700		8.044	138	0,02
GLM	07/2018	COP	4.392.082		1.573	78	0,01
	07/2018	€	1.618		1.883	4	(10)
	07/2018	¥	12.100		111	1	0,00
	07/2018	\$	1.560	COP	4.495.059	0	(31)
	07/2018		1.957	€	1.666	0	(11)
	07/2018		3.621	£	2.715	0	(36)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
HUS	08/2018	NZD 2.095	\$ 1.456	\$ 38	\$ 0	\$ 38	0,01
	07/2018	BRL 7.061	1.872	37	0	37	0,01
	07/2018	RUB 207.424	3.291	0	(15)	(15)	0,00
	07/2018	\$ 1.092	BRL 4.068	0	(35)	(35)	(0,01)
	07/2018	353	€ 303	0	0	0	0,00
	08/2018	HUF 49.821	\$ 184	7	0	7	0,00
	08/2018	\$ 4.421	RUB 279.005	15	(10)	5	0,00
	10/2018	NGN 46.975	\$ 125	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	CAD 4.118	3.178	47	0	47	0,01
	07/2018	COP 103.452	37	2	0	2	0,00
JPM	07/2018	€ 227	267	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 53	MXN 1.077	1	0	1	0,00
	08/2018	NGN 65.839	\$ 172	0	(9)	(9)	0,00
	08/2018	\$ 1.438	NZD 2.086	0	(25)	(25)	(0,01)
	10/2018	NGN 182.124	\$ 483	0	(15)	(15)	0,00
	11/2018	114.983	306	0	(6)	(6)	0,00
	12/2018	46.394	123	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	\$ 3.281	BRL 12.363	0	(68)	(68)	(0,01)
	08/2018	BRL 12.363	\$ 3.272	70	0	70	0,01
	07/2018	NGN 28.027	73	0	(5)	(5)	0,00
SCX	08/2018	\$ 5.727	TRY 25.579	0	(246)	(246)	(0,04)
	09/2018	NGN 112.851	\$ 299	0	(10)	(10)	0,00
	10/2018	37.955	100	0	(4)	(4)	0,00
	11/2018	13.385	36	0	(1)	(1)	0,00
	01/2019	\$ 24	EGP 449	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	€ 42.842	€ 36.803	127	0	127	0,02
	08/2018	€ 36.803	\$ 42.937	0	(125)	(125)	(0,02)
UAG	07/2018	\$ 14.417	£ 10.903	0	(22)	(22)	0,00
	08/2018	£ 10.903	\$ 14.437	23	0	23	0,00
	09/2018	\$ 1.278	INR 87.553	0	(13)	(13)	0,00
				\$ 1.074	\$ (1.599)	\$ (525)	(0,09)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CHF (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 324	CHF 319	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
CBK	07/2018	324	321	0	(2)	(2)	0,00
GLM	07/2018	CHF 321	\$ 321	1	(2)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 323	CHF 320	0	(1)	(1)	0,00
JPM	08/2018	320	319	2	0	2	0,00
	07/2018	CHF 319	\$ 322	1	0	1	0,00
	08/2018	\$ 322	CHF 319	0	(1)	(1)	0,00
SSB	07/2018	CHF 1	\$ 1	0	0	0	0,00
				\$ 4	\$ (9)	\$ (5)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutionell EUR (Hegend) Class und Class E EUR (Hegend) 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	07/2018	\$ 152.583	€ 129.986	\$ 0	\$ (818)	\$ (818)	(0,15)
BRC	07/2018	€ 79	\$ 92	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 24	€ 20	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	€ 625	\$ 739	9	0	9	0,00
	07/2018	543	€ 641	7	0	7	0,00
GLM	07/2018	\$ 27	€ 24	0	0	0	0,00
	07/2018	€ 120.609	\$ 139.303	0	(1.514)	(1.514)	(0,27)
MSB	08/2018	\$ 139.610	€ 120.609	1.513	0	1.513	0,27
	07/2018	€ 3.270	\$ 3.809	0	(9)	(9)	0,00
RBC	07/2018	968	€ 1.133	3	0	3	0,00
SCX	07/2018	93	€ 109	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 150.590	€ 129.992	1.183	0	1.183	0,21
SSB	07/2018	€ 120.601	\$ 140.391	0	(416)	(416)	(0,07)
	07/2018	\$ 151.244	€ 129.973	506	0	506	0,09
	08/2018	140.703	€ 120.601	410	0	410	0,07
UAG	07/2018	€ 21.797	\$ 25.455	6	0	6	0,00
				\$ 3.637	\$ (2.758)	\$ 879	0,15

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 285	£ 213	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
BRC	07/2018	£ 212	\$ 278	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	\$ 278	£ 212	3	0	3	0,00
CBK	07/2018	£ 282	\$ 213	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07/2018	\$ 1	£ 1	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	£ 284	\$ 213	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07/2018	\$ 212	£ 281	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 281	£ 212	0	0	0	0,00
				\$ 3	\$ (9)	\$ (6)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional NOK (Hedged) Class 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	07/2018	NOK 184.006	\$ 22.421	\$ 0	\$ (155)	\$ (155)	(0,03)
	07/2018	\$ 22.558	NOK 183.864	1	0	1	0,00
	08/2018	22.448	184.006	155	0	155	0,03
MSB	07/2018	22.565	184.775	106	0	106	0,02
SCX	07/2018	NOK 184.006	\$ 22.566	0	(10)	(10)	0,00
	07/2018	\$ 22.444	NOK 184.775	226	0	226	0,04
	08/2018	22.594	184.006	9	0	9	0,00
				\$ 497	\$ (165)	\$ 332	0,06
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 245	0,04
Summe Anlagen						\$ 655.663	117,47
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (97.516)	(17,47)
Nettovermögen						\$ 558.147	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

(a) Nullkuponwertpapier.

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

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 73.000 als Sicherheiten verpfändet.

(h) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 39.907 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 4.594 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 4.490 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(i) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, Erlöse aus zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 547	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	\$ (561)	\$ 547	\$ 547	0,10
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (561)	\$ 547	\$ 547	0,10

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

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

## Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 139	\$ 655.946	\$ 0	\$ 656.085
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	225	(659)	12	(422)
<b>Summen</b>	<b>\$ 364</b>	<b>\$ 655.287</b>	<b>\$ 12</b>	<b>\$ 655.663</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 3.625	\$ 661.749	\$ 1.190	\$ 666.564
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(306)	4.450	15	4.159
<b>Summen</b>	<b>\$ 3.319</b>	<b>\$ 666.199</b>	<b>\$ 1.205</b>	<b>\$ 670.723</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 der Wertpapieranlagen.

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	2,180 %	20.06.2018	05.07.2018	\$ (599)	\$ (600)	(0,11)
		29.06.2018	02.07.2018	(2.603)	(2.604)	(0,47)
GRE	1,980	26.06.2018	02.07.2018	(1.001)	(1.001)	(0,18)
		19.06.2018	11.07.2018	(3.500)	(3.502)	(0,63)
		22.05.2018	23.07.2018	(47.177)	(47.285)	(8,47)
JPS	2,000	28.06.2018	03.07.2018	(18.223)	(18.226)	(3,26)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (73.218)</b>	<b>(13,12)</b>

## Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkaufgeschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	2,500 %	28.06.2018	05.07.2018	\$ (38.641)	\$ (38.649)	(6,93)
		29.06.2018	06.07.2018	(1.403)	(1.403)	(0,25)
<b>Summe Rückkaufgeschäfte</b>					<b>\$ (40.052)</b>	<b>(7,18)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 11 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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (1.047)	\$ 2.640	\$ 1.593
BPS	(281)	0	(281)
BRC	(77)	310	233
CBK	56	0	56
CKL	(22)	0	(22)
DUB	(249)	100	(149)
FBF	(77)	260	183
GLM	178	(270)	(92)
GST	(5)	0	(5)
HUS	(45)	0	(45)
JPM	75	0	75
MEI	(10)	0	(10)
MSB	107	0	107
RBC	(9)	0	(9)
RYL	3	0	3
SCX	1.140	0	1.140
SSB	502	980	1482
UAG	6	(260)	(254)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	76,19	66,94
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	39,56	34,75
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,80	4,29
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,16)	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	0,04	0,71
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(13,12)	(7,48)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(7,18)	0,00

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des  
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,500 % fällig am 31.05.2020	\$	46.900	1,250 % fällig am 31.03.2019	\$	27.100
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,625 % fällig am 15.05.2021		12.800	2,000 % fällig am 30.11.2022		13.290
Japan Treasury Bills			U.S. Treasury Notes		
2,975 % fällig am 01.06.2021		5.800	1,875 % fällig am 31.08.2022		11.886
Credit Suisse Group AG			U.S. Treasury Notes		
2,997 % fällig am 14.12.2023		5.500	2,000 % fällig am 31.10.2022		11.100
Bank of America Corp			Macquarie Bank Ltd.		
3,108 % fällig am 05.03.2024		5.200	2,662 % fällig am 04.04.2019		7.200
U.S. Treasury Notes			Bank of America Corp		
2,000 % fällig am 30.11.2022		5.295	3,108 % fällig am 05.03.2024		5.200
ZPG PLC			ZPG PLC		
3,750 % fällig am 15.07.2023	£	3.600	3,750 % fällig am 15.07.2023	£	3.600
Japan Treasury Bills			Time Warner Cable LLC		
2,500 % fällig am 05.01.2021	\$	4.300	8,750 % fällig am 14.02.2019	\$	3.900
Qatar Government International Bond			GlaxoSmithKline Capital PLC		
3,875 % fällig am 23.04.2023		4.300	2,893 % fällig am 14.05.2021		3.700
QNB Finance Ltd.			Vodafone Group PLC		
3,705 % fällig am 12.02.2020		3.900	3,290 % fällig am 16.01.2024		3.600
GlaxoSmithKline Capital PLC			NTT Finance Corp.		
2,693 % fällig am 14.05.2021		3.700	2,864 % fällig am 29.06.2020		3.500
Vodafone Group PLC			LeasePlan Corp. NV		
3,290 % fällig am 16.01.2024		3.600	0,000 % fällig am 16.05.2018		3.500
Zimmer Biomet Holdings Inc			Sinopec Group Overseas Development Ltd.		
3,076 % fällig am 19.03.2021		3.400	2,500 % fällig am 13.09.2022		3.500
Petroleos Mexicanos			Solvay Finance America LLC		
2,500 % fällig am 21.08.2021	€	2.800	3,400 % fällig am 03.12.2020		3.300
Equifax Inc			Maple Escrow Subsidiary Inc		
3,200 % fällig am 15.08.2021	\$	3.200	3,551 % fällig am 25.05.2021		3.100
Daimler Finance North America LLC			General Mills Inc		
2,913 % fällig am 04.05.2021		3.100	2,893 % fällig am 16.04.2021		3.100
Bayer US Finance II LLC			Daimler Finance North America LLC		
2,965 % fällig am 25.06.2021		3.100	2,913 % fällig am 04.05.2021		3.100
Japan Treasury Bills			Bank of America Corp.		
2,893 % fällig am 16.04.2021		3.100	0,000 % fällig am 25.04.2018		3.000
Maple Escrow Subsidiary Inc			Energy Transfer LP		
3,551 % fällig am 25.05.2021		3.100	9,700 % fällig am 15.03.2019		2.473

(a) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARMARKT-WERT (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>1,800 % fällig am 11.07.2018</b>				
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Argentina Government International Bond				(b)(c)	\$	4.500	4,498	1,26
2,601 % fällig am 25.10.2035	\$ 100	\$ 97	0,03	2,500 % fällig am 31.12.2038	\$ 2	\$ 1	0,00	1,840 % fällig am 13.07.2018				
Bayview Opportunity Master Fund Trust								(b)(c)	40.300	40.277	11,31	
3,672 % fällig am 28.03.2033	93	93	0,03	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>1,840 % fällig am 18.07.2018</b>				
Business Jet Securities LLC				<b>COMMERCIAL PAPER</b>				(b)(c)				
4,447 % fällig am 15.06.2033	100	100	0,03	Bank of Montreal				1,850 % fällig am 13.07.2018		12.650	12.640	3,55
College Ave Student Loans LLC				1,512 % fällig am 26.07.2018	CAD 18.000	13.668	3,84	(b)(c)	2.800	2.798	0,79	
0,000 % fällig am 26.12.2047	50	50	0,01	1,540 % fällig am 03.07.2018	250	190	0,05	1,860 % fällig am 01.08.2018		30.000	29.952	8,41
4,130 % fällig am 26.12.2047	50	51	0,01	Bank of Nova Scotia				(b)(c)	20.000	19.967	5,61	
Fieldstone Mortgage Investment Trust				1,525 % fällig am 26.07.2018	18.000	13.668	3,84	1,890 % fällig am 14.09.2018		30.000	29.881	8,39
3,216 % fällig am 25.03.2035	97	94	0,03	1,527 % fällig am 05.07.2018	125	95	0,03	(b)(c)	30.000	29.919	8,40	
Figueroa CLO Ltd.				1,529 % fällig am 04.07.2018	125	95	0,03	1,892 % fällig am 22.08.2018		176.931	49,68	
2,925 % fällig am 20.06.2027	100	100	0,03	C.I.B.C.				(b)(c)				
Lehman XS Trust				1,514 % fällig am 25.07.2018	18.000	13.669	3,84	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>				
6,500 % fällig am 25.06.2046	89	84	0,02	HSBC Bank Canada				PIMCO Funds Ireland p.l.c. -				
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				1,566 % fällig am 25.07.2018	17.860	13.563	3,81	PIMCO US Dollar Short-				
2,231 % fällig am 25.05.2037	5.810	3.573	1,00	1,584 % fällig am 03.07.2018	200	152	0,04	Term Floating NAV Fund (e) 3.466.494				
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				1,584 % fällig am 04.07.2018	100	76	0,02	Summe kurzfristige Instrumente				
3,516 % fällig am 25.01.2035	1.330	1.213	0,34	Royal Bank of Canada				277.216 77,84				
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				1,512 % fällig am 26.07.2018	18.000	13.668	3,84	<b>AKTIEN</b>				
3,141 % fällig am 25.12.2034	100	100	0,03	1,540 % fällig am 03.07.2018	250	190	0,05	<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>				
RMAT LP				Toronto Dominion Bank				PIMCO US Dollar Short-				
4,090 % fällig am 25.05.2048	100	100	0,03	1,540 % fällig am 03.07.2018	250	190	0,05	Term Floating NAV Fund (e) 3.466.494				
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust								Summe übertragbare Wertpapiere und				
2,321 % fällig am 25.05.2047	600	573	0,16					Geldmarktinstrumente – Amtliche				
Terwin Mortgage Trust								Börse/Geregelter Markt				
3,471 % fällig am 25.03.2035	1.218	1.153	0,32					\$ 428.615 120,36				
		7.381	2,07	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (g)</b>								
				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>								
				Federal Home Loan Bank								
				1,800 % fällig am 05.07.2018								
				(b)(c)								
				\$ 7.000				6.999 1,96				

## 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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-30 5-Year Index	5,000 %	20.06.2023	\$ 255	\$ 1	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000 %	19.12.2028	\$ 20.400	\$ (30)	(0,01)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (29)	(0,01)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	101,000	17.10.2018	\$ 900	\$ (4)	\$ (5)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	500	(1)	(1)	0,00
MYC	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	104,000	19.09.2018	50	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	104,500	19.09.2018	100	(1)	(1)	0,00
						\$ (6)	\$ (7)	0,00

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
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 25.375	\$ ( 78)	\$ (34)	\$ (112)	(0,03)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	25.375	(194)	(42)	(236)	(0,07)
					\$ (272)	\$ (76)	\$ (348)	(0,10)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Rücklerangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds 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	08/2018	£	79	\$	105	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BOA	07/2018	CAD	53.935		40.513	0	(504)	(504)	(0,14)
	08/2018		750		580	10	0	10	0,00
	08/2018	CHF	41		42	0	0	0	0,00
CBK	08/2018		25		26	0	0	0	0,00
HUS	07/2018	CAD	35.818		26.907	0	(332)	(332)	(0,09)
MSB	08/2018	¥	40.000		369	6	0	6	0,00
SSB	08/2018	CAD	549		425	7	0	7	0,00
	08/2018	£	1.099		1.442	0	(12)	(12)	0,00
						\$ 24	\$ (848)	\$ (824)	(0,23)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class Accumulation Shares, Institutional CHF (Hedged) Class Income Shares, Class E CHF (Hedged) Accumulation und Class E CHF (Hedged) Income 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	07/2018	CHF	83	\$	83	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08/2018	\$	83	CHF	83	0	0	0	0,00
BRC	07/2018		84		82	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2018		84		82	0	(1)	(1)	0,00
MYC	07/2018		84		82	0	(0)	(0)	0,00
						\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class Accumulation Shares, Investor EUR (Hedged) Class Income Shares, Class E EUR (Hedged) Accumulation, Class E EUR (Hedged) Income und Class G Retail EUR (Hedged) 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	07/2018	\$	83	€	71	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	07/2018		83		71	0	0	0	0,00
HUS	07/2018		116.705		100.000	50	0	50	0,01
MYC	07/2018	€	100.675	\$	116.280	0	(1.264)	(1.264)	(0,35)
	07/2018	\$	83	€	71	0	0	0	0,00
	08/2018		116.536		100.675	1.262	0	1.262	0,35
NAB	07/2018		116.710		100.000	45	0	45	0,01
SSB	07/2018	€	100.247	\$	116.697	0	(346)	(346)	(0,10)
	07/2018	\$	116.699	€	100.000	56	0	56	0,02
	08/2018		116.956		100.247	341	0	341	0,10
						\$ 1.754	\$ (1.610)	\$ 144	0,04

Zum 30. Juni 2018 standen für Anteile der Institutional GBP (Hedged) Class Accumulation und der Institutional GBP (Hedged) Class Income 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	07/2018	\$	84	£	62	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
BOA	07/2018	£	63	\$	82	0	0	0	0,00
	08/2018	\$	82	£	63	0	0	0	0,00
BRC	07/2018	£	63	\$	82	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$	84	£	62	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018		82		63	1	0	1	0,00
MEI	07/2018		84		62	0	(1)	(1)	0,00
						\$ 1	\$ (4)	\$ (3)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2018 standen für die E SGD (Hedged) Class 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	09/2018	\$ 84	SGD 112	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00		
CBK	09/2018	84	112	0	(1)	(1)	0,00		
MEI	09/2018	84	112	0	(2)	(2)	0,00		
						\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ (1.045)</b>	<b>(0,29)</b>		
<b>Summe Anlagen</b>						<b>\$ 427.541</b>	<b>120,06</b>		
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>\$ (71.423)</b>	<b>(20,06)</b>		
<b>Nettovermögen</b>						<b>\$ 356.118</b>	<b>100,00</b>		

## 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) 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.

Barmittel in Höhe von USD 631 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 2.010 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(g) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOS	2,180 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 15.000	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2020	\$ (15.331)	\$ 15.000	\$ 15.002	4,21
	2,220	29.06.2018	02.07.2018	15.700	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 30.04.2020	(16.006)	15.700	15.702	4,41
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (31.337)</b>	<b>\$ 30.700</b>	<b>\$ 30.704</b>	<b>8,62</b>

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

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 34.710	\$ 393.505	\$ 400	\$ 428.615
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	(1.074)	0	(1.074)
<b>Summen</b>	<b>\$ 34.710</b>	<b>\$ 392.431</b>	<b>\$ 400</b>	<b>\$ 427.541</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (2)	\$ 0	\$ (2)
BOA	(494)	0	(494)
BRC	(2)	0	(2)
CBK	(8)	0	(8)
HUS	(282)	0	(282)
MEI	(3)	0	(3)
MSB	6	0	6
MYC	(351)	1.080	729
NAB	45	930	975
SSB	46	(120)	(74)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%) <sup>(1)</sup>	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	10,27	k. A.
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	81,72	k. A.
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	28,37	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,01)	k. A.
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,29)	k. A.

<sup>(1)</sup> Der Low Duration Income Fund wurde am 31. Mai 2018 aufgelegt.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Duration Income Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
Federal Home Loan Bank 1,854 % fällig am 13.07.2018	\$ 43.100	\$ 43.065	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.08.2018	\$ 1.500	\$ 1.496
	<b>AKTIEN</b>		U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 02.08.2018	1.400	1.396
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.505.443	35.100		<b>AKTIEN</b>	
	<b>PARI (000S)</b>		PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	38.949	390
Federal Home Loan Bank 1,860 % fällig am 01.08.2018	\$ 30.000	29.946		<b>PARI (000S)</b>	
Federal Home Loan Bank 1,892 % fällig am 22.08.2018	30.000	29.912	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.09.2018	\$ 100	100
Federal Home Loan Bank 1,890 % fällig am 14.09.2018	30.000	29.876	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 27.09.2018	100	99
Federal Home Loan Bank 1,860 % fällig am 02.08.2018	20.000	19.963	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.10.2018	100	99
Federal Home Loan Bank 1,840 % fällig am 18.07.2018	12.650	12.636	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.10.2018	100	99
Federal Home Loan Bank 1,830 % fällig am 05.07.2018	7.000	6.997	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 18.10.2018	100	99
Federal Home Loan Bank 1,800 % fällig am 11.07.2018	4.500	4.497			
Sprint Communications, Inc. 9,000 % fällig am 15.11.2018	3.550	3.626	(a) Der Low Duration Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.		
HarborView Mortgage Loan Trust 2,275 % fällig am 19.09.2037	3.704	3.560	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.		
Bear Stearns ALT-A Trust 3,777 % fällig am 25.09.2035	4.865	3.551	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates 2,346 % fällig am 25.08.2035	3.728	3.551			
Lehman XS Trust 3,241 % fällig am 25.12.2037	3.545	3.545			
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 2,231 % fällig am 25.05.2037	5.810	3.529			
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 6,250 % fällig am 25.08.2036	2.637	2.517			
Duke Energy Corp. 3,550 % fällig am 15.09.2021	1.825	1.836			
Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022	1.700	1.832			
Ally Financial, Inc. 4,125 % fällig am 30.03.2020	1.800	1.807			
SoftBank Group Corp. 4,000 % fällig am 20.04.2023	€ 1.500	1.799			



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO MLP & Energy Infrastructure 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
	Erhalt	Energy Transfer Partners LP	641.723	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 11.865	15.03.2019	\$ 0	\$ 343	\$ 343	0,13
	Erhalt	Enterprise Products Partners LP	290.233	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	8.144	15.03.2019	0	(121)	(121)	(0,05)
	Erhalt	NuStar Energy LP	82.089	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.927	15.03.2019	0	(70)	(70)	(0,03)
	Erhalt	Western Gas Partners LP	42.181	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.073	15.04.2019	0	(33)	(33)	(0,01)
	Erhalt	Williams Partners LP	600	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	24	15.04.2019	0	0	0	0,00
	Erhalt	Cheniere Energy Partners LP	45.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.613	15.05.2019	0	4	4	0,00
	Erhalt	Enable Midstream Partners LP	105.046	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.724	15.05.2019	0	72	72	0,03
	Erhalt	Magellan Midstream Partners LP	42.825	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.921	15.05.2019	0	35	35	0,01
	Erhalt	Rice Midstream Partners LP	118.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.164	15.05.2019	0	(158)	(158)	(0,06)
	Erhalt	Valero Energy Partners LP	60.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.362	15.05.2019	0	(79)	(79)	(0,03)
BPS	Erhalt	Enable Midstream Partners LP	14.168	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	231	15.02.2019	0	11	11	0,00
CBK	Erhalt	Tallgrass Energy Partners LP	57.045	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	2.455	15.10.2018	0	15	15	0,01
	Erhalt	DCP Midstream LP	19.214	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	737	15.11.2018	0	22	22	0,01
	Erhalt	Golar LNG Partners LP	10.300	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	160	15.11.2018	0	(1)	(1)	0,00
	Erhalt	Plains All American Pipeline LP	151.566	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.669	15.11.2018	0	(90)	(90)	(0,03)
	Erhalt	Western Gas Partners LP	57.109	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.806	15.11.2018	0	(45)	(45)	(0,02)
	Erhalt	Tallgrass Equity Partners LP	21.955	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	945	15.04.2019	0	6	6	0,00
GST	Erhalt	Enable Midstream Partners LP	35.787	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	584	15.11.2018	0	27	27	0,01
	Erhalt	EQT Midstream Partners LP	5.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	278	15.02.2019	0	(21)	(21)	(0,01)
	Erhalt	Energy Transfer Partners LP	74.691	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.381	15.03.2019	0	40	40	0,02
	Erhalt	Enable Midstream Partners LP	162.303	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	2.650	14.06.2019	0	125	125	0,05
MYI	Erhalt	AmeriGas Partners LP	9.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	375	27.11.2018	0	5	5	0,00
	Erhalt	Andeavor Logistics LP	16.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	696	27.11.2018	0	(16)	(16)	(0,01)
	Erhalt	Antero Midstream Partners LP	8.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	243	27.11.2018	0	(7)	(7)	0,00
	Erhalt	Crestwood Equity Partners LP	40.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.252	27.11.2018	0	17	17	0,01
	Erhalt	Enable Midstream Partners LP	5.696	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	93	27.11.2018	0	4	4	0,00
	Erhalt	Energy Transfer Partners LP	250.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	4.623	27.11.2018	0	136	136	0,05
	Erhalt	Enterprise Products Partners LP	34.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	954	27.11.2018	0	(14)	(14)	(0,01)
	Erhalt	EQT Midstream Partners LP	2.078	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	116	27.11.2018	0	(8)	(8)	0,00
	Erhalt	Magellan Midstream Partners LP	4.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	273	27.11.2018	0	3	3	0,00
	Erhalt	MPLX LP	14.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	482	27.11.2018	0	(5)	(5)	0,00
	Erhalt	NGL Energy Partners LP	37.457	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	463	27.11.2018	0	5	5	0,00
	Erhalt	Noble Midstream Partners LP	8.830	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	440	27.11.2018	0	10	10	0,00
	Erhalt	Plains All American Pipeline LP	174.570	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	4.226	27.11.2018	0	(103)	(103)	(0,04)
	Erhalt	Rice Midstream Partners LP	28.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	514	27.11.2018	0	(37)	(37)	(0,01)
	Erhalt	Western Gas Partners LP	53.720	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.640	27.11.2018	0	(42)	(42)	(0,02)
	Erhalt	Crestwood Equity Partners LP	24.300	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	761	15.05.2019	0	10	10	0,00
	Erhalt	Magellan Midstream Partners LP	30.147	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.056	15.05.2019	0	25	25	0,01
	Erhalt	MPLX LP	30.091	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.037	15.05.2019	0	(10)	(10)	0,00
							\$ 0	\$ (559)	\$ (559)	(0,22)

## 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	08/2018	\$ 332	€ 286	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
GLM	07/2018	511	£ 383	0	(5)	(5)	0,00
	08/2018	1.041	€ 862	0	(31)	(31)	(0,01)
JPM	07/2018	CAD 380	\$ 293	4	0	4	0,00
				\$ 7	\$ (36)	\$ (29)	(0,01)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class G Institutional EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 45.017	€ 38.350	\$ 0	\$ (241)	\$ (241)	(0,09)
BPS	07/2018	51.514	£ 44.414	342	0	342	0,13
BRC	07/2018	€ 894	\$ 1.034	0	(11)	(11)	0,00
CBK	07/2018	4.979	\$ 5.791	0	(22)	(22)	(0,01)
	07/2018	\$ 216	€ 185	1	(2)	(1)	0,00
GLM	07/2018	€ 338	\$ 399	4	0	4	0,00
	07/2018	\$ 31	€ 27	0	0	0	0,00
MSB	07/2018	€ 40.104	\$ 46.320	0	(503)	(503)	(0,19)
	08/2018	\$ 46.422	€ 40.104	503	0	503	0,19
RBC	07/2018	€ 57	\$ 67	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	1.138	£ 1.325	1	(5)	(4)	0,00
	07/2018	\$ 5.914	€ 5.062	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07/2018	€ 80	\$ 94	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 14	€ 12	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	€ 40.568	\$ 47.225	0	(140)	(140)	(0,05)
	07/2018	\$ 49.461	€ 42.505	166	0	166	0,06
	08/2018	47.330	40.568	138	0	138	0,05
				\$ 1.155	\$ (927)	\$ 228	0,09

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) 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	07/2018	£ 20	\$ 27	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BOA	07/2018	\$ 3.998	£ 2.994	0	(45)	(45)	(0,02)
BPS	07/2018	634	£ 477	0	(5)	(5)	0,00
BRC	07/2018	£ 3.329	\$ 4.354	0	(42)	(42)	(0,02)
	08/2018	\$ 4.358	£ 3.328	43	0	43	0,02
CBK	07/2018	£ 14	\$ 19	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 4.224	£ 3.189	0	(15)	(15)	(0,01)
GLM	07/2018	562	£ 421	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07/2018	4.251	£ 3.198	0	(29)	(29)	(0,01)
SSB	07/2018	£ 16	\$ 22	0	0	0	0,00
UAG	07/2018	3.369	£ 4.455	7	0	7	0,00
	08/2018	\$ 4.461	£ 3.369	0	(7)	(7)	0,00
				\$ 51	\$ (149)	\$ (98)	(0,04)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (569)	(0,22)
Summe Anlagen						\$ 257.683	99,10
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 2.343	0,90
Nettovermogen						\$ 260.026	100,00

## ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

Gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Hohe von USD 2.620 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Forts.)

## (e) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 1.601	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	\$ (1.637)	\$ 1.601	\$ 1.601	0,62
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (1.637)</b>	<b>\$ 1.601</b>	<b>\$ 1.601</b>	<b>0,62</b>

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

## Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 66.822	\$ 191.430	\$ 0	\$ 258.252
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	(569)	0	(569)
<b>Summen</b>	<b>\$ 66.822</b>	<b>\$ 190.861</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 257.683</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 106.380	\$ 273.620	\$ 0	\$ 380.000
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	4.434	0	4.434
<b>Summen</b>	<b>\$ 106.380</b>	<b>\$ 278.054</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 384.434</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 der Wertpapieranlagen.

<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 1	\$ 0	\$ 1
BOA	(904)	1.940	1.036
BPS	348	0	348
BRC	(10)	0	(10)
CBK	(242)	350	108
GLM	(38)	0	(38)
GST	171	(200)	(29)
JPM	4	0	4
MYI	(27)	0	(27)
RYL	(7)	0	(7)
SCX	(29)	0	(29)
SSB	164	330	494

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	15,90	34,08
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	73,00	65,58
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	10,42	0,51
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,22)	1,17

**Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des  
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund**

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 06.04.2018	\$ 92.900	\$ 92.596	Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 09.05.2018	\$ 50.500	\$ 50.484
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 09.05.2018	88.200	87.960	Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 04.04.2018	49.600	49.592
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 08.08.2018	65.400	65.153	Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 09.01.2018	38.500	38.495
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 18.04.2018	57.100	57.050	Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 14.02.2018	38.000	37.994
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 11.05.2018	55.400	55.253	Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 06.04.2018	36.400	36.376
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 09.04.2018	54.200	54.193			
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 08.06.2018	50.100	49.971	<b>AKTIEN</b>		
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 04.04.2018	49.600	49.543	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (a)	2.916.530	29.200
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 13.04.2018	46.500	46.423			
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 14.02.2018	44.000	43.989	<b>PARI (000S)</b>		
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 06.07.2018	33.700	33.606	Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 08.06.2018	\$ 23.700	23.686
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 10.08.2018	33.500	33.340	Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 25.04.2018	22.500	22.494
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 18.07.2018	33.400	33.249	Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 31.01.2018	14.500	14.498
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 05.01.2018	29.300	29.299	Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 11.05.2018	13.200	13.199
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 13.06.2018	23.000	22.940	Federal Home Loan Bank 1,830 % fällig am 05.07.2018	13.000	12.990
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 25.04.2018	22.700	22.617			
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 11.04.2018	21.300	21.224	<b>AKTIEN</b>		
Federal Home Loan Bank 1,830 % fällig am 05.07.2018	19.900	19.861	Williams Cos., Inc.	381.800	10.902
U.S. Treasury Notes			TransCanada Corp.	226.556	10.375
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 12.04.2018	18.700	18.670			
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 23.02.2018	18.500	18.487	<b>PARI (000S)</b>		
	<b>AKTIEN</b>		Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 21.02.2018	\$ 10.200	10.200
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (a)	1.774.300	17.764	Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 02.02.2018	9.000	8.999
	<b>PARI (000S)</b>				
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 21.02.2018	\$ 15.300	15.284	<b>AKTIEN</b>		
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 05.02.2018	13.400	13.399	Pembina Pipeline Corp.	265.000	8.999
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 26.01.2018	13.300	13.300	Targa Resources Corp.	172.472	8.234
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 25.01.2018	12.200	12.200	Kinder Morgan, Inc.	412.000	7.640
			Cheniere Energy, Inc.	131.881	7.495
			Enbridge, Inc.	171.000	6.714
			ONEOK, Inc.	96.000	6.061
			<b>PARI (000S)</b>		
			Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 26.01.2018	\$ 5.200	5.199

(a) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



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
4,500 % fällig am 20.05.2043 (a)	\$ 2.028	\$ 363	0,02	Citigroup Mortgage Loan Trust				HSI Asset Loan Obligation Trust			
4,500 % fällig am 20.05.2048	7.704	7.985	0,34	6,000 % fällig am 25.12.2035	\$ 4.364	\$ 4.384	0,19	2,461 % fällig am 25.12.2036	\$ 2.678	\$ 1.249	0,05
4,500 % fällig am 20.07.2048 (c)	2.000	2.055	0,09	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				4,539 % fällig am 25.12.2036 (a)	2.621	505	0,02
4,616 % fällig am 20.05.2041 (a)	4.430	581	0,02	3,593 % fällig am 25.08.2035	84	86	0,00	HSI Asset Securitization Corp. Trust			
6,000 % fällig am 20.04.2036 (a)	422	81	0,00	CitiMortgage Alternative Loan Trust				3,051 % fällig am 25.07.2035	1.100	1.063	0,04
6,000 % fällig am 20.02.2047	62	67	0,00	2,641 % fällig am 25.01.2037	3.472	2.962	0,13	IndyMac Mortgage Loan Trust			
8,070 % fällig am 20.07.2047	1.397	1.203	0,05	6,000 % fällig am 25.11.2036	1.912	1.900	0,08	3,614 % fällig am 25.12.2035	776	717	0,03
13,500 % fällig am 20.11.2045	534	1.026	0,04	Civic Mortgage LLC				3,823 % fällig am 25.12.2035	7.661	6.635	0,28
15,587 % fällig am 17.03.2031	43	54	0,00	3,892 % fällig am 25.06.2022	2.828	2.828	0,12	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			
Ginnie Mae, TBA				Commercial Mortgage Trust				4,213 % fällig am 15.10.2032	4.100	4.102	0,17
4,000 % fällig am 01.07.2048	66.500	68.108	2,88	4,371 % fällig am 10.08.2050	5.000	3.906	0,17	5,337 % fällig am 15.05.2047	10.350	10.424	0,44
5,000 % fällig am 01.07.2048	33.400	35.043	1,48	Countrywide Alternative Loan Trust				5,768 % fällig am 12.01.2043	415	421	0,02
				2,251 % fällig am 25.02.2047	673	655	0,03	6,441 % fällig am 12.02.2051	1.450	1.481	0,06
		1.506.679	63,64	2,251 % fällig am 25.09.2047	20	19	0,00	JPMorgan Resecuritization Trust			
				2,294 % fällig am 20.03.2046	1.084	922	0,04	5,750 % fällig am 26.04.2037	1.961	1.665	0,07
				2,294 % fällig am 20.05.2046 ^	3.661	3.070	0,13	7,084 % fällig am 26.09.2037	4.089	2.859	0,12
				2,411 % fällig am 25.11.2035	10.444	9.501	0,40	LB-UBS Commercial Mortgage Trust			
				2,498 % fällig am 25.06.2046	4.381	3.901	0,16	5,612 % fällig am 15.02.2040	800	803	0,03
				2,558 % fällig am 25.12.2035	3.973	3.838	0,16	Lehman Mortgage Trust			
				2,938 % fällig am 25.11.2047 ^	8.656	7.378	0,31	6,000 % fällig am 25.12.2036	3.333	3.429	0,14
				5,500 % fällig am 25.06.2035	314	316	0,01	Lehman XS Trust			
				5,500 % fällig am 25.07.2035	4.767	4.608	0,19	2,331 % fällig am 25.06.2047	18.652	16.938	0,72
				5,500 % fällig am 25.11.2035	3.435	3.090	0,13	MASTR Asset Securitization Trust			
				5,500 % fällig am 25.12.2035	522	501	0,02	6,000 % fällig am 25.10.2036	1.708	1.718	0,07
				6,000 % fällig am 25.05.2036	6.378	5.450	0,23	ML-CFC Commercial Mortgage Trust			
				6,000 % fällig am 25.02.2037	1.022	693	0,03	5,324 % fällig am 12.12.2049	2.958	2.896	0,12
				6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	1.047	749	0,03	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
				6,250 % fällig am 25.09.2037	976	914	0,04	6,000 % fällig am 25.10.2037	13.455	11.939	0,50
				Countrywide Asset-Backed Certificates				Mortgage Equity Conversion Asset Trust			
				2,591 % fällig am 25.03.2036	3.119	2.850	0,12	2,810 % fällig am 25.02.2042	1.900	1.721	0,07
				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Motel 6 Trust			
				2,666 % fällig am 25.04.2035 ^	554	445	0,02	2,993 % fällig am 15.08.2034	3.129	3.133	0,13
				3,456 % fällig am 20.04.2036	141	131	0,01	3,263 % fällig am 15.08.2034	2.737	2.742	0,12
				5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	1.674	1.547	0,07	4,223 % fällig am 15.08.2034	293	294	0,01
				6,500 % fällig am 25.12.2037	7.633	6.150	0,26	Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
				Credit Suisse Commercial Mortgage Trust				2,391 % fällig am 25.08.2036	2.149	1.668	0,07
				5,568 % fällig am 15.09.2039	236	238	0,01	6,000 % fällig am 25.01.2037	384	360	0,02
				Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				6,250 % fällig am 25.01.2037 ^	2.460	2.296	0,10
				3,591 % fällig am 26.02.2036	57	57	0,00	Residential Asset Securitization Trust			
				Credit Suisse Mortgage Capital Trust				2,541 % fällig am 25.03.2035	3.366	3.094	0,13
				2,200 % fällig am 27.05.2037	37	36	0,00	6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	3.239	1.785	0,08
				3,023 % fällig am 15.02.2031	340	340	0,01	Residential Mortgage Securities PLC			
				Deutsche ALT-A Securities, Inc.				1,429 % fällig am 20.03.2050	£ 2.315	3.064	0,13
				2,331 % fällig am 25.01.2047	12.098	10.060	0,43	Resource Capital Corp. Ltd.			
				Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				2,873 % fällig am 15.07.2034	\$ 2.882	2.882	0,12
				5,275 % fällig am 19.10.2036	12.976	10.911	0,46	4,073 % fällig am 15.07.2034	853	856	0,04
				Dutch Property Finance BV				RETL			
				0,352 % fällig am 28.01.2048	€ 3.050	3.585	0,15	3,823 % fällig am 15.03.2033	612	616	0,03
				Eurosaill PLC				Sestante Finance SRL			
				0,000 % fällig am 13.03.2045	550	599	0,03	0,000 % fällig am 23.07.2046	€ 1.467	1.473	0,06
				0,129 % fällig am 10.09.2044	800	851	0,04	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
				1,627 % fällig am 13.06.2045	£ 559	711	0,03	2,241 % fällig am 25.02.2037	\$ 1.547	1.644	0,07
				First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				2,311 % fällig am 25.06.2037	886	850	0,04
				Freddie Mac				3,756 % fällig am 25.02.2034	30	30	0,00
				4,077 % fällig am 15.01.2043 (a)	3.439	553	0,02	3,874 % fällig am 25.05.2035	2.443	2.166	0,09
				GE Capital Commercial Mortgage Corp.				Structured Asset Mortgage Investments Trust			
				5,935 % fällig am 10.11.2045	3.225	3.282	0,14	2,311 % fällig am 25.09.2047	8.518	8.077	0,34
				GreenPoint Mortgage Funding Trust				2,631 % fällig am 25.08.2035	1.076	1.036	0,04
				2,291 % fällig am 25.10.2046	18.243	17.926	0,76	3,210 % fällig am 19.12.2033	1.297	1.278	0,05
				GS Mortgage Securities Corp.				Structured Asset Securities Corp.			
				4,579 % fällig am 10.10.2032	7.800	7.870	0,33	2,341 % fällig am 25.07.2035	3.697	3.514	0,15
				GS Mortgage Securities Corp. Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
				4,202 % fällig am 10.02.2029	3.100	3.055	0,13	2,341 % fällig am 25.05.2036	3.535	3.209	0,14
				GS Mortgage Securities Trust				Sutherland Commercial Mortgage Loans			
				5,342 % fällig am 15.07.2031	2.500	2.506	0,11	3,192 % fällig am 25.05.2037	2.857	2.866	0,12
				GSMPs Mortgage Loan Trust				Twin Bridges PLC			
				2,491 % fällig am 25.04.2036	655	559	0,02	1,407 % fällig am 12.09.2044	£ 5.596	7.395	0,31
				7,088 % fällig am 20.10.2032	2.568	2.658	0,11	Uropa Securities PLC			
				GSMS Resecuritization Trust				1,014 % fällig am 10.10.2040	100	122	0,01
				6,390 % fällig am 26.04.2037	6.115	2.202	0,09	1,114 % fällig am 10.10.2040	50	61	0,00
				Hilton USA Trust				Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust			
				4,927 % fällig am 05.11.2035	11.000	11.186	0,47	5,660 % fällig am 15.04.2047	\$ 414	417	0,02
				HomeBanc Mortgage Trust				5,691 % fällig am 15.10.2048	492	498	0,02
				2,631 % fällig am 25.10.2035	7.184	6.675	0,28	6,209 % fällig am 15.02.2051	3.000	2.989	0,13
								WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
								2,145 % fällig am 25.01.2047	1.506	1.469	0,06
								2,328 % fällig am 25.04.2047 ^	154	139	0,01

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
2,395 % fällig am 25.11.2046	\$	565		CIFC Funding Ltd.				GSAA Home Equity Trust			
2,518 % fällig am 25.09.2046		2.367	0,09	3,128 % fällig am 15.04.2027	\$	3.000	2,992	2,321 % fällig am 25.04.2047	\$	6.915	4,950
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				CIT Mortgage Loan Trust				2,571 % fällig am 25.10.2035		1.896	1,693
5,750 % fällig am 25.05.2036 ^		137	0,01	3,591 % fällig am 25.10.2037		880	908	GSAMP Trust			
				Citigroup Mortgage Loan Trust				2,976 % fällig am 25.07.2045 ^		3.976	3,827
		374.817	15,83	2,251 % fällig am 25.12.2036		5.243	3,470	Harley Marine Financing LLC			
				2,491 % fällig am 25.03.2037		5.800	5,764	5,682 % fällig am 15.05.2043		1.696	1,722
				Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through				Home Equity Asset Trust			
				Certificates				2,541 % fällig am 25.02.2036		1.400	1,353
				3,066 % fällig am 25.05.2035		1.279	1,199	3,381 % fällig am 25.08.2033		867	874
				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
				2,371 % fällig am 25.11.2036		2.500	2,478	2,331 % fällig am 25.08.2036		7.500	6,651
				Conseco Finance Corp.				2,331 % fällig am 25.04.2037		33.048	24,989
				6,920 % fällig am 01.12.2030		9.443	10,429	3,336 % fällig am 25.03.2035		2.900	2,920
				Contego CLO BV				HSI Asset Securitization Corp. Trust			
				0,583 % fällig am 15.11.2026		7.400	8,645	2,341 % fällig am 25.05.2037		4.600	4,182
				Cork Street CLO Designated Activity Co.				Hyundai Auto Lease Securitization Trust			
				0,590 % fällig am 27.11.2028		4.900	5,720	2,353 % fällig am 16.12.2019		2.186	2,188
				Countrywide Asset-Backed Certificates				Jamestown CLO Ltd.			
				2,241 % fällig am 25.04.2047 ^		1.127	1,088	3,218 % fällig am 15.01.2028		12.800	12,754
				2,241 % fällig am 25.06.2047 ^		1.127	1,112	3,573 % fällig am 17.01.2027		1.057	1,058
				2,281 % fällig am 25.11.2037		1.746	1,718	JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.			
				2,311 % fällig am 25.09.2037 ^		14.309	12,047	2,361 % fällig am 25.03.2036		6.153	5,482
				2,321 % fällig am 25.05.2037		9.900	9,049	2,321 % fällig am 25.03.2035		4.900	4,219
				2,341 % fällig am 25.01.2046 ^		7.093	6,694	3,111 % fällig am 25.07.2035		3.587	3,638
				2,441 % fällig am 25.03.2036 ^		2.450	2,243	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
				2,441 % fällig am 25.04.2036		3.334	3,344	2,211 % fällig am 25.12.2036		8.263	5,142
				2,741 % fällig am 25.01.2036		100	95	2,301 % fällig am 25.03.2037		2.495	2,492
				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				2,331 % fällig am 25.11.2036		341	314
				2,721 % fällig am 25.08.2035		1.918	1,923	2,361 % fällig am 25.07.2036		14.000	13,439
				3,066 % fällig am 25.10.2034		180	179	Lehman XS Trust			
				3,996 % fällig am 25.08.2034		680	680	2,261 % fällig am 25.12.2036		8.653	10,273
				4,606 % fällig am 25.10.2046 ^		72	67	2,301 % fällig am 25.06.2046		9.594	9,417
				4,631 % fällig am 25.02.2035		92	84	Long Beach Mortgage Loan Trust			
				Credit Suisse Mortgage Capital Trust				2,251 % fällig am 25.12.2036		14.847	11,024
				4,500 % fällig am 25.03.2021		58	59	2,391 % fällig am 25.02.2036		203	173
				Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				Magnetite Ltd.			
				2,241 % fällig am 25.05.2036		3.378	2,812	3,360 % fällig am 25.07.2026		5.000	5,003
				2,871 % fällig am 25.03.2034		943	943	MAPS Ltd.			
				CVC Cordatus Loan Fund Ltd.				4,212 % fällig am 15.05.2043		3.949	3,970
				0,780 % fällig am 24.01.2028	€	560	655	Marlette Funding Trust			
				CVP Cascade CLO Ltd.				3,060 % fällig am 17.07.2028		2.300	2,301
				3,498 % fällig am 16.01.2026	\$	757	758	MASTR Asset-Backed Securities Trust			
				CWHQ Revolving Home Equity Loan Trust				2,661 % fällig am 25.01.2036		5.038	4,942
				2,303 % fällig am 15.02.2036		6.646	6,452	2,671 % fällig am 25.12.2035		1.948	1,953
				Dartry Park CLO DAC				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
				0,830 % fällig am 28.04.2029	€	3.600	4,210	2,491 % fällig am 25.12.2036		6.928	5,728
				Denali Capital CLO Ltd.				3,171 % fällig am 25.10.2035		1.558	1,537
				3,412 % fällig am 26.10.2027	\$	3.820	3,819	MidOcean Credit CLO			
				Dorchester Park CLO Ltd.				3,148 % fällig am 15.04.2027		18.300	18,300
				2,984 % fällig am 20.04.2028		10.000	10,007	Monarch Grove CLO			
				Driver Australia Four Trust				3,240 % fällig am 25.01.2028		2.700	2,701
				2,940 % fällig am 21.08.2025	AUD	897	664	Monroe Capital BSL CLO Ltd.			
				Driver Espana Five FDT				3,449 % fällig am 22.05.2027		1.000	999
				0,030 % fällig am 21.12.2028	€	3.619	4,242	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
				Dryden Euro CLO BV				2,216 % fällig am 25.07.2036		23.610	20,601
				0,679 % fällig am 17.05.2027		975	1,141	2,241 % fällig am 25.07.2036		4.613	2,566
				DT Auto Owner Trust				2,241 % fällig am 25.12.2036		11.914	7,634
				1,720 % fällig am 15.05.2020	\$	112	111	2,341 % fällig am 25.07.2036		4.613	2,625
				ECMC Group Student Loan Trust				2,471 % fällig am 25.12.2035		9.210	7,649
				3,141 % fällig am 25.05.2067		1.857	1,883	Morgan Stanley Capital, Inc. Trust			
				Evans Grove CLO Ltd.				2,381 % fällig am 25.01.2036		4.892	4,852
				3,239 % fällig am 28.05.2028		17.700	17,700	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
				First Franklin Mortgage Loan Trust				2,191 % fällig am 25.04.2037		203	138
				2,251 % fällig am 25.11.2036		16.825	16,474	Munda CLO BV			
				2,401 % fällig am 25.09.2036		7.465	6,712	0,574 % fällig am 05.12.2024	€	1.000	1,168
				2,531 % fällig am 25.01.2036		1.550	1,530	National Collegiate Student Loan Trust			
				Flagship Ltd.				2,170 % fällig am 25.11.2027	\$	640	638
				3,479 % fällig am 20.01.2026		514	515	2,351 % fällig am 26.02.2029		110	108
				Fremont Home Loan Trust				2,331 % fällig am 25.07.2030		1.324	1,305
				2,231 % fällig am 25.02.2037		10.390	8,477	2,361 % fällig am 26.03.2029		1.580	1,558
				3,021 % fällig am 25.07.2035		4.000	3,430	2,361 % fällig am 25.09.2029		73	72
				Goodgreen Trust				2,401 % fällig am 25.05.2032		10.000	9,099
				3,930 % fällig am 15.10.2053		7.890	7,937	Navient Private Education Loan Trust			
				Greystone Commercial Real Estate Ltd.				2,650 % fällig am 15.12.2028		548	539
				3,623 % fällig am 15.03.2027		100	100	2,740 % fällig am 15.02.2029		83	82

BESCHREIBUNG	PARI MARKT-WERT		% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI MARKT-WERT		% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI MARKT-WERT		% DES NETTO-VERMÖGENS
	(000S)	(000S)			(000S)	(000S)			(000S)	(000S)	
Neinet Student Loan Trust				2,781 % fällig am 25.11.2035	\$ 1.555	\$ 1.539	0,07	3,743 % fällig am 20.04.2028	\$ 17.950	\$ 17.905	0,76
2,691 % fällig am 25.03.2030	\$ 1.788	\$ 1.797	0,08	2,871 % fällig am 25.06.2034	531	525	0,02	TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
3,130 % fällig am 25.11.2048	3.166	3.203	0,14	3,036 % fällig am 25.05.2035	1.110	1.126	0,05	3,895 % fällig am 20.09.2039	6.038	5.977	0,25
Neuberger Berman CLO Ltd.				Sapphire Aviation Finance				4,189 % fällig am 20.04.2038	902	902	0,04
3,148 % fällig am 15.07.2027	2.100	2.100	0,09	4,250 % fällig am 15.03.2040	13.513	13.644	0,58	Upstart Securitization Trust			
NewMark Capital Funding CLO Ltd.				Sapphire Aviation Finance Ltd.				3,015 % fällig am 20.08.2025	2.575	2.572	0,11
3,528 % fällig am 30.06.2026	250	250	0,01	4,250 % fällig am 15.03.2040	2.448	2.472	0,10	3,887 % fällig am 20.08.2025	2.950	2.949	0,12
North Westerly CLO BV				Saxon Asset Securities Trust				4,997 % fällig am 20.08.2025	1.300	1.301	0,06
0,609 % fällig am 15.01.2026	€ 3.100	€ 3.624	0,15	2,531 % fällig am 25.11.2037	1.460	1.457	0,06	Venture CLO Ltd.			
NovaStar Mortgage Funding Trust				SLC Student Loan Trust				3,119 % fällig am 28.02.2026	12.900	12.846	0,54
3,261 % fällig am 25.06.2035	\$ 2.000	\$ 1.953	0,08	2,443 % fällig am 15.02.2025	499	499	0,02	3,198 % fällig am 15.01.2028	10.200	10.213	0,43
Oak Hill Credit Partners Ltd.				2,451 % fällig am 15.03.2027	2.481	2.474	0,10	3,228 % fällig am 15.04.2027	6.200	6.188	0,26
3,489 % fällig am 20.07.2026	250	250	0,01	SLM Private Credit Student Loan Trust				VOLT LLC			
Ocean Trails CLO				2,511 % fällig am 15.12.2026	2.146	2.145	0,09	3,250 % fällig am 25.05.2047	1.992	1.983	0,08
3,255 % fällig am 13.08.2025	3.530	3.533	0,15	SLM Private Education Loan Trust				3,375 % fällig am 25.04.2047	617	617	0,03
OCP CLO Ltd.				4,323 % fällig am 16.06.2042	400	412	0,02	3,375 % fällig am 28.05.2047	733	734	0,03
3,148 % fällig am 15.07.2027	1.400	1.399	0,06	SLM Student Loan Trust				3,500 % fällig am 25.03.2047	453	452	0,02
Octagon Investment Partners Ltd.				0,000 % fällig am 15.12.2023	€ 68	€ 80	0,00	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
3,473 % fällig am 17.07.2025	449	449	0,02	0,000 % fällig am 25.01.2024	313	366	0,02	2,301 % fällig am 25.03.2037	4.749	4.539	0,19
OFSI Fund Ltd.				0,000 % fällig am 17.06.2024	191	223	0,01	2,411 % fällig am 25.07.2036	8.595	7.893	0,33
2,998 % fällig am 20.03.2025	3.400	3.401	0,14	2,400 % fällig am 25.04.2019	\$ 1.739	\$ 1.734	0,07	2,431 % fällig am 25.05.2036	4.000	3.852	0,16
3,255 % fällig am 18.10.2026	5.388	5.383	0,23	2,460 % fällig am 25.04.2027	2.230	2.228	0,09	Westlake Automobile Receivables Trust			
3,503 % fällig am 17.04.2025	23	23	0,00	2,470 % fällig am 27.01.2025	433	432	0,02	3,513 % fällig am 17.07.2026	3.300	3.303	0,14
OneMain Direct Auto Receivables Trust				2,470 % fällig am 27.10.2025	1.404	1.403	0,06	WhiteHorse Ltd.			
2,310 % fällig am 14.12.2021	9.600	9.530	0,40	3,541 % fällig am 15.12.2033	4.240	4.297	0,18	3,010 % fällig am 17.04.2027	8.400	8.386	0,35
Option One Mortgage Loan Trust				SoFi Consumer Loan Program LLC							
2,231 % fällig am 25.03.2037	12.052	10.927	0,46	2,500 % fällig am 26.05.2026	503	497	0,02				
Pallas CDO BV				2,770 % fällig am 25.05.2026	627	622	0,03				
0,000 % fällig am 16.07.2082	€ 1.481	€ 1.737	0,07	3,260 % fällig am 25.08.2025	136	136	0,01				
Palmer Square CLO Ltd.				SoFi Professional Loan Program LLC							
3,573 % fällig am 17.10.2027	\$ 800	\$ 801	0,03	1,720 % fällig am 25.09.2040	637	633	0,03				
Palmer Square Loan Funding Ltd.				2,650 % fällig am 25.09.2040	300	291	0,01				
3,010 % fällig am 15.07.2026	13.900	13.860	0,59	Sorin Real Estate CDO Ltd.							
3,410 % fällig am 15.07.2026	4.600	4.558	0,19	1,797 % fällig am 07.06.2040	3.881	3.856	0,16				
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Sorrento Park CLO DAC							
2,581 % fällig am 25.09.2035	5.100	5.103	0,22	0,624 % fällig am 16.11.2027	€ 1.400	€ 1.635	0,07				
2,611 % fällig am 25.09.2035	7.700	6.688	0,28	Soundview Home Loan Trust							
3,666 % fällig am 25.02.2035	600	614	0,03	2,261 % fällig am 25.07.2037	\$ 14.343	\$ 12.528	0,53				
3,741 % fällig am 25.12.2034	5.555	5.634	0,24	2,261 % fällig am 25.08.2037	14.649	13.450	0,57				
3,966 % fällig am 25.09.2034	1.908	1.918	0,08	2,991 % fällig am 25.10.2037	15.284	13.040	0,55				
Penta CLO BV				3,091 % fällig am 25.09.2037	13.546	10.901	0,46				
0,790 % fällig am 04.08.2028	€ 3.500	€ 4.092	0,17	3,391 % fällig am 25.10.2037	10.700	8.979	0,38				
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				Spirit Master Funding LLC							
2,341 % fällig am 25.06.2047	\$ 2.226	\$ 2.168	0,09	4,360 % fällig am 20.12.2047	12.237	12.277	0,52				
2,421 % fällig am 25.07.2036	5.600	5.182	0,22	Structured Asset Investment Loan Trust							
2,451 % fällig am 25.05.2036	670	612	0,03	2,991 % fällig am 25.05.2035	4.200	4.183	0,18				
2,481 % fällig am 25.02.2036	4.300	4.259	0,18	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust							
2,551 % fällig am 25.09.2035	785	788	0,03	2,221 % fällig am 25.05.2036	972	928	0,04				
RAAC Trust				2,401 % fällig am 25.08.2046	8.572	7.784	0,33				
2,491 % fällig am 25.06.2047	199	199	0,01	2,841 % fällig am 25.04.2035	195	186	0,01				
Residential Asset Mortgage Products Trust				Taberna Preferred Funding Ltd.							
2,451 % fällig am 25.02.2036	200	177	0,01	2,703 % fällig am 05.05.2038	22.285	21.393	0,90				
2,791 % fällig am 25.08.2035	1.363	1.322	0,06	2,791 % fällig am 05.07.2035	946	890	0,04				
Residential Asset Securities Corp. Trust				Terwin Mortgage Trust							
2,311 % fällig am 25.02.2037	11.000	10.192	0,43	2,721 % fällig am 25.06.2036	200	177	0,01				
2,331 % fällig am 25.10.2036	5.000	4.855	0,21	THL Credit Wind River CLO Ltd.							
2,351 % fällig am 25.07.2036	5.700	5.561	0,24	3,462 % fällig am 22.01.2027	1.200	1.198	0,05				
2,381 % fällig am 25.06.2036	1.400	1.323	0,06	TICP CLO Ltd.							
				3,159 % fällig am 20.07.2027	1.000	999	0,04				

## 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
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2018	850	\$ 20	0,00
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2019	850	(85)	(0,01)
90-Day Eurodollar June Futures	Short	06/2020	154	(8)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09/2018	269	(320)	(0,01)
				\$ (393)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (393)	(0,02)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities 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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500 %	21.06.2024	\$ 1.600	\$ 34	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	20.06.2020	137.600	(76)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	65.400	(184)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,170	11.05.2019	49.800	157	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	28.06.2019	115.000	97	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	95.700	158	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	19.12.2020	13.000	(2)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	19.12.2023	7.100	(2)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	20.12.2047	56.650	5.040	0,21
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,916	02.07.2028	6.100	(5)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,924	02.07.2028	45.300	(6)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,987	12.06.2028	60.200	351	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	3,100	17.12.2028	3.200	29	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	3,120	17.12.2028	2.600	28	0,00
					<b>\$ 5.619</b>	<b>0,24</b>
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					<b>\$ 5.619</b>	<b>0,24</b>

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* 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	Kosten	Marktwert	% des Nettvermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,440 %	13.12.2018	\$ 14.100	\$ 75	\$ 45	0,00
CBK	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,500	09.07.2018	128.600	26	147	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	13.900	79	82	0,01
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,650	13.02.2019	14.500	113	38	0,00
FAR	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	29.10.2018	34.500	209	83	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,500	19.11.2018	15.000	19	32	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	23.11.2018	10.000	40	59	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,500	03.12.2018	10.000	30	25	0,00
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	20.000	107	119	0,01
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,440	13.12.2018	10.400	61	33	0,00
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	30.04.2019	902.500	747	756	0,03
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	01.11.2018	165.000	940	387	0,02
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,500	10.12.2018	21.000	63	56	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,800	19.12.2018	32.100	247	263	0,01
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	31.01.2019	20.200	131	67	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,650	04.02.2019	50.000	367	121	0,01
							<b>\$ 3.254</b>	<b>\$ 2.313</b>	<b>0,10</b>

### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,500 %	23.11.2018	\$ 10.000	\$ (18)	\$ (22)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	03.12.2018	10.000	(13)	(9)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	10.12.2018	21.000	(28)	(21)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,500	19.12.2018	32.100	(91)	(94)	(0,01)
							<b>\$ (150)</b>	<b>\$ (146)</b>	<b>(0,01)</b>

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
DUB	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 97,859	05.07.2018	\$ 7.000	\$ (19)	\$ 0	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	99,859	05.07.2018	14.000	(31)	(5)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2048	99,797	06.09.2018	4.500	(14)	(14)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2048	101,828	05.07.2018	30.000	(77)	(61)	0,00
FAR	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01/09/2048	97,555	06.09.2018	10.500	(35)	(10)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2048	99,688	06.09.2018	17.500	(51)	(64)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2048	99,789	06.09.2018	9.000	(25)	(29)	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	101,402	06.08.2018	13.500	(42)	(21)	0,00
FBF	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	98,148	05.07.2018	13.000	(32)	0	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2048	101,824	05.07.2018	80.000	(200)	(164)	(0,01)
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	100,844	06.08.2018	10.000	(16)	(6)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	102,844	06.08.2018	10.000	(12)	(4)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GSC	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 97,633	05.07.2018	\$ 7.000	\$ (20)	\$ 0	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	98,656	05.07.2018	13.000	(49)	0	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	99,176	05.07.2018	35.000	(123)	(135)	(0,01)
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2048	97,703	06.08.2018	6.500	(19)	(2)	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2048	97,828	06.08.2018	8.500	(22)	(3)	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2048	98,648	06.08.2018	12.500	(28)	(17)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2048	99,703	06.08.2018	6.500	(14)	(17)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2048	99,828	06.08.2018	8.500	(16)	(18)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2048	102,141	05.07.2018	16.500	(38)	(8)	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	99,641	06.08.2018	6.500	(17)	0	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	100,000	06.08.2018	7.000	(14)	(1)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	101,641	06.08.2018	13.000	(23)	(55)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	102,000	06.08.2018	7.000	(11)	(16)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.09.2048	102,563	06.09.2018	7.000	(12)	(10)	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	98,656	05.07.2018	13.000	(45)	0	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2048	99,789	06.08.2018	25.000	(52)	(57)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2048	99,023	06.09.2018	35.000	(152)	(244)	(0,01)
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2048	99,031	06.09.2018	10.500	(56)	(73)	(0,01)
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2048	99,047	06.09.2018	17.000	(78)	(116)	(0,01)
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2048	101,898	05.07.2018	20.000	(34)	(31)	0,00
SAL	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	97,969	05.07.2018	6.500	(13)	0	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	99,016	05.07.2018	24.000	(63)	(127)	(0,01)
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	99,227	05.07.2018	24.000	(58)	(83)	(0,01)
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	99,969	05.07.2018	6.500	(12)	(1)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	100,031	05.07.2018	6.500	(10)	(1)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2048	99,609	06.09.2018	16.500	(44)	(65)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2048	99,719	06.09.2018	11.500	(27)	(40)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2048	99,773	06.09.2018	13.500	(30)	(45)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2048	100,016	06.09.2018	13.500	(39)	(34)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2048	101,781	05.07.2018	12.500	(24)	(30)	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	100,094	06.08.2018	11.000	(21)	(1)	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	100,328	06.08.2018	10.500	(17)	(2)	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	100,547	06.08.2018	3.500	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	100,750	06.08.2018	10.000	(18)	(5)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	101,914	06.08.2018	13.000	(21)	(35)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	102,094	06.08.2018	11.000	(18)	(22)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	102,328	06.08.2018	10.500	(15)	(13)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	102,547	06.08.2018	7.000	(7)	(5)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	102,750	06.08.2018	10.000	(14)	(5)	0,00
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.09.2048	101,711	06.09.2018	13.000	(39)	(58)	0,00
					\$ (1.873)	\$ (1.754)	(0,07)

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
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,000 %	17.11.2059	\$ 2.900	\$ (68)	\$ 55	\$ (13)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,000	18.11.2054	9.500	(44)	(44)	(88)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,000	17.09.2058	7.000	(101)	98	(3)	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,000	17.11.2059	500	(11)	9	(2)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,000	18.11.2054	8.200	(43)	(33)	(76)	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,000	17.11.2059	7.100	(3)	(28)	(31)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,000	18.11.2054	4.800	(26)	(19)	(45)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,000	18.11.2054	24.800	(153)	(77)	(230)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	15.300	(190)	48	(142)	(0,01)
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,000	17.11.2059	6.500	(138)	109	(29)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,000	18.11.2054	72.200	(450)	(220)	(670)	(0,03)
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,000	11.05.2063	35.575	235	(2)	233	0,01
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,000	17.09.2058	16.700	17	(23)	(6)	0,00
					\$ (975)	\$ (127)	\$ (1.102)	(0,05)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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
GST	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,695 %	17.08.2018	\$ 145.000	\$ 0	\$ (18)	\$ (18)	0,00
JPS	Zahlung	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,611	05.07.2018	30.000	0	17	17	0,00
	Zahlung	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,623	19.07.2018	109.000	0	56	56	0,00
SAL	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,720	19.11.2018	150.000	0	(12)	(12)	0,00
	Zahlung	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,600	19.07.2018	97.000	0	71	71	0,00
	Zahlung	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,605	19.07.2018	195.000	0	134	134	0,01
	Zahlung	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,605	23.07.2018	25.000	0	18	18	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
	Zahlung	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,640 %	12.07.2018	\$ 40.000	\$ 0	\$ 12	\$ 12	0,00
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,695	16.08.2018	145.000	0	(18)	(18)	0,00
						\$ 0	\$ 260	\$ 260	0,01

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variable Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPS	Erhalt	IOS.FN.600.08 Index	k. A.	1-Month USD-LIBOR	\$ 2.367	12.01.2039	£ 1	\$ 14	\$ 15	0,00

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07/2018	€ 276	\$ 323	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BRC	07/2018	\$ 15.692	£ 12.000	151	0	151	0,01
	08/2018	£ 12.000	\$ 15.714	0	(150)	(150)	(0,01)
CBK	07/2018	12.000	15.898	55	0	55	0,00
GLM	07/2018	€ 2.312	2.701	2	0	2	0,00
HUS	07/2018	32	37	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 43	€ 37	0	0	0	0,00
JPM	07/2018	AUD 906	\$ 682	13	0	13	0,00
	07/2018	\$ 3.114	€ 2.651	0	(19)	(19)	0,00
SCX	07/2018	€ 44.032	\$ 51.009	0	(401)	(401)	(0,01)
SSB	07/2018	\$ 51.184	€ 43.969	152	0	152	0,01
	08/2018	€ 43.969	\$ 51.298	0	(150)	(150)	(0,01)
				\$ 374	\$ (720)	\$ (346)	(0,01)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional BRL (Hedged) Class 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	07/2018	BRL 2.000	\$ 528	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
	07/2018	\$ 664	BRL 2.437	0	(31)	(31)	0,00
	08/2018	526	2.000	0	(8)	(8)	0,00
BPS	07/2018	BRL 3.455	\$ 927	29	0	29	0,00
	08/2018	\$ 924	BRL 3.455	0	(29)	(29)	0,00
CBK	07/2018	BRL 3.310	\$ 876	16	0	16	0,00
	07/2018	\$ 11	BRL 41	0	0	0	0,00
	08/2018	873	3.310	0	(16)	(16)	0,00
DUB	07/2018	BRL 1.998	\$ 530	11	0	11	0,00
	07/2018	\$ 1.450	BRL 5.371	0	(54)	(54)	(0,01)
	09/2018	353	1.348	0	(5)	(5)	0,00
	10/2018	173	650	0	(6)	(6)	0,00
GLM	07/2018	433	1.624	0	(11)	(11)	0,00
JPM	07/2018	BRL 680	\$ 182	5	0	5	0,00
	07/2018	\$ 667	BRL 2.444	0	(32)	(32)	0,00
	08/2018	177	665	0	(5)	(5)	0,00
MSB	07/2018	BRL 4.991	\$ 1.328	31	0	31	0,00
	07/2018	\$ 667	BRL 2.444	0	(31)	(31)	0,00
	08/2018	1.325	4.991	0	(32)	(32)	0,00
SCX	07/2018	565	2.073	0	(27)	(27)	0,00
				£ 100	\$ (287)	\$ (187)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class 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	07/2018	CHF 98	\$ 99	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07/2018	\$ 13.775	CHF 13.567	0	(112)	(112)	(0,01)
BPS	07/2018	CHF 37	\$ 37	0	0	0	0,00
	07/2018	104	CHF 102	0	(1)	(1)	0,00
BRC	07/2018	CHF 24	\$ 25	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 47	CHF 46	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	13.810	13.642	1	(72)	(71)	0,00
GLM	07/2018	CHF 14.187	\$ 14.214	0	(74)	(74)	0,00
	07/2018	\$ 14.033	CHF 13.889	2	(47)	(45)	0,00
	08/2018	14.250	14.187	74	0	74	0,00
JPM	07/2018	CHF 14.118	\$ 14.248	30	0	30	0,00
	07/2018	\$ 1.005	CHF 994	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	14.284	14.118	0	(31)	(31)	0,00
RBC	07/2018	CHF 37	\$ 37	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	1.771	1.776	0	(8)	(8)	0,00
	07/2018	\$ 327	CHF 321	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 108	\$ (352)	\$ (244)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class T EUR (Hedged) und Class Z EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 184.936	€ 157.547	\$ 0	\$ (992)	\$ (992)	(0,04)
BRC	07/2018	€ 59	\$ 69	1	0	1	0,00
CBK	07/2018	\$ 1.470	€ 1.270	14	0	14	0,00
GLM	07/2018	€ 190	\$ 226	3	0	3	0,00
MSB	07/2018	\$ 8.317	€ 7.170	66	(12)	54	0,00
RBC	07/2018	€ 6.521	\$ 7.615	2	0	2	0,00
RYL	07/2018	\$ 636	€ 540	0	(6)	(6)	0,00
SSB	07/2018	€ 167.549	\$ 193.519	0	(2.103)	(2.103)	(0,09)
SCX	07/2018	\$ 193.945	€ 167.549	2.101	0	2.101	0,09
SSB	07/2018	€ 156	\$ 180	0	(1)	(1)	0,00
SSB	07/2018	\$ 7.628	€ 6.549	18	0	18	0,00
SSB	07/2018	€ 216	\$ 251	0	(1)	(1)	0,00
SSB	07/2018	\$ 5.300	€ 4.535	0	(5)	(5)	0,00
SSB	07/2018	€ 193	\$ 226	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	\$ 196.535	€ 169.555	1.475	(45)	1.430	0,06
SSB	07/2018	€ 166.963	\$ 194.361	0	(576)	(576)	(0,02)
SSB	07/2018	\$ 186.456	€ 160.233	624	0	624	0,03
SSB	08/2018	194.793	166.963	568	0	568	0,02
				\$ 4.872	\$ (3.741)	\$ 1.131	0,05

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und die Class Z GBP (Hedged) 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	07/2018	\$ 99	£ 74	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
BOA	07/2018	06.484	79.750	0	(1.194)	(1.194)	(0,05)
BRC	07/2018	£81.566	\$ 106.661	0	(1.027)	(1.027)	(0,04)
CBK	07/2018	\$ 79	£ 59	0	0	0	0,00
GLM	08/2018	06.809	81.566	1.024	0	1.024	0,04
SCX	07/2018	£ 37	\$ 49	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	\$07.093	£ 80.833	0	(373)	(373)	(0,02)
SSB	07/2018	£ 150	\$ 198	0	(1)	(1)	0,00
SSB	07/2018	\$ 1.403	£ 1.052	0	(14)	(14)	0,00
SSB	07/2018	£81.039	\$ 106.521	0	(471)	(471)	(0,02)
SSB	07/2018	\$07.660	£ 80.985	0	(740)	(740)	(0,03)
SSB	08/2018	06.671	81.039	466	0	466	0,02
SSB	07/2018	1.046	783	2	(14)	(12)	0,00
				\$ 1.492	\$ (3.836)	\$ (2.344)	(0,10)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Administrative SGD (Hedged) Class und Class E SGD (Hedged) 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	09/2018	SGD 24	\$ 18	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	09/2018	\$ 4.407	SGD 5.852	0	(108)	(108)	(0,01)
CBK	09/2018	SGD 13	\$ 10	0	0	0	0,00
GLM	09/2018	\$ 3.667	SGD 4.910	0	(60)	(60)	0,00
NGF	09/2018	373	500	0	(6)	(6)	0,00
SSB	09/2018	1.066	1.425	0	(19)	(19)	0,00
SSB	09/2018	59	79	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 0	\$ (194)	\$ (194)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (2.598) (0,11)

#### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
<b>Fannie Mae, TBA</b>			
2,500 % fällig am 01.07.2033	\$ 6.500	\$ (6.318)	(0,27)
2,500 % fällig am 01.08.2033	13.000	(12.626)	(0,53)
3,000 % fällig am 01.08.2048	169.250	(163.809)	(6,92)
3,500 % fällig am 01.07.2048 (h)	70.500	(70.174)	(2,96)
4,000 % fällig am 01.07.2048	66.850	(68.159)	(2,88)
4,000 % fällig am 01.08.2048	153.100	(155.878)	(6,58)
4,500 % fällig am 01.07.2048	11.000	(11.455)	(0,48)
4,500 % fällig am 01.08.2048	44.000	(45.740)	(1,93)
5,500 % fällig am 01.07.2048	2.000	(2.145)	(0,09)
5,500 % fällig am 01.08.2048	5.000	(5.356)	(0,23)
<b>Freddie Mac, TBA</b>			
3,500 % fällig am 01.07.2048	5.700	(5.671)	(0,24)
4,000 % fällig am 01.07.2048	17.600	(17.940)	(0,76)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Ginnie Mae, TBA			
3,000 % fällig am 01.07.2048	\$ 42.500	\$ (41.583)	(1,76)
3,500 % fällig am 01.07.2048	18.000	(18.071)	(0,76)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (624.925)</b>	<b>(26,39)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 2.790.717</b>	<b>117,88</b>
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (423.194)	(17,88)
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 2.367.523</b>	<b>100,00</b>

## 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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Reines Kapitalwertpapier.

(c) Wertpapier per Emissionstermin.

(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) Zum 30. Juni 2018 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von UzSD 600.929 als Sicherheiten verpfändet.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 24.791 als Sicherheiten verpfändet.

(k) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 7.161 und Barmittel in Höhe von USD 10.598 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsengehandelte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 11.500 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(l) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
RDR	2,220 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 13.300	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.01.2022	\$ (13.579)	\$ 13.300	\$ 13.302	0,56
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	24.122	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	(24.612)	24.122	24.122	1,02
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (38.191)</b>	<b>\$ 37.422</b>	<b>\$ 37.424</b>	<b>1,58</b>

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 230.458	\$ 3.082.745	\$ 99.811	\$ 3.413.014
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(393)	3.021	0	2.628
Leerverkäufe	0	(624.925)	0	(624.925)
<b>Summen</b>	<b>\$ 230.065</b>	<b>\$ 2.460.841</b>	<b>\$ 99.811</b>	<b>\$ 2.790.717</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 22.501	\$ 2.226.556	\$ 1.225	\$ 2.250.282
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	5	4.882	0	4.887
Leerverkäufe	0	(653.276)	0	(653.276)
<b>Summen</b>	<b>\$ 22.506</b>	<b>\$ 1.578.162</b>	<b>\$ 1.225</b>	<b>\$ 1.601.893</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 der Wertpapieranlagen.

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	2,050 %	08.06.2018	16.07.2018	\$ (49.500)	\$ (49.565)	(2,09)
	2,100	29.06.2018	23.07.2018	(30.700)	(30.704)	(1,30)
	2,170	12.06.2018	12.07.2018	(32.233)	(32.270)	(1,36)
	2,170	26.06.2018	12.07.2018	(6.991)	(6.993)	(0,29)
	2,180	20.06.2018	12.07.2018	(15.086)	(15.096)	(0,64)
	2,180	22.06.2018	23.07.2018	(9.204)	(9.209)	(0,39)
	2,200	26.06.2018	26.07.2018	(4.782)	(4.783)	(0,20)
	2,250	22.06.2018	23.07.2018	(3.711)	(3.713)	(0,16)
NOM	2,200	13.06.2018	12.07.2018	(293.696)	(294.019)	(12,42)
SCX	2,120	05.06.2018	06.08.2018	(97.660)	(97.810)	(4,13)
	2,130	24.05.2018	24.08.2018	(44.886)	(44.987)	(1,90)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (589.149)</b>	<b>(24,88)</b>

## Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkaufgeschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
NOM	2,010 %	01.06.2018	06.07.2018	\$ (24.998)	\$ (25.040)	(1,06)
<b>Summe Rückkaufgeschäfte</b>					<b>\$ (25.040)</b>	<b>(1,06)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 7 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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (2)	\$ 0	\$ (2)
BOA	(2.435)	5.450	3.015
BPS	44	0	44
BRC	13	0	13
CBK	(125)	1.020	895
DUB	(238)	(90)	(328)
FAR	44	(280)	(236)
FBF	(252)	200	(52)
GLM	40	(30)	10
GSC	(282)	440	158
GST	(94)	0	(94)
JPM	(531)	600	69
JPS	76	(310)	(234)
MSB	(34)	0	(34)
MYC	1.163	(2.106)	(943)
MYI	0	(340)	(340)
NGF	(19)	0	(19)
RBC	17	0	17
RYL	(6)	0	(6)
SAL	(828)	470	(358)
SCX	257	1.810	2.067
SSB	594	1.240	1.834

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	42,03	13,75
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	38,84	124,37
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	63,29	13,45
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,24	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,11)	0,31
Leerverkaufte Wertpapiere	(26,39)	(44,00)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(24,88)	(18,97)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(1,06)	(1,30)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Mortgage Opportunities Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		
	PARI (000S)			PARI (000S)	
<b>Fannie Mae</b> 3,500 % fällig am 01.02.2048	\$ 174.544	173.729	<b>Fannie Mae</b> 0,000 % fällig am 01.08.2047	\$ 147.571	150.983
<b>Freddie Mac Gold Pool</b> 3,500 % fällig am 01.11.2047	141.000	140.444	<b>Freddie Mac Gold Pool</b> 3,500 % fällig am 01.11.2047	139.829	138.896
<b>Japan Treasury Bills</b> 2,750 % fällig am 28.02.2025	86.000	85.773	<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,250 % fällig am 31.10.2024	89.100	86.478
<b>Fannie Mae</b> 3,500 % fällig am 01.12.2047	74.723	74.373	<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,750 % fällig am 28.02.2025	71.300	71.135
<b>Freddie Mac Gold Pool</b> 3,500 % fällig am 01.03.2048	62.991	62.834	<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.06.2047	63.632	65.061
<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,375 % fällig am 31.01.2023	58.900	58.199	<b>Freddie Mac Gold Pool</b> 3,500 % fällig am 01.03.2048	62.409	61.902
<b>Freddie Mac Gold Pool</b> 3,500 % fällig am 01.12.2047	54.000	53.787	<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,250 % fällig am 31.12.2024	54.500	53.377
<b>Japan Treasury Bills</b> 2,250 % fällig am 31.12.2024	54.500	53.503	<b>Freddie Mac Gold Pool</b> 3,500 % fällig am 01.12.2047	53.423	52.993
<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,750 % fällig am 15.02.2028	41.300	40.898	<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,875 % fällig am 15.05.2028	36.900	36.410
<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,875 % fällig am 15.05.2028	36.900	36.379	<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.10.2047	34.642	35.281
<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,500 % fällig am 31.01.2025	29.200	28.662	<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,500 % fällig am 31.01.2025	26.200	25.697
<b>Freddie Mac Strips</b> 2,257 % fällig am 15.10.2037	28.316	28.316	<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,250 % fällig am 15.08.2027	25.000	23.674
<b>Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust</b> 2,331 % fällig am 25.04.2037	34.093	25.697	<b>Freddie Mac Gold Pool</b> 3,500 % fällig am 01.03.2048	19.214	19.166
<b>Ginnie Mae</b> 2,384 % fällig am 20.08.2046	24.267	24.242	<b>Ginnie Mae</b> 0,000 % fällig am 20.08.2047	18.672	19.150
<b>U.S. Capital Funding Ltd.</b> 2,617 % fällig am 10.07.2043	25.247	21.460	<b>Ginnie Mae II Pool</b> 3,000 % fällig am 20.03.2048	19.054	18.674
<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b> 2,216 % fällig am 25.07.2036	24.525	21.444	<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,625 % fällig am 28.02.2023	18.000	18.036
<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b> 3,141 % fällig am 25.08.2037	22.066	20.280	<b>Fannie Mae</b> 4,000 % fällig am 01.05.2047	17.141	17.526
<b>Japan Treasury Bills</b> 2,250 % fällig am 31.10.2024	20.000	19.394	<b>U.S. Treasury Notes</b> 2,750 % fällig am 15.02.2028	16.300	16.154
<b>Freddie Mac Gold Pool</b> 3,500 % fällig am 01.03.2048	19.214	19.138	<b>Fannie Mae</b> 3,500 % fällig am 01.02.2048	13.943	13.825

(a) Der Mortgage Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund

30. Juni 2018

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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>ENERGIE</b>				<b>Chongqing Rural Commercial Bank Co. Ltd. 'H'</b>			
<b>STAMMAKTIEN</b>				<b>FINANZWERTE</b>				<b>CSC Financial Co. Ltd. 'H'</b>			
<b>BRASILILIEN</b>				<b>Empresas COPEC S.A.</b>				<b>Industrial &amp; Commercial Bank of China Ltd. 'H'</b>			
<b>LUXUSGÜTER</b>				<b>Banco Santander Chile ADR</b>				<b>People's Insurance Co. Group of China Ltd. 'H'</b>			
Grendene S.A.	9.000	\$ 19	0,03	Sociedad Matriz del Banco de Chile S.A. 'B'	1.760	56	0,08	PICC Property & Casualty Co. Ltd. 'H'	357.000	167	0,26
Guararapes Confeccoes S.A.	400	10	0,02		106.350	51	0,08	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'	36.000	39	0,06
MRV Engenharia e Participacoes S.A.	4.600	14	0,02			107	0,16	Postal Savings Bank of China Co. Ltd. 'H'	32.500	298	0,46
Via Varejo S.A.	15.400	74	0,11						379.000	246	0,38
		117	0,18							8.304	12,69
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>				<b>BAUSTOFFE</b>				<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
BRF S.A. (a)	6.800	32	0,05	Antofagasta PLC	5.493	71	0,11	China Resources Pharmaceutical Group Ltd.	82.500	114	0,17
JBS S.A.	78.200	189	0,29	CAP S.A.	5.916	59	0,09	Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd.	63.000	14	0,02
Marfrig Global Foods S.A. (a)	39.100	83	0,12	Empresas CMPC S.A.	27.524	101	0,15	Sinopharm Group Co. Ltd.	4.800	19	0,03
Natura Cosmeticos S.A.	8.200	64	0,10			231	0,35			147	0,22
		368	0,56								
<b>ENERGIE</b>				<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
Petroleo Brasileiro S.A. SP - ADR	33.200	333	0,51	Enel Chile S.A.	355.703	35	0,06	Air China Ltd. 'H'	34.000	33	0,05
<b>FINANZWERTE</b>				<b>CHINA LUXUSGÜTER</b>				<b>China Eastern Airlines Corp. Ltd. 'H'</b>			
Banco Bradesco S.A. ADR	32.650	224	0,34	Dongfeng Motor Group Co. Ltd. 'H'	50.000	53	0,08	China Lesho Group Holdings Ltd.	29.000	28	0,04
Banco BTG Pactual S.A.	9.100	44	0,07	GOME Retail Holdings Ltd.	440.000	45	0,07	China Railway Construction Corp. Ltd. 'H'	38.000	25	0,04
Banco do Brasil S.A.	43.100	321	0,49	Great Wall Motor Co. Ltd. 'H'	10.500	8	0,01	China Railway Group Ltd. 'H'	33.000	21	0,03
Itau Unibanco Holding S.A. SP - ADR 'H'	29.348	305	0,47	Shanghai Jin Jiang International Hotels Group Co. Ltd.	46.000	18	0,03	China Southern Airlines Co. Ltd. 'H'	17.500	18	0,03
Porto Seguro S.A.	1.800	19	0,03			124	0,19	China Southern Railway Group Ltd. 'H'	17.000	13	0,02
Sul America S.A.	7.392	35	0,05			209	0,32	China Southern Railway Holdings Co. Ltd. (a)	106.000	83	0,13
		948	1,45					Dongfang Electric Corp. Ltd. 'H'	3.793	5	0,01
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>ENERGIE</b>				<b>Dongfang Electric Corp. Ltd. 'H'</b>			
Embraer S.A. SP - ADR	2.348	58	0,09	Hengan International Group Co. Ltd.	2.000	19	0,03	Fosun International Ltd.	15.200	10	0,01
<b>BAUSTOFFE</b>				<b>China Oilfield Services Ltd. 'H'</b>				<b>Harbin Electric Co. Ltd. 'H'</b>			
Cia Siderurgica Nacional S.A. SP - ADR (a)	34.365	70	0,11	China Petroleum & Chemical Corp. 'H'	62.000	58	0,09	Sinopec Engineering Group Co. Ltd. 'H'	10.000	19	0,03
Duratex S.A.	4.500	10	0,01	China Shenhua Energy Co. Ltd. 'H'	734.000	657	1,00	Sinotrans Ltd. 'H'	86.000	25	0,04
Fibra Celulose S.A. - ADR	5.506	102	0,16	CNOOC Ltd.	142.000	336	0,51	Sinotruk Hong Kong Ltd.	56.500	59	0,09
Gerdau S.A. SP - ADR	2.513	9	0,01	PetroChina Co. Ltd. 'H'	619.000	1.061	1,62	Weichai Power Co. Ltd. 'H'	73.000	38	0,06
Vale S.A.	52.142	672	1,03	Yanzhou Coal Mining Co. Ltd. 'H'	450.000	343	0,53	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.	49.500	81	0,12
		863	1,32		18.000	23	0,04	Zhejiang Expressway Co. Ltd. 'H'	25.000	34	0,05
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				<b>FINANZWERTE</b>				<b>Zhejiang Expressway Co. Ltd. 'H'</b>			
Telefonica Brasil S.A. ADR	2.075	25	0,03	Agricultural Bank of China Ltd. 'H'	1.300.000	607	0,93	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co. Ltd. 'H'	76.900	51	0,08
TIM Participacoes S.A. ADR	3.474	58	0,09	Bank of China Ltd. 'H'	2.868.000	1.422	2,17		58.000	52	0,08
		83	0,12	Bank of Chongqing Co. Ltd. 'H'	45.000	28	0,04		54.000	23	0,03
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>ENERGIE</b>				<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
AES Tiete Energia S.A.	12.700	32	0,05	China Cinda Asset Management Co. Ltd. 'H'	371.000	284	0,43	AVIC International Holdings Ltd.	26.000	15	0,02
Cia de Saneamento de Minas Gerais - COPASA	1.400	15	0,02	China CITIC Bank Corp. Ltd. 'H'	108.000	35	0,05	Changyou.com Ltd. ADR	772	13	0,02
Cia Energetica de Minas Gerais SP - ADR	94.647	174	0,27	China Construction Bank Corp. 'H'	387.000	242	0,37	Fang Holdings Ltd. ADR (a)	2.838	11	0,02
Light S.A.	10.700	31	0,05	China Everbright Bank Co. Ltd. 'H'	2.925.000	2.677	4,09	FIH Mobile Ltd.	114.000	18	0,03
Transmissora Alianca de Energia Eletrica S.A.	3.200	16	0,02	China Huarong Asset Management Co. Ltd. 'H'	119.000	51	0,08	Legend Holdings Corp. 'H'	34.300	104	0,16
		268	0,41	China Life Insurance Co. Ltd. 'H'	286.000	82	0,13	Lenovo Group Ltd.	500.000	269	0,41
Summe Brasilien		3.038	4,64	China Merchants Bank Co. Ltd. 'H'	33.000	85	0,13	Sohu.com Ltd. ADR (a)	1.773	63	0,09
<b>CHILE</b>				<b>China Minsheng Banking Corp. Ltd. 'H'</b>				<b>BAUSTOFFE</b>			
<b>LUXUSGÜTER</b>				<b>China Merchants Bank Co. Ltd. 'H'</b>				<b>Anhui Conch Cement Co. Ltd. 'H'</b>			
Ripley Corp. S.A.	49.132	47	0,07		61.000	224	0,34	China BlueChemical Ltd. 'H'	9.500	54	0,08
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>				<b>China Minsheng Banking Corp. Ltd. 'H'</b>				<b>China BlueChemical Ltd. 'H'</b>			
Cencosud S.A.	29.780	74	0,11		267.700	191	0,29	China Hongqiao Group Ltd.	176.000	64	0,10
									17.000	16	0,02

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund (Forts.)

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
<b>BESCHREIBUNG</b>											
China National Building Material Co. Ltd. 'H'	755.550	\$ 744	1,14	Motor Oil Hellas Corinth Refineries S.A.	884	\$ 18	0,03	Shenzhen Investment Ltd.	140.000	\$ 51	0,08
China Zhongwang Holdings Ltd.	121.600	64	0,10			45	0,07	Yuexiu Property Co. Ltd.	810.000	154	0,24
Jiangxi Copper Co. Ltd. 'H'	10.000	13	0,02							671	1,03
		955	1,46								
<b>IMMOBILIEN</b>				<b>FINANZWERTE</b>				<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Agile Group Holdings Ltd.	142.000	242	0,37	Alpha Bank AE (a)	135.448	302	0,46	China Mobile Ltd.	81.000	719	1,10
Beijing Capital Land Ltd. 'H'	74.000	32	0,05	Eurobank Ergasias S.A. (a)	9.951	10	0,02	China Unicom Hong Kong Ltd.	242.000	302	0,46
Central China Real Estate Ltd.	58.000	27	0,04	National Bank of Greece S.A. (a)	794.947	242	0,37			1.021	1,56
China Aoyuan Property Group Ltd.	24.000	17	0,03	Piraeus Bank S.A. (a)	43.069	146	0,22				
China Evergrande Group	18.000	46	0,07			700	1,07	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
China Vanke Co. Ltd. 'H'	7.300	25	0,04	<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				China Power International Development Ltd.	541.000	125	0,19
CIFI Holdings Group Co. Ltd.	18.000	11	0,02	Hellenic Telecommunications Organization S.A.	7.589	94	0,14	China Resources Power Holdings Co. Ltd.	134.000	235	0,36
Country Garden Holdings Co. Ltd.	33.000	58	0,09						360	0,55	
Fantasia Holdings Group Co. Ltd.	183.000	30	0,05	Public Power Corp. S.A.	8.337	18	0,03	Summe Hongkong		3.734	5,71
Future Land Development Holdings Ltd.	64.000	58	0,09	Summe Griechenland		950	1,45				
Greentown China Holdings Ltd.	69.500	93	0,14	<b>HONGKONG</b>				<b>INDIEN</b>			
Guangzhou R&F Properties Co. Ltd. 'H'	82.000	165	0,25	<b>LUXUSGÜTER</b>				Tata Motors Ltd. ADR (a)	10.006	196	0,30
Kaisa Group Holdings Ltd.	109.000	46	0,07	China Travel International Investment Hong Kong Ltd.	114.000	44	0,07	<b>ENERGIE</b>			
KWG Property Holding Ltd.	92.500	115	0,18	Dah Chong Hong Holdings Ltd.	46.000	23	0,03	Reliance Industries Ltd. GDR	9.280	261	0,40
Logan Property Holdings Co. Ltd.	16.000	21	0,03			67	0,10	<b>FINANZWERTE</b>			
Longfor Properties Co. Ltd.	20.500	55	0,08	<b>BASISKONSUMGÜTER</b>				ICICI Bank Ltd. ADR	14.520	116	0,17
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	88.000	47	0,07	China Agri-Industries Holdings Ltd.	99.000	38	0,06	State Bank of India GDR	6.450	242	0,37
Red Star Macalline Group Corp. Ltd. 'H'	9.400	13	0,02	China Resources Beer Holdings Co. Ltd.	80.000	387	0,59			358	0,54
Shui On Land Ltd.	363.000	92	0,14			425	0,65	<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
Sino-Ocean Group Holding Ltd.	215.500	125	0,19	<b>ENERGIE</b>				Infosys Ltd. SP - ADR	5.658	110	0,17
SOHO China Ltd.	265.500	126	0,19	Kunlun Energy Co. Ltd.	132.000	115	0,18	Tata Steel Ltd. GDR	13.631	113	0,17
Times China Holdings Ltd.	26.000	39	0,06					Vedanta Ltd. ADR	11.920	162	0,25
Yuzhou Properties Co. Ltd.	115.000	68	0,10	<b>FINANZWERTE</b>				Vedanta Resources PLC	7.686	65	0,10
		1.551	2,37	BOC Hong Kong Holdings Ltd.	36.000	169	0,26			340	0,52
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				China Everbright Ltd.	10.000	18	0,03	Summe Indien		1.265	1,93
China Communications Services Corp. Ltd. 'H'	132.000	83	0,13	China Taiping Insurance Holdings Co. Ltd.	64.400	200	0,30				
China Telecom Corp. Ltd. 'H'	716.000	336	0,51	Far East Horizon Ltd.	13.000	13	0,02	<b>INDONESIEN</b>			
		419	0,64			400	0,61	<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Indofood Sukses Makmur Tbk PT	53.200	25	0,04
Beijing Jingneng Clean Energy Co. Ltd. 'H'	138.000	32	0,05	China Merchants Port Holdings Co. Ltd.	12.000	24	0,04	<b>ENERGIE</b>			
China Longyuan Power Group Corp. Ltd. 'H'	59.000	47	0,07	CITIC Ltd.	196.000	276	0,42	Adaro Energy Tbk PT	242.800	30	0,05
Datang International Power Generation Co. Ltd. 'H' (a)	314.000	96	0,15	COSCO SHIPPING Ports Ltd.	96.000	80	0,12	Bukit Asam Tbk PT	92.800	26	0,04
Huadian Fuxin Energy Corp. Ltd. 'H'	210.000	49	0,07	Shanghai Industrial Holdings Ltd.	38.000	88	0,13	Indo Tambangraya Megah Tbk PT	44.400	69	0,10
Huadian Power International Corp. Ltd. 'H'	240.000	95	0,15	Shenzhen International Holdings Ltd.	10.000	21	0,03	United Tractors Tbk PT	18.300	40	0,06
Huaneng Power International, Inc. 'H'	320.000	211	0,32	Tianjin Port Development Holdings Ltd.	100.000	12	0,02			165	0,25
		530	0,81			501	0,76	<b>FINANZWERTE</b>			
Summe China		15.834	24,19	<b>BAUSTOFFE</b>				Bank CIMB Niaga Tbk PT	270.000	18	0,03
<b>GRIECHENLAND</b>				China Resources Cement Holdings Ltd.	116.000	117	0,18	Bank Danamon Indonesia Tbk PT	61.500	27	0,04
<b>LUXUSGÜTER</b>				Shougang Fushan Resources Group Ltd.	240.000	57	0,09	Bank Mandiri Persero Tbk PT	121.200	58	0,09
FF Group (a)	1.196	7	0,01			174	0,27	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	87.200	43	0,07
OPAP S.A.	7.638	86	0,13	<b>IMMOBILIEN</b>				Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	341.800	68	0,10
		93	0,14	China Jinmao Holdings Group Ltd.	256.000	128	0,20	Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT	77.500	13	0,02
<b>ENERGIE</b>				China Overseas Grand Oceans Group Ltd.	89.000	33	0,05			227	0,35
Hellenic Petroleum S.A.	3.287	27	0,04	China Overseas Land & Investment Ltd.	24.000	79	0,12	<b>BAUSTOFFE</b>			
				China Overseas Land Ltd.	34.000	114	0,17	Indah Kiat Pulp & Paper Corp. Tbk PT	123.900	161	0,25
				Joy City Property Ltd.	122.000	15	0,02	Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT	22.300	21	0,03
				Poly Property Group Co. Ltd.	236.000	97	0,15	Semen Indonesia Persero Tbk PT	38.200	19	0,03
										201	0,31

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>								<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	67.800	\$ 18	0,03	Grupo Bimbo S.A.B. de C.V. 'A'	14.600	\$ 29	0,04	Asseco Poland S.A.	1.457	\$ 15	0,02
XL Axiata Tbk PT	59.200	10	0,01	Kimberly-Clark de Mexico S.A.B. de C.V. 'A'	7.200	12	0,02	<b>BAUSTOFFE</b>			
		28	0,04	Wal-Mart de Mexico S.A.B. de C.V.	16.500	44	0,07	Grupa Azoty S.A.	1.010	12	0,02
								KGHM Polska Miedz S.A.			
								153			
								0,23			
<b>VERSORGNUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>FINANZWERTE</b>				<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Perusahaan Gas Negara Persero Tbk	334.500	46	0,07	Banco Santander Mexico S.A.				Orange Polska S.A.	72.917	90	0,14
Summe Indonesien		692	1,06	Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand ADR	4.400	30	0,05	PLAY Communications S.A.	2.075	14	0,02
								104			
								0,16			
<b>MALAYSIA LUXUSGÜTER</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>VERSORGNUNGSUNTERNEHMEN</b>			
Astro Malaysia Holdings Bhd.	49.700	20	0,03	Alfa S.A.B. de C.V. 'A'	134.100	157	0,24	Enea S.A.	16.500	40	0,06
DRB-Hicom Bhd.	126.400	61	0,09	Grupo Aeromexico S.A.B. de C.V. (a)	15.900	22	0,03	Energia S.A.	22.315	53	0,08
Genting Bhd.	31.800	66	0,10					PGE Polska Grupa Energetyczna S.A. (a)	38.868	97	0,15
UMW Holdings Bhd.	16.000	24	0,04					Tauron Polska Energia S.A.	96.911	59	0,09
		171	0,26					249			
								0,38			
								1.167			
								1,78			
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>				<b>JAUSTOFFE</b>				<b>RUSSLAND LUXUSGÜTER</b>			
British American Tobacco Malaysia Bhd.	7.200	62	0,10	Cemex S.A.B. de C.V. SP - ADR (a)	27.523	180	0,28	M.Video PJSC	2.800	18	0,03
Felda Global Ventures Holdings Bhd.	92.800	35	0,05	Grupo Mexico S.A.B. de C.V. 'B'	29.600	85	0,13	<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
		97	0,15					Magnit PJSC	233	17	0,02
								XS Retail Group NV GDR			
								2.653			
								87			
								0,13			
<b>ENERGIE</b>				<b>PHILIPPINEN FINANZWERTE</b>				<b>ENERGIE</b>			
Sapura Energy Bhd. (a)	444.400	70	0,11	Metropolitan Bank & Trust Co.	2.691	4	0,01	Gazprom Neft PJSC SP - ADR	2.088	54	0,08
								Gazprom PJSC SP - ADR			
								500.091			
								2.196			
								3,36			
<b>FINANZWERTE</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
Alliance Bank Malaysia Bhd.	11.900	12	0,02	Alliance Global Group, Inc. (a)	137.700	30	0,05	Mail.Ru Group Ltd. SP - GDR (a)	1.245	36	0,06
AMMB Holdings Bhd.	77.700	72	0,11	DHCI Holdings, Inc.	97.800	19	0,03	<b>BAUSTOFFE</b>			
CIMB Group Holdings Bhd.	92.800	125	0,19	San Miguel Corp.	10.560	27	0,04	Evrax PLC	14.679	98	0,15
Malayan Banking Bhd.	95.000	212	0,32					Mechel PJSC SP - ADR	18.647	58	0,09
Public Bank Bhd.	8.900	51	0,08					MMC Norilsk Nickel PJSC ADR	18.116	327	0,50
RHB Bank Bhd.	29.500	40	0,06					Polyus PJSC GDR	644	21	0,03
		512	0,78					Severstal PJSC GDR			
								6.483			
								95			
								0,14			
								599			
								0,91			
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
AirAsia Group Bhd.	74.600	55	0,08	Globe Telecom, Inc.	970	28	0,04	MegaFon PJSC SP - GDR	18.999	168	0,25
Berjaya Corp. Bhd. (a)	213.600	16	0,03	PLDT, Inc.	5.830	140	0,21	Mobile TeleSystems PJSC	73.570	326	0,50
IJM Corp. Bhd.	27.500	12	0,02					Rostelecom PJSC	82.790	97	0,15
Sime Darby Bhd.	44.800	27	0,04								
		110	0,17								
<b>IMMOBILIEN</b>				<b>POLEN ENERGIE</b>							
Sime Darby Property Bhd.	14.600	4	0,01	Grupa Lotos S.A.	2.578	39	0,06				
Sunway Bhd.	119.800	46	0,07	Polski Koncern Naftowy ORLEN S.A.	1.824	41	0,06				
		50	0,08	Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo S.A.	50.294	77	0,12				
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				<b>FINANZWERTE</b>							
Axiata Group Bhd.	46.000	44	0,07	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	1.472	28	0,04				
Maxis Bhd.	8.200	11	0,01	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	4.691	141	0,22				
Telekom Malaysia Bhd.	40.400	31	0,05	Getin Noble Bank S.A. (a)	83.272	22	0,03				
		86	0,13	Powszechna Kasa Oszczedności Bank Polski S.A.	13.472	132	0,20				
<b>VERSORGNUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>FINANZWERTE</b>							
Malakoff Corp. Bhd.	146.200	30	0,04	Powszechny Zakład Ubezpieczeń S.A.	15.963	166	0,26				
Tenaga Nasional Bhd.	23.000	83	0,13								
YTL Corp. Bhd.	234.450	65	0,10								
YTL Power International Bhd.	80.892	21	0,03								
		199	0,30								
<b>MEXIKO BASISKONSUMGÜTER</b>											
Coca-Cola Femsca S.A.B. de C.V. SP - ADR	219	13	0,02								
Fomento Economico Mexicano S.A.B. de C.V. SP - ADR	637	56	0,09								

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund (Forts.)

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
Sistema PJSC FC SP - GDR	38.007	\$ 104	0,16	Hankook Tire Co. Ltd.	1.149	\$ 43	0,07	LG Corp.	161	\$ 10	0,02
		695	1,06	Hotel Shilla Co. Ltd.	180	20	0,03	LS Corp.	1.473	99	0,15
				Hyundai Department Store Co. Ltd.	967	100	0,15	SK Holdings Co. Ltd.	77	18	0,03
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				Hyundai Mobis Co. Ltd.	422	80	0,12	SK Networks Co. Ltd.	20.344	82	0,12
Federal Grid Co. Unified Energy				Hyundai Motor Co.	6.531	734	1,12			1.189	1,82
System PJSC	16.100.000	48	0,08	Hyundai Wia Corp.	1.461	53	0,08	<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
Inter RAO UES PJSC	206.000	13	0,02	Kia Motors Corp.	14.667	405	0,62	LG Display Co. Ltd.	11.231	184	0,28
Mosenergo PJSC	561.000	21	0,03	Kumho Tire Co., Inc. (a)	22.970	130	0,20	LG Innotek Co. Ltd.	272	35	0,05
Rosseti PJSC	6.262.007	79	0,12	LG Electronics, Inc.	6.614	493	0,75	Samsung Electro-Mechanics Co. Ltd.	536	72	0,11
RusHydro PJSC	2.972.000	32	0,05	LOTTE Himart Co. Ltd.	690	49	0,07	Samsung Electronics Co. Ltd.	51.739	2.167	3,31
Unipro PJSC	582.000	27	0,04	Lotte Shopping Co. Ltd.	1.081	204	0,31	Samsung SDI Co. Ltd.	72	14	0,02
		220	0,34	Mando Corp.	280	10	0,02	SK Hynix, Inc.	3.219	247	0,38
Summe Russland		6.460	9,87	Shinsegae, Inc.	451	162	0,25			2.719	4,15
						2.627	4,01				
<b>SINGAPUR</b>				<b>BASISKONSUMGÜTER</b>				<b>BAUSTOFFE</b>			
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				CJ CheilJedang Corp.	141	45	0,07	Dongkuk Steel Mill Co. Ltd.	7.091	54	0,08
BOC Aviation Ltd.	2.200	14	0,02	E-MART, Inc.	797	182	0,28	Hanwha Chemical Corp.	710	14	0,02
<b>SÜDAFRIKA</b>				Hite Jinro Co. Ltd.	3.340	59	0,09	Hyosung Corp.	232	28	0,04
<b>LUXUSGÜTER</b>				KT&G Corp.	587	56	0,08	Hyundai Steel Co.	3.609	170	0,26
Imperial Holdings Ltd.	5.104	73	0,11			342	0,52	Kolon Industries, Inc.	935	57	0,09
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>				<b>ENERGIE</b>				LG Chem Ltd.	279	83	0,13
Massmart Holdings Ltd.	2.730	22	0,03	GS Holdings Corp.	2.229	109	0,17	OCI Co. Ltd.	136	12	0,02
<b>ENERGIE</b>				SK Innovation Co. Ltd.	650	118	0,18	POSCO	2.108	622	0,95
Exxaro Resources Ltd.	2.688	25	0,04			227	0,35	Taekwang Industrial Co. Ltd.	24	30	0,05
				<b>FINANZWERTE</b>						1.070	1,64
<b>FINANZWERTE</b>				BNK Financial Group, Inc.	15.935	134	0,21	<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Barclays Africa Group Ltd.	27.058	314	0,48	DGB Financial Group, Inc.	14.080	130	0,20	KT Corp. SP - ADR	41.243	548	0,84
FirstRand Ltd.	14.960	70	0,11	Dongbu Insurance Co. Ltd.	294	16	0,02	LG Uplus Corp.	21.048	264	0,40
Investec Ltd.	17.976	126	0,19	Hana Financial Group, Inc.	11.016	423	0,65	SK Telecom Co. Ltd. SP - ADR	15.957	372	0,57
Liberty Holdings Ltd.	13.241	112	0,17	Hanwha Life Insurance Co. Ltd.	35.964	171	0,26			1.184	1,81
MMI Holdings Ltd.	54.530	70	0,11	Hyundai Marine & Fire Insurance				<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
Nedbank Group Ltd.	6.795	124	0,19	Co. Ltd.	2.389	72	0,11	Korea Electric Power Corp.	18.122	520	0,79
Standard Bank Group Ltd.	22.063	308	0,47	Industrial Bank of Korea	20.159	278	0,43	Korea Gas Corp.	3.132	180	0,28
		1.124	1,72	ING Life Insurance Korea Ltd.	517	19	0,03			700	1,07
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>				JB Financial Group Co. Ltd.	6.690	33	0,05	Summe Südkorea		13.129	20,06
Life Healthcare Group Holdings Ltd.	18.912	34	0,05	KB Financial Group, Inc.	6.448	304	0,46	<b>TAIWAN</b>			
Netcare Ltd.	33.936	68	0,11	Korea Investment Holdings Co. Ltd.	280	21	0,03	<b>LUXUSGÜTER</b>			
		102	0,16	Meritz Financial Group, Inc.	1.430	17	0,03	Cheng Shin Rubber Industry Co. Ltd.	48.000	72	0,11
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Meritz Fire & Marine Insurance				Far Eastern Department Stores Ltd.	31.000	20	0,03
Barlworld Ltd.	13.165	124	0,19	Co. Ltd.	1.810	31	0,05	Pou Chen Corp.	96.000	112	0,17
<b>BAUSTOFFE</b>				Mirae Asset Life Insurance Co. Ltd.	8.919	45	0,07	Ruentex Industries Ltd.	36.000	73	0,11
African Rainbow Minerals Ltd.	3.130	25	0,04	Samsung Card Co. Ltd.	1.960	67	0,10	Yulon Motor Co. Ltd.	56.000	39	0,06
Gold Fields Ltd. SP - ADR	37.500	134	0,20	Samsung Fire & Marine Insurance						316	0,48
Impala Platinum Holdings Ltd. (a)	19.634	29	0,04	Co. Ltd.	386	92	0,14	<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
Kumba Iron Ore Ltd.	8.783	188	0,29	Samsung Life Insurance Co. Ltd.	2.326	205	0,31	Uni-President Enterprises Corp.	56.320	143	0,22
Mondi Ltd.	4.197	114	0,17	Shinhan Financial Group Co. Ltd.	14.419	558	0,85	<b>FINANZWERTE</b>			
Nampak Ltd. (a)	57.595	66	0,10	Tongyang Life Insurance Co. Ltd.	4.060	27	0,04	Cathay Financial Holding Co. Ltd.	84.000	148	0,23
Sappi Ltd.	1.595	10	0,02	Woori Bank	29.362	428	0,65	Chailase Holding Co. Ltd.	14.000	46	0,07
Sasol Ltd.	18.072	658	1,01			3.071	4,69	Chang Hwa Commercial Bank Ltd.	64.000	37	0,06
		1.224	1,87	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				China Development Financial	312.000	114	0,17
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				Asiana Airlines, Inc. (a)	18.910	70	0,11	Holding Corp.	185.142	195	0,30
MTN Group Ltd.	53.222	419	0,64	CJ Corp.	1.004	128	0,20	China Life Insurance Co. Ltd.	121.000	87	0,13
Telkom S.A. SOC Ltd.	21.754	78	0,12	Daewoo Engineering &				CTBC Financial Holding Co. Ltd.	111.780	75	0,11
Vodacom Group Ltd.	3.340	30	0,04	Construction Co. Ltd. (a)	3.180	17	0,03	First Financial Holding Co. Ltd.	75.000	125	0,19
		527	0,80	Doosan Bobcat, Inc.	626	18	0,03	Fubon Financial Holding Co. Ltd.	111.350	65	0,10
Summe Südafrika		3.221	4,92	Doosan Corp.	1.148	107	0,16	Hua Nan Financial Holdings Co. Ltd.	161.380	142	0,22
<b>SÜDKOREA</b>				Doosan Heavy Industries &				Mega Financial Holding Co. Ltd.			
<b>LUXUSGÜTER</b>				Construction Co. Ltd.	12.172	171	0,26				
CJ O Shopping Co. Ltd.	574	144	0,22	Doosan Infracore Co. Ltd. (a)	17.023	148	0,23				
				Hyundai Engineering &							
				Construction Co. Ltd.	1.839	95	0,14				
				KCC Corp.	161	47	0,07				
				Korean Air Lines Co. Ltd.	7.054	179	0,27				

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>	<b>AKTIEN</b>	<b>MARKT-WERT (000\$)</b>	<b>% DES NETTO- VERMÖ- GENS</b>	<b>BESCHREIBUNG</b>	<b>AKTIEN</b>	<b>MARKT-WERT (000\$)</b>	<b>% DES NETTO- VERMÖ- GENS</b>	<b>BESCHREIBUNG</b>	<b>AKTIEN</b>	<b>MARKT-WERT (000\$)</b>	<b>% DES NETTO- VERMÖ- GENS</b>
Mercuries Life Insurance Co. Ltd. (a)	99.037	\$ 53	0,08	<b>TELEKOMMUNIKATIONS-DIENSTE</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
Shin Kong Financial Holding Co. Ltd.	688.694	265	0,41	Chunghwa Telecom Co. Ltd.	34.000	\$ 123	0,19	KOC Holding A/S	17.160	\$ 53	0,08
SinoPac Financial Holdings Co. Ltd.	371.842	134	0,20	Far East Tone Telecommunications Co. Ltd.	16.000	41	0,06	TAV Havalimanlari Holding A/S	10.417	51	0,08
Taishin Financial Holding Co. Ltd.	170.936	81	0,12			164	0,25	Türk Hava Yolları AO (a)	48.820	145	0,22
Taiwan Business Bank	202.970	63	0,10	Summe Taiwan		6.495	9,92	Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari A/S	18.262	17	0,03
Taiwan Cooperative Financial Holding Co. Ltd.	81.240	47	0,07						266		0,41
Yuanta Financial Holding Co. Ltd.	125.000	57	0,09	<b>THAILAND</b>				<b>BAUSTOFFE</b>			
		1.734	2,65	<b>ENERGIE</b>				Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	33.502	74	0,11
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Banpu PCL	115.700	68	0,10	<b>TELEKOMMUNIKATIONS-DIENSTE</b>			
China Airlines Ltd. (a)	185.000	58	0,09	IRPC PCL	77.100	14	0,02	Türk Telekomunikasyon A/S	41.397	45	0,07
Eva Airways Corp.	41.000	20	0,03	PTT Exploration & Production PCL	77.500	328	0,50	Türkcell İletisim Hizmetleri A/S	24.309	65	0,10
Far Eastern New Century Corp.	166.300	157	0,24	PTT PCL	234.000	338	0,52			110	0,17
Taiwan High Speed Rail Corp.	14.000	11	0,02			748	1,14	Summe Türkei		1.538	2,35
Teco Electric and Machinery Co. Ltd.	39.000	29	0,04	<b>FINANZWERTE</b>				Summe Stammaktien		62.594	95,63
		275	0,42	Bangkok Bank PCL	44.700	264	0,40	<b>AKTIENNAHE WERTPAPIERE</b>			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				Kasikornbank PCL	20.700	121	0,19	JP Morgan Chase Bank, N.A., Reliance Infrastructure Ltd. - Exp. 11.07.2019	5.030	29	0,04
Acer, Inc.	107.000	87	0,13	Kiatnakin Bank PCL	7.900	16	0,02	JP Morgan Chase Bank, N.A., Adani Power Ltd. - Exp. 24.02.2020	27.170	6	0,01
ASE Technology Holding Co. Ltd.	13.109	31	0,05	Krung Thai Bank PCL	248.800	125	0,19	JP Morgan Chase Bank, N.A., Andhra Bank - Exp. 04.07.2019	99.552	48	0,07
Asustek Computer, Inc.	28.000	256	0,39	Siam Commercial Bank PCL	39.800	142	0,22	JP Morgan Chase Bank, N.A., Bank of Baroda - Exp. 22.04.2021	20.841	34	0,05
AU Optronics Corp.	578.000	245	0,37	Thanachart Capital PCL	82.600	117	0,18	JP Morgan Chase Bank, N.A., Bharat Heavy Electricals Ltd. - Exp. 15.03.2021	45.290	48	0,07
Catcher Technology Co. Ltd.	3.000	33	0,05	Tisco Financial Group PCL	12.600	32	0,05	JP Morgan Chase Bank, N.A., Hindalco Industries Ltd. - Exp. 24.06.2021	6.790	23	0,04
Chicony Electronics Co. Ltd.	7.000	16	0,02	TMB Bank PCL	201.000	14	0,02	JP Morgan Chase Bank, N.A., ICICI Bank Ltd. - Exp. 04.07.2019	19.300	78	0,12
Compal Electronics, Inc.	262.000	165	0,25	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				JP Morgan Chase Bank, N.A., IDBI Bank Ltd. - Exp. 24.02.2020	27.650	22	0,03
Delta Electronics, Inc.	10.000	36	0,06	Thai Airways International PCL (a)	176.400	67	0,10	JP Morgan Chase Bank, N.A., Indian Bank - Exp. 31.10.2018	12.640	63	0,10
Foxconn Technology Co. Ltd.	6.000	15	0,02	<b>BAUSTOFFE</b>				JP Morgan Chase Bank, N.A., Jaiprakash Associates Ltd. - Exp. 30.08.2018	970.614	227	0,35
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	152.955	417	0,64	PTT Global Chemical PCL	26.500	59	0,09	JP Morgan Chase Bank, N.A., NHPC Ltd. - Exp. 04.07.2019	83.150	29	0,04
HTC Corp.	34.000	63	0,10	<b>IMMOBILIEN</b>				JP Morgan Chase Bank, N.A., Oriental Bank of Commerce - Exp. 11.07.2019	56.947	63	0,10
Innolux Corp.	756.000	271	0,41	Pruksa Holding PCL	28.200	16	0,03	JP Morgan Chase Bank, N.A., Power Finance Corp. Ltd. - Exp. 17.07.2019	37.485	42	0,06
Inventec Corp.	89.000	70	0,11	<b>TELEKOMMUNIKATIONS-DIENSTE</b>				JP Morgan Chase Bank, N.A., Punjab National Bank - Exp. 23.04.2021	7.945	9	0,01
Lite-On Technology Corp.	84.190	102	0,16	Advanced Info Service PCL	5.700	32	0,05	JP Morgan Chase Bank, N.A., Reliance Communications Ltd. - Exp. 28.06.2019	125.923	25	0,04
MediaTek, Inc.	15.000	147	0,23	Total Access Communication PCL	79.900	88	0,13	JP Morgan Chase Bank, N.A., Rural Electrification Corp. Ltd. - Exp. 13.06.2019	63.699	97	0,15
Novatek Microelectronics Corp.	19.000	86	0,13	Summe Thailand		1.841	2,81	JP Morgan Chase Bank, N.A., Steel Authority of India Ltd. - Exp. 28.04.2021	116.243	141	0,22
Pegatron Corp.	54.000	111	0,17	<b>TÜRKEI</b>				JP Morgan Chase Bank, N.A., Syndicate Bank - Exp. 13.02.2019	64.090	38	0,06
Powertech Technology, Inc.	12.000	35	0,05	LUXUSGÜTER				JP Morgan Chase Bank, N.A., Tata Power Co. Ltd. - Exp. 05.04.2019	108.847	116	0,18
Quanta Computer, Inc.	51.000	89	0,14	Arcelik A/S	2.837	9	0,01				
Synnex Technology International Corp.	34.150	51	0,08	Vestel Elektronik Sanayi ve Ticaret A/S (a)	12.365	24	0,04				
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. SP - ADR	9.852	360	0,55			33	0,05				
TPK Holding Co. Ltd. (a)	23.000	48	0,07	<b>BASISKONSUMGÜTER</b>							
United Microelectronics Corp.	98.000	52	0,08	Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii A/S	2.030	10	0,02				
United Microelectronics Corp.	555.000	311	0,48	Migros Ticaret A/S	8.051	36	0,05				
Wistron Corp.	174.703	130	0,20	<b>ENERGIE</b>							
WPG Holdings Ltd.	51.000	72	0,11	Tupras Türkiye Petrol Rafinerileri A/S	2.320	55	0,08				
Yageo Corp.	6.481	238	0,36	<b>FINANZWERTE</b>							
Zhen Ding Technology Holding Ltd.	19.000	42	0,06	Akbank Turk A/S	66.550	109	0,17				
		3.579	5,47	Haci Omer Sabanci Holding A/S	108.460	209	0,32				
<b>GRUNDSTOFFE</b>				Sekerbank TAS (a)	170.312	48	0,07				
Asia Cement Corp.	83.000	91	0,14	Türkiye Garanti Bankasi A/S	60.840	111	0,17				
China Steel Corp.	26.000	20	0,03	Türkiye Halk Bankasi A/S	92.880	150	0,23				
Taiwan Cement Corp.	89.000	124	0,19	Türkiye Is Bankasi 'C'	129.420	161	0,25				
		235	0,36	Türkiye Vakıflar Bankasi TAO 'D'	58.240	62	0,09				
<b>IMMOBILIEN</b>				Yapi ve Kredi Bankasi A/S (a)	192.219	104	0,16				
Farglory Land Development Co. Ltd.	20.000	21	0,03			954	1,46				
Highwealth Construction Corp.	19.000	28	0,04								
		49	0,07								

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
JP Morgan Chase Bank, N.A., Tata Steel Ltd. - Exp. 10.12.2020	49.199	\$ 408	0,62	Cia Brasileira de Distribuicao	7.300	\$ 148	0,22
JP Morgan Chase Bank, N.A., Union Bank of India - Exp. 28.06.2019	58.630	70	0,11	Cia de Saneamento do Parana	9.000	21	0,03
Summe Aktiengebundene Wertpapiere		1.616	2,47	Cia Energetica de Sao Paulo	23.900	102	0,15
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				Cia Paranaense de Energia	10.100	57	0,09
Banco do Estado do Rio Grande do Sul S.A.	16.700	64	0,10	Metalurgica Gerdau S.A.	142.300	229	0,35
Bashneft PJSC	2.279	63	0,10	Transneft PJSC	59	157	0,24
Braskem S.A.	3.433	45	0,07	Summe Vorzugswertpapiere		904	1,38
Centrais Eletricas Brasileiras S.A.	5.100	18	0,03	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt		\$ 65.114	99,48

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* 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
SSB	07/2018	BRL	78 €	18	\$ 0	\$ 0	0,00
Summe Freiverkehrsfinaanzderivate						\$ 0	0,00
Summe Anlagen						\$ 65.114	99,48
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 343	0,52
Nettovermögen						\$ 65.457	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

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 11.841	\$ 53.266	\$ 7	\$ 65.114

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 19.582	\$ 64.658	\$ 0	\$ 84.240

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	96,76	96,27
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	2,72	5,57

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000\$)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
Gazprom PJSC	239.899	\$ 1.167	China Construction Bank Corp. 'H'	1.085.000	\$ 1.113
China Construction Bank Corp.	445.000	467	Samsung Electronics Co. Ltd.	6.233	1.042
Vedanta Ltd.	21.239	440	Vale S.A.	76.300	1.032
China Mobile Ltd.	43.000	397	Petroleo Brasileiro S.A. SP - ADR	60.000	816
Korea Electric Power Corp.	12.837	395	Gazprom PJSC SP - ADR	142.669	669
Reliance Industries Ltd.	12.790	360	Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	722.000	616
Infosys Ltd.	17.608	311	Banco do Brasil S.A.	51.300	574
Bank of China Ltd.	557.000	307	Citigroup Global Markets Holdings, Inc., Jindal Steel & Power Ltd. - Exp. 08.02.2018	133.679	538
ICICI Bank Ltd.	30.009	304	Bank of China Ltd. 'H'	984.000	524
Tata Motors Ltd.	10.963	303	Metalurgica Gerdau S.A.	218.400	467
CNOOC Ltd.	201.000	295	Itau Unibanco Holding S.A. SP - ADR 'H'	31.115	462
State Bank of India	5.460	256	China National Building Material Co. Ltd. 'H'	336.000	362
Hyundai Motor Co.	1.703	252	POSCO	1.084	341
Samsung Electronics Co. Ltd.	635	238	Lukoil PJSC SP - ADR	5.049	332
Kia Motors Corp.	7.164	223	Banco Bradesco S.A. ADR	28.883	327
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'	20.500	212	Citigroup Global Markets Holdings, Inc., Hindalco Industries Ltd. - Exp. 08.02.2018	83.967	321
Shinhan Financial Group Co. Ltd.	4.710	201	Reliance Industries Ltd. GDR	11.260	317
Tata Steel Ltd. GDR	18.629	194	CNOOC Ltd.	196.000	300
Sasol Ltd.	5.199	180	LG Electronics, Inc.	3.137	298
Turkiye Halk Bankasi A/S	82.180	174	Hyundai Motor Co.	2.039	288

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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental Europe Fund

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGLER MARKT</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>			
<b>BAUSTOFFE</b>			
BHP Billiton PLC	10.188	€ 196	1,13
<b>ÖSTERREICH</b>			
<b>ENERGIE</b>			
OMV AG	826	40	0,23
<b>FINANZWERTE</b>			
Erste Group Bank AG	1.865	67	0,39
Raiffeisen Bank International AG	1.501	39	0,22
UNIQA Insurance Group AG	543	4	0,02
Vienna Insurance Group AG			
Wiener Versicherung Gruppe	295	7	0,04
		117	0,67
<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
Oesterreichische Post AG	202	8	0,05
<b>BAUSTOFFE</b>			
voestalpine AG	368	14	0,08
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
Verbund AG	324	9	0,05
Summe Österreich		188	1,08
<b>BELGIEN</b>			
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
Anheuser-Busch InBev S.A. NV	166	14	0,08
<b>FINANZWERTE</b>			
Ageas	1.825	79	0,45
KBC Group NV	516	34	0,20
		113	0,65
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
<b>UCB S.A.</b>			
UCB S.A.	283	19	0,11
<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
bpost S.A.	716	10	0,06
<b>BAUSTOFFE</b>			
Solvay S.A.	65	7	0,04
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Proximus S.A.	1.121	21	0,12
Summe Belgien		184	1,06
<b>DÄNEMARK</b>			
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
Carlsberg A/S 'B'	217	22	0,13
<b>FINANZWERTE</b>			
Danske Bank A/S	334	9	0,05
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
Novo Nordisk A/S 'B'	1.160	46	0,26
<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
AP Moller - Maersk A/S 'B'	26	27	0,16
ISS A/S	1.980	58	0,33
		85	0,49
Summe Dänemark		162	0,93
<b>FINNLAND</b>			
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
Kesko Oyj 'B'	330	17	0,10

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ENERGIE</b>			
Neste Oyj	121	€ 8	0,05
<b>FINANZWERTE</b>			
Sampo Oyj 'A'	94	4	0,02
<b>BAUSTOFFE</b>			
Stora Enso Oyj 'R'	2.133	35	0,20
UPM-Kymmene Oyj	1.307	40	0,23
		75	0,43
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
Fortum Oyj	1.843	38	0,22
Summe Finnland		142	0,82
<b>FRANKREICH</b>			
<b>LUXUSGÜTER</b>			
Accor S.A.	192	8	0,05
Christian Dior SE	24	9	0,05
Cie Generale des Etablissements Michelin S.C.A.	661	68	0,39
Elior Group S.A.	588	7	0,04
Eutelsat Communications S.A.	235	4	0,02
Faurecia S.A.	117	7	0,04
Kering S.A.	67	32	0,18
Lagardere S.C.A.	1.824	41	0,24
LVHM Moet Hennessy Louis Vuitton SE	192	55	0,32
Peugeot S.A.	2.179	43	0,25
Publicis Groupe S.A.	570	34	0,20
Renault S.A.	638	46	0,26
Television Francaise	1.363	12	0,07
Vivendi S.A.	3.444	72	0,41
		438	2,52
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
Carrefour S.A.	6.381	88	0,51
Casino Guichard Perrachon S.A.	1.661	55	0,32
Danone S.A.	258	16	0,09
L'Oreal S.A.	54	12	0,07
Pernod-Ricard S.A.	127	18	0,10
		189	1,09
<b>ENERGIE</b>			
Total S.A.	3.193	166	0,96
<b>FINANZWERTE</b>			
AXA S.A.	5.976	125	0,72
BNP Paribas S.A.	4.770	253	1,46
CNP Assurances	435	8	0,05
Credit Agricole S.A.	5.706	65	0,37
Eurazeo S.A.	470	30	0,17
Natixis S.A.	5.138	31	0,18
SCOR SE	711	23	0,13
Societe Generale S.A.	5.674	204	1,18
		739	4,26
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
Korian S.A.	302	9	0,05
Sanofi	4.717	324	1,87
		333	1,92
<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
Air France-KLM (a)	13.192	92	0,53
Airbus SE	106	11	0,06
ALD S.A.	597	9	0,05
Alstom S.A.	869	34	0,20
Bouygues S.A.	2.059	76	0,44
Bureau Veritas S.A.	369	8	0,05

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Cie de Saint-Gobain	2.014	€ 77	0,44
Eiffage S.A.	532	49	0,28
Europcar Groupe S.A.	730	7	0,04
Rexel S.A.	2.511	31	0,18
Safran S.A.	189	20	0,12
Schneider Electric SE	678	48	0,28
SPIE S.A.	363	6	0,03
Teleperformance	76	11	0,06
Vinci S.A.	1.273	105	0,60
		584	3,36
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
Atos SE	260	31	0,18
Capgemini SE	80	9	0,05
Neopost S.A.	350	8	0,04
		48	0,27
<b>BAUSTOFFE</b>			
Air Liquide S.A.	164	18	0,10
Arkema S.A.	77	8	0,05
Vicat S.A.	126	7	0,04
		33	0,19
<b>IMMOBILIEN</b>			
Nexity S.A.	118	6	0,04
Orange S.A.	11.706	167	0,96
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
Electricite de France S.A.	9.982	117	0,67
Engie S.A.	15.932	209	1,20
Suez	3.065	34	0,20
Veolia Environnement S.A.	2.570	47	0,27
		407	2,34
Summe Frankreich		3.110	17,91
<b>DEUTSCHLAND</b>			
<b>LUXUSGÜTER</b>			
adidas AG	42	8	0,04
Axel Springer SE	217	13	0,07
Bayerische Motoren Werke AG	1.724	134	0,77
Ceconomy AG	2.118	15	0,09
Continental AG	153	30	0,17
Daimler AG	4.137	227	1,31
Hella GmbH & Co. KGaA	153	7	0,04
Hugo Boss AG	339	26	0,15
ProSiebenSat.1 Media SE	679	15	0,09
TUI AG	440	8	0,05
		483	2,78
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
METRO AG	2.864	30	0,17
Suedzucker AG	787	11	0,07
		41	0,24
<b>FINANZWERTE</b>			
Aareal Bank AG	198	8	0,05
Commerzbank AG	12.647	103	0,59
Deutsche Bank AG	16.741	153	0,88
Hannover Rueck SE	108	12	0,07
Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen	871	157	0,90
Talanx AG	551	17	0,10
		450	2,59
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
Bayer AG	1.616	152	0,88

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>SE</b>				<b>FINANZWERTE</b>				<b>Wolters Kluwer NV</b>	454	€ 22	0,13
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA	201	17	0,10	Assicurazioni Generali SpA	6.519	€ 93	0,53				
		169	0,98	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA (a)	3.447	9	0,05	<b>BAUSTOFFE</b>			
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Banca Popolare di Sondrio SCPA	2.791	10	0,06	Akzo Nobel NV	555	40	0,23
Bilfinger SE	287	13	0,07	Banco BPM SpA (a)	5.790	14	0,08	Koninklijke DSM NV	170	15	0,09
Deutsche Lufthansa AG	6.444	132	0,76	BPER Banca	4.772	22	0,13				
Deutsche Post AG	3.131	87	0,50	Intesa Sanpaolo SpA	44.117	109	0,63				
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	171	14	0,08	Mediobanca SpA	1.031	8	0,04	<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Hapag-Lloyd AG (a)	246	8	0,05	Poste Italiane SpA	13.617	97	0,56	Koninklijke KPN NV	10.779	25	0,14
Hochtief AG	48	7	0,04	Unione di Banche Italiane SpA	19.758	65	0,37	VEON Ltd. ADR	14.182	29	0,17
Rheinmetall AG	137	13	0,07	Unipol Gruppo Finanziario SpA	7.716	26	0,15				
Siemens AG	689	78	0,45	UnipolSai Assicurazioni SpA	4.074	8	0,05	Summe Niederlande		1.070	6,16
		352	2,02	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>NORWEGEN</b>			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				Leonardo SpA	1.357	11	0,06	<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
SAP SE	285	28	0,16	Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA	1.391	18	0,11	Marine Harvest ASA	448	8	0,04
						29	0,17	Orkla ASA	1.080	8	0,05
<b>BAUSTOFFE</b>				<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>							
BASF SE	1.902	156	0,90	Telecom Italia SpA	69.197	44	0,25	<b>ENERGIE</b>			
Evonik Industries AG	687	20	0,11					Equinor ASA	5.184	117	0,68
HeidelbergCement AG	253	18	0,10	A2A SpA	5.535	8	0,04	<b>FINANZWERTE</b>			
K+S AG	1.385	29	0,17	Enel SpA	40.769	194	1,12	DNB ASA	1.973	33	0,19
Linde AG	44	9	0,05	ERG SpA	548	10	0,06	<b>BAUSTOFFE</b>			
Salzgitter AG	599	22	0,13	Hera SpA	2.707	7	0,04	Norsk Hydro ASA	1.990	10	0,06
		254	1,46	Iren SpA	6.637	15	0,09	Yara International ASA	1.138	40	0,23
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>						234	1,35				
Deutsche Telekom AG	8.164	108	0,62	Summe Italien		958	5,52	<b>ELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>LUXEMBURG</b>				Telenor ASA	2.196	39	0,22
E.ON SE	13.977	127	0,73	<b>LUXUSGÜTER</b>				Summe Norwegen		255	1,47
Innogy SE	1.081	40	0,23	RTL Group S.A.	289	17	0,09	<b>PORTUGAL</b>			
RWE AG	9.867	192	1,11	<b>BAUSTOFFE</b>				<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
Uniper SE	1.960	50	0,29	ArcelorMittal	328	8	0,05	Sonae SGPS S.A.	12.402	13	0,07
		409	2,36	Summe Luxemburg		25	0,14	<b>FINANZWERTE</b>			
Summe Deutschland		2.294	13,21	<b>NIEDERLANDE</b>				Banco Comercial Portugues S.A. 'R' (a)	24.296	6	0,04
<b>IRLAND</b>				<b>BASISKONSUMGÜTER</b>				<b>BAUSTOFFE</b>			
<b>FINANZWERTE</b>				Heineken Holding NV	491	40	0,23	Navigator Co. S.A.	1.965	10	0,06
Bank of Ireland Group PLC	2.320	15	0,09	Heineken NV	95	8	0,05	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>				Koninklijke Ahold Delhaize NV	4.947	101	0,58	EDP - Energias de Portugal S.A.	16.846	57	0,33
Endo International PLC (a)	4.355	35	0,20			149	0,86	Summe Portugal		86	0,50
Medtronic PLC	989	73	0,42	<b>ENERGIE</b>				<b>SÜDAFRIKA</b>			
		108	0,62	Fugro NV (a)	1.263	16	0,09	<b>LUXUSGÜTER</b>			
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Royal Dutch Shell PLC 'A'	12.091	359	2,07	Steinhoff International Holdings NV (a)	118.144	10	0,06
AerCap Holdings NV (a)	539	25	0,14			375	2,16	<b>FINANZWERTE</b>			
<b>CRH PLC</b>				<b>FINANZWERTE</b>				Investec PLC	4.137	25	0,15
Smurfit Kappa Group PLC	1.321	46	0,27	ABN AMRO Group NV	939	21	0,12	Old Mutual Ltd. (a)	41.533	70	0,40
		58	0,34	Aegon NV	12.355	63	0,36				
Summe Irland		206	1,19	ASR Nederland NV	1.238	43	0,25				
<b>ITALIEN</b>				ING Groep NV	6.515	80	0,46				
<b>LUXUSGÜTER</b>				NN Group NV	933	33	0,19				
Mediaset SpA (a)	3.188	9	0,06			240	1,38	Summe Südafrika		105	0,61
Pirelli & C SpA (a)	1.345	9	0,05	<b>GESUNDHEITSWESEN</b>				<b>SPANIEN</b>			
		18	0,11	Koninklijke Philips NV	2.972	108	0,62	<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>ENERGIE</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Distribuidora Internacional de Alimentacion S.A.	1.466	4	0,02
Eni SpA	10.061	160	0,92	Arcadis NV	527	8	0,04	<b>ENERGIE</b>			
Snam SpA	3.512	12	0,07	Boskalis Westminster	548	14	0,08	Repsol S.A.	1.569	26	0,15
		172	0,99	PostNL NV	2.277	7	0,04				
				Signify NV	1.717	38	0,22				

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental Europe Fund (Forts.)

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
<b>FINANZWERTE</b>				<b>SCHWEIZ LUXUSGÜTER</b>				<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	12.682	€ 77	0,44	Cie Financiere Richemont S.A.	154	€ 11	0,06	Pearson PLC	6.006	€ 60	0,34
Banco de Sabadell S.A.	18.241	26	0,15	Garmin Ltd.	186	10	0,06	Persimmon PLC	426	12	0,07
Banco Santander S.A.	84.855	388	2,24	Swatch Group AG	33	13	0,08	Sky PLC	563	9	0,05
CaixaBank S.A.	6.084	23	0,13					Sports Direct International PLC	1.914	9	0,05
Mapfre S.A.	6.309	16	0,09					Taylor Wimpey PLC	7.936	16	0,09
Unicaja Banco S.A.	5.980	9	0,05					Thomas Cook Group PLC	18.566	23	0,13
								Whitbread PLC	193	9	0,05
		539	3,10					William Hill PLC	6.294	22	0,13
<b>INDUSTRIEWERTE</b>								WPP PLC	4.494	60	0,35
Abengoa S.A. 'B' (a)	733.468	7	0,04	<b>BASISKONSUMGÜTER</b>							
ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.	2.448	85	0,49	Aryzta AG (a)	387	5	0,03	Associated British Foods PLC	289	9	0,05
Ferrovial S.A.	1.153	20	0,12	Nestle S.A.	3.432	227	1,31	British American Tobacco PLC	851	37	0,21
Obrascon Huarte Lain S.A.	7.671	21	0,12					Diageo PLC	1.518	47	0,27
Sacyr S.A.	1.867	4	0,02	<b>ENERGIE</b>							
		137	0,79	Transeocean Ltd.	5.641	65	0,37	Imperial Brands PLC	2.577	82	0,47
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>								J Sainsbury PLC	21.366	77	0,45
Telefonica S.A.	23.236	169	0,97	<b>FINANZWERTE</b>							
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>								Reckitt Benckiser Group PLC	408	29	0,17
Acciona S.A.	394	28	0,16	Baloise Holding AG	94	11	0,06	Tate & Lyle PLC	1.109	8	0,05
Endesa S.A.	4.031	76	0,44	Credit Suisse Group AG	7.257	93	0,54	Tesco PLC	7.224	21	0,12
Gas Natural SDG S.A.	1.940	44	0,25	Helvetia Holding AG	18	9	0,05	Unilever NV	2.087	99	0,57
Iberdrola S.A.	15.945	105	0,61	Swiss Life Holding AG	243	72	0,42	Unilever PLC	1.806	85	0,49
		253	1,46	Swiss Re AG	1.903	142	0,82	WM Morrison Supermarkets PLC	16.453	47	0,27
Summe Spanien		1.128	6,49	UBS Group AG	6.492	85	0,49				
<b>SCHWEDEN LUXUSGÜTER</b>				Zurich Insurance Group AG	702	177	1,02				
Electrolux AB 'B'	332	7	0,04	<b>GESUNDHEITSWESEN</b>							
Hennes & Mauritz AB 'B'	2.217	28	0,16	Novartis AG	4.070	263	1,51	<b>ENERGIE</b>			
		35	0,20	Roche Holding AG	1.160	220	1,27	BP PLC	51.561	336	1,94
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>								Petrofac Ltd.	1.262	9	0,05
Swedish Match AB	363	16	0,09	<b>INDUSTRIEWERTE</b>							
<b>FINANZWERTE</b>				ABB Ltd.	2.518	47	0,27				
Nordea Bank AB	8.275	68	0,39	Adecco Group AG	320	16	0,09	<b>FINANZWERTE</b>			
Ratos AB 'B'	2.304	7	0,04	Ferguson PLC	526	37	0,21	3i Group PLC	861	9	0,05
Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	3.528	29	0,17	Kuehne + Nagel International AG	133	17	0,10	Aviva PLC	13.561	77	0,44
Svenska Handelsbanken AB 'A'	686	6	0,03	SGS S.A.	4	9	0,05	Barclays PLC	120.844	256	1,48
Swedbank AB 'A'	1.600	29	0,17					CYBG PLC	5.901	21	0,12
		139	0,80	<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				Direct Line Insurance Group PLC	11.711	45	0,26
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>				STMicroelectronics NV	552	11	0,06	HSBC Holdings PLC	74.619	597	3,44
Getinge AB 'B'	2.101	16	0,09	TE Connectivity Ltd.	339	26	0,15	Intermediate Capital Group PLC	1.057	13	0,08
<b>INDUSTRIEWERTE</b>								Legal & General Group PLC	7.612	23	0,13
Atlas Copco AB 'A'	591	15	0,09	<b>BAUSTOFFE</b>				Lloyds Banking Group PLC	218.921	156	0,90
Epiroc AB (a)	591	5	0,03	Glencore PLC	6.139	25	0,14	Man Group PLC	5.955	12	0,07
S.A.S. AB (a)	8.692	14	0,08	LafargeHolcim Ltd.	445	19	0,11	NEX Group PLC	365	4	0,02
Sandvik AB	1.250	19	0,11					Provident Financial PLC	1.353	9	0,05
SKF AB 'B'	239	4	0,02	<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				Quilter PLC (a)	13.844	23	0,13
Volvo AB 'B'	2.594	35	0,20	Swisscom AG	81	31	0,18	Royal Bank of Scotland Group PLC (a)	28.340	82	0,47
		92	0,53	Summe Schweiz		1.641	9,45	Standard Chartered PLC	13.027	101	0,58
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				<b>GROSSBRITANNIEN LUXUSGÜTER</b>				Standard Life Aberdeen PLC	4.081	15	0,09
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	15.091	100	0,58	Barratt Developments PLC	2.535	15	0,09				
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				Berkeley Group Holdings PLC	688	29	0,17	<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
Tele2 AB 'B'	4.678	47	0,27	Burberry Group PLC	347	8	0,05	AstraZeneca PLC	2.888	171	0,98
Telia Co. AB	12.809	50	0,29	Compass Group PLC	2.514	46	0,26	GlaxoSmithKline PLC	10.765	186	1,07
		97	0,56	Dixons Carphone PLC	3.643	8	0,05	Smith & Nephew PLC	276	5	0,03
Summe Schweden		495	2,85	Fiat Chrysler Automobiles NV	9.683	156	0,90				
				Greene King PLC	2.597	17	0,10	<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
				Inchcape PLC	1.928	17	0,10	Aggreko PLC	1.352	10	0,06
				InterContinental Hotels Group PLC	342	18	0,10	BAE Systems PLC	7.934	58	0,33
				ITV PLC	9.072	18	0,10	Capita PLC	22.103	40	0,23
				Kingfisher PLC	17.115	57	0,33	CNH Industrial NV	1.425	13	0,07
				Marks & Spencer Group PLC	22.455	75	0,43	easyJet PLC	2.263	43	0,25
				Next PLC	781	53	0,30	Firstgroup PLC (a)	10.582	10	0,06
								G4S PLC	4.810	14	0,08
								International Consolidated Airlines Group S.A.	6.577	49	0,28
								Meggitt PLC	1.543	9	0,05
								National Express Group PLC	2.158	10	0,06

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
RELX NV	1.214	€ 22	0,13	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				Intu Properties PLC	7.234	€ 15	0,09
RELX PLC	1.020	19	0,11	Centrica PLC	48.914	€ 87	0,50	Land Securities Group PLC	3.752	40	0,23
Rolls-Royce Holdings PLC	5.086	57	0,33	Drax Group PLC	1.582	6	0,04	Segro PLC	1.151	9	0,05
Royal Mail PLC	17.932	102	0,59	National Grid PLC	10.708	101	0,58			110	0,63
Stagecoach Group PLC	6.926	11	0,06	Severn Trent PLC	824	18	0,10				
Travis Perkins PLC	1.322	21	0,12	SSE PLC	2.375	36	0,21				
		488	2,81	United Utilities Group PLC	1.906	17	0,10				
						265	1,53				
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				Summe Großbritannien		4.626	26,64	<b>RECHTE</b>			
Sage Group PLC	1.475	10	0,06					ACS Actividades de			
								Construccion y Servicios			
<b>BAUSTOFFE</b>								S.A. - Exp. 11.07.2018	2.448	2	0,01
Anglo American PLC	1.226	23	0,13	<b>USA</b>				Intesa Sanpaolo SpA - Exp.			
DS Smith PLC	1.397	8	0,05	<b>LUXUSGÜTER</b>				17.07.2018	44.117	0	0,00
Mondi PLC	373	9	0,05	Carnival PLC	741	36	0,21	Repsol S.A. - Exp. 06.07.2018	1.569	1	0,01
Rio Tinto PLC	3.191	151	0,87	Summe Stammaktien		16.907	97,37				
		191	1,10					<b>OPTIONSSCHEINE</b>			
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				Abengoa S.A. 'B' - Exp.			
BT Group PLC	13.744	34	0,20	Schaeffler AG	590	6	0,04	31.03.2025	24.248	0	0,00
Inmarsat PLC	1.913	12	0,07	Volkswagen AG	1.350	191	1,10				
TalkTalk Telecom Group PLC	5.564	6	0,03			197	1,14	Summe Übertragbare Wertpapiere			
Vodafone Group PLC	92.314	192	1,10	<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>				und Geldmarktinstrumente – Amtliche			
		244	1,40	British Land Co. PLC	3.523	27	0,15	Börse/Geregelter Markt		€ 17.217	99,16
				Derwent London PLC	245	9	0,05				
				Hammerson PLC	1.779	10	0,06	Summe Anlagen		€ 17.217	99,16
								Sonstige Aktiva und Passiva		€ 147	0,84
								Nettovermögen		€ 17.364	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

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	€ 329	€ 16.888	€ 0	€ 17.217

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	€ 1.076	€ 12.658	€ 0	€ 13.734

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	99,10	99,43
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0,06	0,00

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO RAE Fundamental Europe Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
HSBC Holdings PLC	25.837	€ 215	HSBC Holdings PLC	14.765	€ 121
Daimler AG	2.315	158	BHP Billiton PLC	4.843	92
Vodafone Group PLC	62.307	145	BP PLC	13.703	87
Sanofi	1.981	131	Fiat Chrysler Automobiles NV	3.097	59
Novartis AG	1.821	123	Barclays PLC	24.579	55
Roche Holding AG	620	118	BNP Paribas S.A.	999	54
Banco Santander S.A.	21.250	118	Rio Tinto PLC	1.107	53
Volkswagen AG	658	109	Glencore PLC	11.436	49
BNP Paribas S.A.	1.694	107	Banco Santander S.A.	10.026	47
Royal Dutch Shell PLC 'A'	3.427	99	RWE AG	2.162	42
Societe Generale S.A.	2.218	99	Anglo American PLC	1.921	39
GlaxoSmithKline PLC	5.871	98	Royal Dutch Shell PLC 'A'	1.186	34
AstraZeneca PLC	1.621	95	Daimler AG	490	31
Barclays PLC	40.081	94	Deutsche Lufthansa AG	1.304	31
Lloyds Banking Group PLC	121.651	94	Bayer AG	307	31
Orange S.A.	6.205	89	Sanofi	460	30
Deutsche Bank AG	7.181	87	Unilever PLC	637	30
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	451	84	Abertis Infraestructuras S.A.	1.642	30
Engie S.A.	6.050	82	Carnival PLC	524	29
Nestle S.A.	1.212	79	Unilever NV	602	29

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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund

30. Juni 2018

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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGLTER MARKT</b>								<b>BAUSTOFFE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>								<b>Goldcorp, Inc.</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>								<b>Nutrien Ltd.</b>			
<b>LUXUSGÜTER</b>								<b>Teck Resources Ltd. 'B'</b>			
Tabcorp Holdings Ltd.	5.261	\$ 17	0,02	Summe Österreich		215	0,30	Yamana Gold, Inc.	4.963	14	0,02
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>								<b>BAUSTOFFE</b>			
Coca-Cola Amatil Ltd.	1.530	10	0,01					<b>Alco Ltd. 'I'</b>			
Metcash Ltd.	9.740	19	0,03					<b>Hydro One Ltd.</b>			
Wesfarmers Ltd.	3.596	131	0,18					<b>Summe Kanada</b>			
Woolworths Ltd.	8.085	182	0,26					<b>1.989</b>			
		342	0,48								
<b>ENERGIE</b>								<b>DÄNEMARK</b>			
Origin Energy Ltd.	2.252	17	0,02					<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
Woodside Petroleum Ltd.	1.183	31	0,04					<b>Carlsberg A/S 'B'</b>			
WorleyParsons Ltd.	3.102	40	0,06					<b>FINANZWERTE</b>			
		88	0,12					<b>Danske Bank A/S</b>			
<b>FINANZWERTE</b>								<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
AMP Ltd.	13.035	34	0,05					<b>Novo Nordisk A/S 'B'</b>			
Australia & New Zealand								<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
Banking Group Ltd.	9.920	207	0,29					<b>AP Moller - Maersk A/S 'B'</b>			
Bendigo & Adelaide Bank Ltd.	1.626	13	0,02					<b>ISS A/S</b>			
Commonwealth Bank of								<b>Summe Dänemark</b>			
Australia	3.416	184	0,26					<b>197</b>			
Insurance Australia Group Ltd.	1.631	10	0,01								
Macquarie Group Ltd.	801	73	0,10					<b>FINNLAND</b>			
National Australia Bank Ltd.	9.358	190	0,27					<b>BAUSTOFFE</b>			
QBE Insurance Group Ltd.	1.342	10	0,01					<b>Stora Enso Oyj 'R'</b>			
Suncorp Group Ltd.	10.156	109	0,15					<b>UPM-Kymmene Oyj</b>			
Westpac Banking Corp.	8.968	195	0,27					<b>Summe Finnland</b>			
		1.025	1,43					<b>1.645</b>			
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>								<b>FRANKREICH</b>			
CSL Ltd.	110	16	0,02					<b>LUXUSGÜTER</b>			
Sonic Healthcare Ltd.	824	15	0,02					<b>Accor S.A.</b>			
		31	0,04					<b>Cie Generale des Etablissements</b>			
<b>INDUSTRIEWERTE</b>								<b>Michelle S.C.A.</b>			
Aurizon Holdings Ltd.	7.685	25	0,04					<b>Kering S.A.</b>			
CIMIC Group Ltd.	560	17	0,02					<b>Lagardere S.C.A.</b>			
Downer EDI Ltd.	9.563	48	0,07					<b>LVMH Moet Hennessy Louis</b>			
Qantas Airways Ltd.	8.586	39	0,05					<b>Vuitton SE</b>			
		129	0,18					<b>Peugeot S.A.</b>			
<b>BAUSTOFFE</b>								<b>Publicis Groupe S.A.</b>			
BHP Billiton Ltd.	13.542	338	0,47					<b>Renault S.A.</b>			
BHP Billiton PLC	11.264	253	0,35					<b>Television Francaise</b>			
Incitec Pivot Ltd.	7.223	20	0,03					<b>Vivendi S.A.</b>			
		611	0,85					<b>543</b>			
<b>IMMOBILIEN</b>								<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
Lend Lease Group	1.193	17	0,03					<b>Carrefour S.A.</b>			
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>								<b>Casino Guichard Perrachon S.A.</b>			
Telstra Corp. Ltd.	35.293	68	0,10					<b>Pernod-Ricard S.A.</b>			
Summe Australien		2.328	3,25					<b>186</b>			
<b>ÖSTERREICH</b>								<b>ENERGIE</b>			
<b>ENERGIE</b>								<b>Total S.A.</b>			
OMV AG	1.108	63	0,09					<b>3.417</b>			
<b>FINANZWERTE</b>											
Erste Group Bank AG	2.205	92	0,13								
Raiffeisen Bank International AG	1.687	52	0,07								
		144	0,20								
<b>BAUSTOFFE</b>											
voestalpine AG	184	\$ 8	0,01								
<b>BELGIEN</b>											
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>											
Anheuser-Busch InBev S.A. NV	104	10	0,01								
<b>FINANZWERTE</b>											
Ageas	1.901	96	0,13								
KBC Group NV	605	46	0,07								
		142	0,20								
<b>INDUSTRIEWERTE</b>											
bpost S.A.	485	8	0,01								
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>											
Proximus S.A.	1.117	25	0,04								
Summe Belgien		185	0,26								
<b>BERMUDAS</b>											
<b>FINANZWERTE</b>											
XL Group Ltd.	1.818	102	0,14								
<b>KANADA</b>											
<b>LUXUSGÜTER</b>											
Canadian Tire Corp. Ltd. 'A'	354	46	0,07								
Magna International, Inc.	1.873	109	0,15								
Shaw Communications, Inc. 'B'	1.084	22	0,03								
		177	0,25								
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>											
Empire Co. Ltd. 'A'	749	15	0,02								
George Weston Ltd.	510	42	0,06								
		57	0,08								
<b>ENERGIE</b>											
Baytex Energy Corp. (a)	3.432	11	0,01								
Canadian Natural Resources Ltd.	535	19	0,03								
Cenovus Energy, Inc.	1.376	14	0,02								
Crescent Point Energy Corp.	4.752	35	0,05								
Husky Energy, Inc.	2.836	44	0,06								
MEG Energy Corp. (a)	2.090	18	0,02								
Suncor Energy, Inc.	3.626	148	0,21								
		289	0,40								
<b>FINANZWERTE</b>											
Bank of Montreal	1.974	153	0,21								
Bank of Nova Scotia	2.469	140	0,19								
Canadian Imperial Bank of											
Commerce	1.335	116	0,16								
Manulife Financial Corp.	754	14	0,02								
National Bank of Canada	641	31	0,04								
Onex Corp.	564	41	0,06								
Power Corp. of Canada	2.281	51	0,07								
Power Financial Corp.	577	13	0,02								
Royal Bank of Canada	2.353	177	0,25								
Sun Life Financial, Inc.	348	14	0,02								
Thomson Reuters Corp.	1.050	42	0,06								
Toronto-Dominion Bank	3.677	213	0,30								
		1.005	1,40								
<b>INDUSTRIEWERTE</b>											
Air Canada (a)	5.803	94	0,13								
Canadian National Railway Co.	635	52	0,07								
Canadian Pacific Railway Ltd.	110	20	0,03								
TFI International, Inc.	478	14	0,02								
WestJet Airlines Ltd.	1.228	17	0,03								
		197	0,28								

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>FINANZWERTE</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>IRLAND</b>			
AXA S.A.	6.276	\$ 153	0,21	Bilfinger SE	562	\$ 28	0,04	<b>FINANZWERTE</b>			
BNP Paribas S.A.	5.081	314	0,44	Deutsche Lufthansa AG	7.417	178	0,25	Bank of Ireland Group PLC	1.664	\$ 13	0,02
Credit Agricole S.A.	5.939	79	0,11	Deutsche Post AG	3.571	116	0,16	<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
Eurazeo S.A.	610	46	0,07	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	105	10	0,02	Endo International PLC (a)	5.278	50	0,07
Natixis S.A.	5.398	38	0,05	Siemens AG	827	109	0,15	Medtronic PLC	1.179	101	0,14
SCOT SE	404	15	0,02								
Societe Generale S.A.	6.101	257	0,36								
		902	1,26	<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>				<b>BAUSTOFFE</b>				<b>ISRAEL</b>			
Sanofi	5.295	425	0,59	SAP SE	250	29	0,04	<b>FINANZWERTE</b>			
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				<b>FINANZWERTE</b>			
Air France-KLM (a)	15.491	127	0,18	BASF SE	2.297	219	0,31	Bank Hapoalim BM	6.783	46	0,06
Airbus SE	189	22	0,03	Evonik Industries AG	873	30	0,04	Bank Leumi Le-Israel BM	8.021	47	0,07
Alstom S.A.	1.242	57	0,08	HeidelbergCement AG	283	24	0,03				
Bouygues S.A.	2.393	103	0,14	K+S AG	1.780	44	0,06				
Cie de Saint-Gobain	2.422	108	0,15	Salzgitter AG	697	30	0,04				
Eiffage S.A.	704	76	0,11								
Rexel S.A.	2.807	40	0,05	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Safran S.A.	249	30	0,04	E.ON SE	14.970	159	0,22	Deutsche Telekom AG	8.299	128	0,18
Schneider Electric SE	763	63	0,09	Innogy SE	1.214	52	0,07				
Vinci S.A.	1.465	141	0,20	RWE AG	10.827	246	0,35				
		767	1,07	Uniper SE	2.581	77	0,11				
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>											
Atos SE	283	38	0,05	Summe Deutschland		2.823	3,94	<b>ISRAEL</b>			
Capgemini SE	74	10	0,02					<b>FINANZWERTE</b>			
		48	0,07	<b>HONGKONG</b>				<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BAUSTOFFE</b>				<b>LUXUSGÜTER</b>				<b>FINANZWERTE</b>			
Air Liquide S.A.	186	23	0,03	I-CABLE Communications Ltd. (a)	7.748	0	0,00	Bank Hapoalim BM	6.783	46	0,06
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				<b>FINANZWERTE</b>				<b>FINANZWERTE</b>			
Orange S.A.	11.978	200	0,28	Li & Fung Ltd.	50.000	19	0,03	Bank Leumi Le-Israel BM	8.021	47	0,07
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>FINANZWERTE</b>			
Electricite de France S.A.	10.519	144	0,20	Hang Seng Bank Ltd.	900	22	0,03				
Engie S.A.	17.431	267	0,37								
Suez	2.601	34	0,05	<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				<b>FINANZWERTE</b>			
Veolia Environnement S.A.	2.388	51	0,07	Kingboard Chemical Holdings Ltd.	4.500	16	0,02				
		496	0,69	<b>IMMOBILIEN</b>				<b>FINANZWERTE</b>			
Summe Frankreich		3.798	5,30	CK Asset Holdings Ltd.	2.000	16	0,02	Assicurazioni Generali SpA	6.819	114	0,16
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				<b>FINANZWERTE</b>			
<b>LUXUSGÜTER</b>				<b>IMMOBILIEN</b>				<b>FINANZWERTE</b>			
Bayerische Motoren Werke AG	1.874	170	0,24	Hang Lung Properties Ltd.	4.000	8	0,01	Banco BPM SpA (a)	4.354	13	0,02
Ceconomy AG	3.399	28	0,04	Henderson Land Development Co. Ltd.	2.200	12	0,02	BPER Banca	5.292	29	0,04
Continental AG	98	22	0,03	Hongkong Land Holdings Ltd.	5.500	39	0,06	Intesa Sanpaolo SpA	44.867	130	0,18
Daimler AG	4.422	283	0,39	Kerry Properties Ltd.	3.000	14	0,02	Poste Italiane SpA	13.305	111	0,16
Hugo Boss AG	240	22	0,03	New World Development Co. Ltd.	42.000	59	0,08	Unione di Banche Italiane SpA	20.513	78	0,11
ProSiebenSat.1 Media SE	321	8	0,01	Shimao Property Holdings Ltd.	22.000	57	0,08	Unipol Gruppo Finanziario SpA	8.001	31	0,04
		533	0,74	Sun Hung Kai Properties Ltd.	5.000	75	0,11				
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>				<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
METRO AG	2.846	35	0,05	Wharf Real Estate Investment Co. Ltd.	6.000	43	0,06	Leonardo SpA	1.314	13	0,02
<b>FINANZWERTE</b>				<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Commerzbank AG	13.401	128	0,18	CLP Holdings Ltd.	3.500	38	0,05	Telecom Italia SpA	76.439	57	0,08
Deutsche Bank AG	18.339	196	0,27	Summe Hongkong		616	0,86	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen	967	203	0,28					Enel SpA	46.021	255	0,36
Talanx AG	681	25	0,04					Summe Italien		1.044	1,46
		552	0,77	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>JAPAN</b>			
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>				<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>LUXUSGÜTER</b>			
Bayer AG	1.926	212	0,29					Aishin Seiki Co. Ltd.	700	32	0,05
Fresenius SE & Co. KGaA	152	12	0,02					Benesse Holdings, Inc.	300	11	0,02
		224	0,31					Bridgestone Corp.	2.600	101	0,14
								Denso Corp.	1.200	58	0,08

			MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS				MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS				MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
BESCHREIBUNG	AKTIEN				BESCHREIBUNG	AKTIEN				BESCHREIBUNG	AKTIEN						
<b>BESCHREIBUNG</b>					<b>BESCHREIBUNG</b>					<b>BESCHREIBUNG</b>							
H2O Retailing Corp.	600	\$	9	0,01	T&D Holdings, Inc.	4.000	\$	60	0,08	<b>BAUSTOFFE</b>							
Honda Motor Co. Ltd.	8.100		237	0,33	Tokio Marine Holdings, Inc.	1.100		51	0,07	Asahi Kasei Corp.	2.400	\$	30	0,04			
Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd. 'L'	3.200		40	0,06				1.626	2,27	DIC Corp.	500		16	0,02			
Isuzu Motors Ltd.	1.600		21	0,03	<b>GESUNDHEITSWESEN</b>					JFE Holdings, Inc.	2.000		38	0,05			
Mazda Motor Corp.	5.000		61	0,09	<b>INDUSTRIEWERTE</b>					Kaneka Corp.	1.000		9	0,01			
Mitsubishi Motors Corp.	2.100		17	0,02	Astellas Pharma, Inc.	5.200		79	0,11	Kobe Steel Ltd.	3.900		36	0,05			
Nikon Corp.	1.800		29	0,04	Daiichi Sankyo Co. Ltd.	2.200		84	0,12	Kuraray Co. Ltd.	1.000		14	0,02			
Nissan Motor Co. Ltd.	17.600		171	0,24	Hoya Corp.	400		23	0,03	Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	6.200		52	0,07			
Panasonic Corp.	8.600		116	0,16	Otsuka Holdings Co. Ltd.	500		24	0,03	Mitsubishi Materials Corp.	700		19	0,03			
Pioneer Corp. (a)	14.900		21	0,03	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.	1.900		80	0,11	Nippon Paper Industries Co. Ltd.	1.600		25	0,04			
Sekisui Chemical Co. Ltd.	1.300		22	0,03				290	0,40	Oji Holdings Corp.	8.000		50	0,07			
Sekisui House Ltd.	1.300		23	0,03						Showa Denko KK	600		27	0,04			
Sony Corp.	1.400		72	0,10						Sumitomo Chemical Co. Ltd.	10.000		56	0,08			
Subaru Corp.	1.300		38	0,05						Toyo Seikan Group Holdings Ltd. 'L'	600		10	0,02			
Sumitomo Electric Industries Ltd.	3.500		52	0,07	ANA Holdings, Inc.	1.300		48	0,07	Ube Industries Ltd.	400		10	0,01			
Sumitomo Rubber Industries Ltd.	2.200		35	0,05	Asahi Glass Co. Ltd.	1.200		47	0,07				392	0,55			
Suzuki Motor Corp.	900		49	0,07	Central Japan Railway Co.	200		41	0,06								
Takashimaya Co. Ltd.	3.000		26	0,04	Dai Nippon Printing Co. Ltd.	2.200		49	0,07	<b>IMMOBILIEN</b>							
Toy Tire & Rubber Co. Ltd.	1.400		20	0,03	East Japan Railway Co.	1.100		105	0,15	Daiwa House Industry Co. Ltd.	900		30	0,04			
Toyota Industries Corp.	300		17	0,02	Fujikura Ltd.	3.000		19	0,03	Mitsui Fudosan Co. Ltd.	400		10	0,02			
Toyota Motor Corp.	6.000		388	0,54	Furukawa Electric Co. Ltd.	500		17	0,02	Nomura Real Estate Holdings, Inc.	1.000		22	0,03			
Yamada Denki Co. Ltd.	3.800		19	0,03	ITOCHU Corp.	5.300		96	0,13	Tokyu Fudosan Holdings Corp.	1.400		10	0,01			
Yokohama Rubber Co. Ltd.	1.100		23	0,03	Japan Airlines Co. Ltd.	1.900		67	0,09				72	0,10			
			1.708	2,39	Kawasaki Heavy Industries Ltd.	1.000		29	0,04								
					Komatsu Ltd.	900		26	0,04	<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>							
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>					LIXIL Group Corp.	600		12	0,02	KDDI Corp.	2.200		60	0,08			
Aeon Co. Ltd.	7.200	154	0,21	Marubeni Corp.	10.500	80	0,11	Mitsubishi Electric Corp.	2.700	75	0,11	Nippon Telegraph & Telephone Corp.	5.300	241	0,34		
Asahi Group Holdings Ltd.	800	41	0,06	Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	4.700	62	0,09	NTT DOCOMO, Inc.	1.700	43	0,06	SoftBank Group Corp.	800	57	0,08		
Japan Tobacco, Inc.	1.600	45	0,06	Mitsui & Co. Ltd.	7.000	117	0,16			401	0,56						
Kao Corp.	200	15	0,02	Mitsui E&S Holdings Co. Ltd.	900	12	0,02										
Kirin Holdings Co. Ltd.	4.000	107	0,15	Mitsui OSK Lines Ltd.	500	12	0,02	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>									
Sapporo Holdings Ltd.	500	12	0,02	Nippon Express Co. Ltd.	300	22	0,03	Chubu Electric Power Co., Inc.	5.600	84	0,12	Chugoku Electric Power Co., Inc. Electric Power Development Co. Ltd.	2.700	35	0,05		
Seven & i Holdings Co. Ltd.	1.300	57	0,08	Nippon Yusen KK	2.700	53	0,07	Hokuriku Electric Power Co.	3.100	31	0,04	Kansai Electric Power Co., Inc.	7.100	103	0,14		
Shiseido Co. Ltd.	900	71	0,10	Nisshinbo Holdings, Inc.	800	9	0,01	Kyushu Electric Power Co., Inc.	1.200	13	0,02	Shikoku Electric Power Co., Inc.	1.400	19	0,02		
Yamazaki Baking Co. Ltd.	900	24	0,03	NSK Ltd.	1.100	11	0,02	Tohoku Electric Power Co., Inc.	3.400	42	0,06	Tokyo Electric Power Co. Holdings, Inc. (a)	27.600	128	0,18		
			526	0,73	NTN Corp.	3.200	13	0,02	Tokyo Gas Co. Ltd.	1.000	27	0,04				518	0,72
					Recruit Holdings Co. Ltd.	600	17	0,02									
<b>ENERGIE</b>					Sojitz Corp.	12.900	47	0,07									
Cosmo Energy Holdings Co. Ltd.	400	14	0,02	Sumitomo Corp.	6.700	110	0,15	Summe Japan							8.353	11,66	
Inpex Corp.	7.500	78	0,11	Sumitomo Heavy Industries Ltd.	500	17	0,02										
JXTG Holdings, Inc.	8.200	57	0,08	Tokyu Corp.	600	10	0,01	<b>LUXEMBURG LUXUSGÜTER</b>									
			149	0,21	Toppan Printing Co. Ltd.	2.000	16	0,02	RTL Group S.A.	177		12	0,02				
					Toshiba Corp. (a)	29.000	87	0,12	<b>BAUSTOFFE</b>								
<b>FINANZWERTE</b>					Toyota Tsusho Corp.	1.600	53	0,07	ArceleorMittal	477		14	0,02				
Chiba Bank Ltd.	3.000	21	0,03	West Japan Railway Co.	700	52	0,07	Summe Luxemburg				26	0,04				
Concordia Financial Group Ltd.	1.700	9	0,01				1.557	2,17	<b>MACAU LUXUSGÜTER</b>								
Dai-ichi Life Holdings, Inc.	8.500	151	0,21	<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>	Canon, Inc.	4.200	138	0,19	Sands China Ltd.	1.600		8	0,01				
Daiwa Securities Group, Inc.	8.000	46	0,07	FUJIFILM Holdings Corp.	2.700	105	0,15	<b>NIEDERLANDE BASISKONSUMGÜTER</b>									
Fukuoka Financial Group, Inc.	3.000	15	0,02	Fujitsu Ltd.	18.000	109	0,15	Heineken Holding NV	457		44	0,06	Koninklijke Ahold Delhaize NV	5.924	141	0,20	
Gunma Bank Ltd.	2.900	15	0,02	Gree, Inc.	1.800	10	0,02				185	0,26					
Japan Post Bank Co. Ltd.	2.800	33	0,05	Hitachi Ltd.	46.000	324	0,45	<b>ENERGIE</b>									
Japan Post Holdings Co. Ltd.	7.200	79	0,11	Ibiden Co. Ltd.	1.500	24	0,03	Royal Dutch Shell PLC 'A'	12.981		450	0,63					
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	47.900	271	0,38	Japan Display, Inc. (a)	18.000	23	0,03										
Mizuho Financial Group, Inc.	132.500	223	0,31	Konica Minolta, Inc.	7.600	70	0,10										
MS&AD Insurance Group Holdings, Inc.	1.700	53	0,07	Kyocera Corp.	600	34	0,05										
Nomura Holdings, Inc.	9.000	44	0,06	NEC Corp.	2.800	77	0,11										
ORIX Corp.	5.000	79	0,11	Nippon Electric Glass Co. Ltd.	500	14	0,02										
Resona Holdings, Inc.	8.500	45	0,06	Omnion Corp.	200	9	0,01										
SBI Holdings, Inc.	1.900	49	0,07	Ricoh Co. Ltd.	10.400	95	0,13										
Shizuoka Bank Ltd.	3.000	27	0,04	Seiko Epson Corp.	1.000	17	0,03										
Sony Financial Holdings, Inc.	1.000	19	0,03	Taiyo Yuden Co. Ltd.	500	14	0,02										
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	6.600	257	0,36	TDK Corp.	500	51	0,07										
Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc.	2.000	79	0,11				1.114	1,56									

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund (Forts.)

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
<b>FINANZWERTE</b>				<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
ABN AMRO Group NV	583	\$ 15	0,02	Singapore Telecommunications Ltd.	9.900	\$ 22	0,03	Tele2 AB 'B'	6.000	\$ 70	0,10
Aegon NV	14.649	88	0,12	Summe Singapur		392	0,55	Telia Co. AB	15.078	69	0,10
ASR Nederland NV	1.285	52	0,07							139	0,20
ING Groep NV	7.334	105	0,15	<b>SÜDAFRIKA</b>				Summe Schweden		558	0,78
NN Group NV	879	36	0,05	<b>LUXUSGÜTER</b>							
		296	0,41	Steinhoff International Holdings NV (a)	33.059	3	0,00	<b>SCHWEIZ</b>			
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>				<b>FINANZWERTE</b>				<b>LUXUSGÜTER</b>			
Koninklijke Philips NV	3.483	148	0,21	Investec PLC	3.313	24	0,03	Cie Financiere Richemont S.A.	107	9	0,01
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Old Mutual Ltd. (a)	48.537	96	0,14	<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
PostNL NV	4.691	18	0,02			120	0,17	Nestle S.A.	3.775	292	0,41
Signify NV	1.854	48	0,07	Summe Südafrika		123	0,17	<b>ENERGIE</b>			
Wolters Kluwer NV	184	10	0,01					Transocean Ltd.	5.813	78	0,11
		76	0,10	<b>SPANIEN</b>				<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BAUSTOFFE</b>				<b>ENERGIE</b>				<b>FINANZWERTE</b>			
Akzo Nobel NV	652	55	0,08	Repsol S.A.	1.078	21	0,03	Credit Suisse Group AG	9.176	137	0,19
Koninklijke DSM NV	98	10	0,01	<b>FINANZWERTE</b>				Swiss Life Holding AG	284	98	0,14
		65	0,09	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	13.299	94	0,13	Swiss Re AG	2.140	186	0,26
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				Banco de Sabadell S.A.	19.205	32	0,05	UBS Group AG	6.145	94	0,13
Koninklijke KPN NV	8.870	24	0,03	Banco Santander S.A.	91.597	489	0,68	Zurich Insurance Group AG	775	229	0,32
VEON Ltd. ADR	11.237	27	0,04	CaixaBank S.A.	8.479	37	0,05			744	1,04
		51	0,07	Mapfre S.A.	5.104	15	0,02	<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
Summe Niederlande		1.271	1,77			667	0,93	Novartis AG	4.335	328	0,46
<b>NEUSEELAND</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Roche Holding AG	1.218	269	0,37
<b>BAUSTOFFE</b>				Abertis Infraestructuras S.A.	1.887	40	0,06			597	0,83
Fletcher Building Ltd.	5.999	28	0,04	ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.	2.827	114	0,16	<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				Ferrovial S.A.	1.885	39	0,05	ABB Ltd.	2.728	59	0,08
Spark New Zealand Ltd.	8.302	21	0,03	Obrascon Huarte Lain S.A.	6.106	19	0,03	Adecco Group AG	325	19	0,03
Summe Neuseeland		49	0,07			212	0,30	Ferguson PLC	620	50	0,07
<b>NORWEGEN</b>				Telefonica S.A.	24.368	207	0,29			128	0,18
<b>ENERGIE</b>				<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
Equinor ASA	5.473	145	0,20					STMicroelectronics NV	608	14	0,02
<b>FINANZWERTE</b>				Acciona S.A.	457	38	0,05	TE Connectivity Ltd.	416	37	0,05
DNB ASA	2.831	55	0,08	Endesa S.A.	4.338	95	0,13			51	0,07
<b>BAUSTOFFE</b>				Gas Natural SDG S.A.	2.146	57	0,08	<b>BAUSTOFFE</b>			
Yara International ASA	1.143	47	0,07	Iberdrola S.A.	14.659	113	0,16	Glencore PLC	7.062	33	0,04
						303	0,42	LafargeHolcim Ltd.	281	14	0,02
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				Summe Spanien		1.410	1,97			47	0,06
Telenor ASA	2.635	54	0,07	<b>SCHWEDEN</b>				<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Summe Norwegen		301	0,42	<b>LUXUSGÜTER</b>				Swisscom AG	60	27	0,04
<b>PORTUGAL</b>				Hennes & Mauritz AB 'B'	1.857	28	0,04	Summe Schweiz		1.973	2,75
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>FINANZWERTE</b>				<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
EDP - Energias de Portugal S.A.	19.068	76	0,10	Nordea Bank AB	10.787	103	0,14	<b>LUXUSGÜTER</b>			
<b>SINGAPUR</b>				Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	3.976	38	0,05	Barratt Developments PLC	1.348	9	0,01
<b>FINANZWERTE</b>				Swedbank AB 'A'	1.843	39	0,06	Berkeley Group Holdings PLC	598	30	0,04
DBS Group Holdings Ltd.	5.800	113	0,16			180	0,25	Compass Group PLC	2.707	58	0,08
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.	9.000	77	0,11	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Fiat Chrysler Automobiles NV	10.690	202	0,28
United Overseas Bank Ltd.	3.900	76	0,10	Epiroc AB (a)	427	5	0,01	Greene King PLC	2.000	15	0,02
		266	0,37	S.A.S. AB (a)	6.684	13	0,01	ITV PLC	7.002	16	0,02
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Sandvik AB	1.248	22	0,03	Kingfisher PLC	19.661	77	0,11
ComfortDelGro Corp. Ltd.	8.700	15	0,02	Volvo AB 'B'	2.666	42	0,06	Marks & Spencer Group PLC	21.808	85	0,12
Keppel Corp. Ltd.	13.300	69	0,10			82	0,11	Next PLC	858	68	0,10
Singapore Airlines Ltd.	2.500	20	0,03	<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>				Pearson PLC	7.317	85	0,12
		104	0,15	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	16.706	129	0,18	Persimmon PLC	267	9	0,01
								Taylor Wimpey PLC	3.727	9	0,01
								Thomas Cook Group PLC	11.491	16	0,02
								William Hill PLC	7.817	31	0,05
								WPP PLC	5.166	81	0,11
										791	1,10



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- TWERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- TWERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- TWERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
American Express Co.	2.874	\$ 282	0,39	Cardinal Health, Inc.	690	\$ 34	0,05	<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
American Financial Group, Inc.	197	21	0,03	Cigna Corp.	237	40	0,06	Activision Blizzard, Inc.	697	\$ 53	0,07
American International Group, Inc.	10.229	542	0,76	Community Health Systems, Inc. (a)	7.232	24	0,03	Alphabet, Inc. 'A' (a)	74	84	0,12
Ameriprise Financial, Inc.	584	82	0,11	CVS Health Corp.	3.586	231	0,32	Amdocs Ltd.	250	17	0,02
Assurant, Inc.	545	56	0,08	DaVita, Inc. (a)	147	10	0,01	Apple, Inc.	7.743	1.433	2,00
Bank of America Corp.	17.949	506	0,71	Eli Lilly & Co.	1.115	95	0,13	Applied Materials, Inc.	274	13	0,02
Bank of New York Mellon Corp.	2.423	131	0,18	Express Scripts Holding Co. (a)	3.369	260	0,36	Arrow Electronics, Inc. (a)	483	36	0,05
BB&T Corp.	1.307	66	0,09	Gilead Sciences, Inc.	3.957	280	0,39	Avaya Holdings Corp. (a)	647	13	0,02
Berkshire Hathaway, Inc. 'B' (a)	1.464	273	0,38	HCA Healthcare, Inc.	2.645	272	0,38	Avnet, Inc.	1.181	51	0,07
BlackRock, Inc.	107	53	0,07	Humana, Inc.	292	87	0,12	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	1.230	54	0,07
Brighthouse Financial, Inc. (a)	207	8	0,01	Johnson & Johnson	3.436	417	0,58	CA, Inc.	1.955	70	0,10
Capital One Financial Corp.	2.638	242	0,34	Kindred Healthcare, Inc. (a)	2.783	25	0,04	Cisco Systems, Inc.	7.192	309	0,43
CIT Group, Inc.	1.065	54	0,08	LifePoint Health, Inc. (a)	1.313	64	0,09	Conduent, Inc. (a)	880	16	0,02
Citigroup, Inc.	9.276	621	0,87	Mallinckrodt PLC (a)	2.372	44	0,06	Corning, Inc.	6.750	186	0,26
Citizens Financial Group, Inc.	1.663	65	0,09	McKesson Corp.	182	24	0,03	DXC Technology Co.	100	8	0,01
CNO Financial Group, Inc.	1.181	23	0,03	Merck & Co., Inc.	6.935	421	0,59	eBay, Inc. (a)	558	20	0,03
Comerica, Inc.	240	22	0,03	Pfizer, Inc.	26.080	946	1,32	First Solar, Inc. (a)	401	21	0,03
Discover Financial Services	2.003	141	0,20	Quest Diagnostics, Inc.	573	63	0,09	Hewlett Packard Enterprise Co.	10.306	151	0,21
Fifth Third Bancorp	2.848	82	0,11	Tenet Healthcare Corp. (a)	6.531	219	0,31	HP, Inc.	4.942	112	0,16
Franklin Resources, Inc.	1.432	46	0,06	United Therapeutics Corp. (a)	96	11	0,02	Intel Corp.	11.762	585	0,82
Genworth Financial, Inc. 'A' (a)	11.962	54	0,08	UnitedHealth Group, Inc.	1.240	304	0,42	InterActiveCorp (a)	235	36	0,05
Goldman Sachs Group, Inc.	677	149	0,21	Universal Health Services, Inc. 'B'	297	33	0,05	International Business Machines Corp.	5.091	711	0,99
Hartford Financial Services Group, Inc.	1.822	93	0,13	Valeant Pharmaceuticals International, Inc. (a)	9.367	218	0,30	Intuit, Inc.	77	16	0,02
Invesco Ltd.	946	25	0,04					Jabil, Inc.	1.414	39	0,05
JPMorgan Chase & Co.	7.683	801	1,12			5.293	7,39	Juniper Networks, Inc.	1.991	55	0,08
KeyCorp	490	10	0,01	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				KLA-Tencor Corp.	391	40	0,06
Legg Mason, Inc.	1.192	41	0,06	3M Co.	617	121	0,17	Micron Technology, Inc. (a)	231	12	0,02
Lincoln National Corp.	480	30	0,04	AGCO Corp.	462	28	0,04	Microsoft Corp.	6.594	650	0,91
Loews Corp.	1.101	53	0,07	American Airlines Group, Inc.	3.344	127	0,18	Motorola Solutions, Inc.	1.059	123	0,17
LPL Financial Holdings, Inc.	442	29	0,04	Avis Budget Group, Inc. (a)	2.640	86	0,12	NetApp, Inc.	1.785	140	0,20
MetLife, Inc.	2.258	98	0,14	Caterpillar, Inc.	1.284	174	0,24	Oracle Corp.	6.493	286	0,40
Morgan Stanley	682	32	0,04	CSX Corp.	1.307	83	0,12	Perspecta, Inc.	50	1	0,00
Navient Corp.	7.011	91	0,13	Cummins, Inc.	188	25	0,04	Qorvo, Inc. (a)	277	22	0,03
New York Community Bancorp, Inc.	1.128	12	0,02	Deere & Co.	1.339	187	0,26	QUALCOMM, Inc.	4.483	252	0,35
OneMain Holdings, Inc. (a)	597	20	0,03	Delta Air Lines, Inc.	306	15	0,02	Seagate Technology PLC	4.266	241	0,34
PNC Financial Services Group, Inc.	1.080	146	0,20	Dover Corp.	281	21	0,03	Symantec Corp.	2.756	57	0,08
Progressive Corp.	239	14	0,02	Dun & Bradstreet Corp.	83	10	0,01	Teradata Corp. (a)	1.306	52	0,07
Prudential Financial, Inc.	681	64	0,09	Eaton Corp. PLC	195	15	0,02	Texas Instruments, Inc.	864	95	0,13
Regions Financial Corp.	2.749	49	0,07	Emerson Electric Co.	2.055	142	0,20	Visa, Inc. 'A'	76	10	0,01
Reinsurance Group of America, Inc.	121	16	0,02	FedEx Corp.	281	64	0,09	Western Digital Corp.	472	36	0,05
Santander Consumer USA Holdings, Inc.	2.958	57	0,08	Fluor Corp.	972	48	0,07	Western Union Co.	3.162	64	0,09
SLM Corp. (a)	1.933	22	0,03	General Dynamics Corp.	318	59	0,08	Xerox Corp.	2.321	56	0,08
State Street Corp.	1.166	109	0,15	General Electric Co.	36.582	498	0,70			6.226	8,69
SunTrust Banks, Inc.	1.134	75	0,10	Hertz Global Holdings, Inc. (a)	4.781	73	0,10	<b>BAUSTOFFE</b>			
Synchrony Financial	2.753	92	0,13	Honeywell International, Inc.	376	54	0,08	Alcoa Corp. (a)	1.635	77	0,11
T Rowe Price Group, Inc.	297	35	0,05	Illinois Tool Works, Inc.	532	74	0,10	Ashland Global Holdings, Inc.	239	19	0,03
Travelers Cos., Inc.	2.055	251	0,35	JetBlue Airways Corp. (a)	525	10	0,01	CF Industries Holdings, Inc.	967	43	0,06
U.S. Bancorp	2.903	145	0,20	L3 Technologies, Inc.	51	10	0,01	Domtar Corp.	1.246	59	0,08
Voya Financial, Inc.	3.322	156	0,22	ManpowerGroup, Inc.	304	26	0,04	DowDuPont, Inc.	1.690	111	0,16
Wells Fargo & Co.	9.382	520	0,73	Neilsen Holdings PLC	495	15	0,02	International Paper Co.	865	45	0,06
White Mountains Insurance Group Ltd.	32	29	0,04	Norfolk Southern Corp.	455	69	0,10	LyondellBasell Industries NV 'A'	2.265	249	0,35
		7.078	9,88	Pitney Bowes, Inc.	433	133	0,19	Mosaic Co.	4.369	123	0,17
				Quanta Services, Inc. (a)	674	23	0,03	PPG Industries, Inc.	366	38	0,05
<b>GESUNDHEITSWESSEN</b>				Raytheon Co.	333	64	0,09	Praxair, Inc.	203	32	0,04
Abbott Laboratories	1.510	92	0,13	Ryder System, Inc.	433	31	0,04	Reliance Steel & Aluminum Co.	106	9	0,01
AbbVie, Inc.	1.830	170	0,24	Stanley Black & Decker, Inc.	68	9	0,01			805	1,12
Aetna, Inc.	920	169	0,24	Trinity Industries, Inc.	664	23	0,03	<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Allergan PLC	521	87	0,12	Union Pacific Corp.	1.440	204	0,28	AT&T, Inc.	14.866	477	0,67
Amgen, Inc.	1.041	192	0,27	United Continental Holdings, Inc. (a)	596	42	0,06	CenturyLink, Inc.	10.162	189	0,26
Anthem, Inc.	1.512	360	0,50	United Rentals, Inc. (a)	93	14	0,02	Frontier Communications Corp.	8.092	43	0,06
Bristol-Myers Squibb Co.	1.033	57	0,08	United Technologies Corp.	1.633	204	0,28	Telephone & Data Systems, Inc.	1.485	41	0,06
Brookdale Senior Living, Inc. (a)	4.782	44	0,06	Waste Management, Inc.	164	13	0,02	Verizon Communications, Inc.	10.686	538	0,75
				WW Grainger, Inc.	229	71	0,10			1.288	1,80
						2.898	4,05				

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>											
AES Corp.	10.019	\$ 134	0,19	Vistra Energy Corp. (a)	2.181	\$ 52	0,07	Mirvac Group	5.627	\$ 9	0,01
Ameren Corp.	1.231	75	0,11	Xcel Energy, Inc.	1.286	59	0,08	Quality Care Properties, Inc. (a)	1.219	26	0,04
American Electric Power Co., Inc.	1.653	114	0,16			1.994	2,78	Stockland	7.655	23	0,03
CenterPoint Energy, Inc.	1.995	55	0,08	Summe USA		36.128	50,44	Ventas, Inc.	275	16	0,02
CMS Energy Corp.	221	10	0,01	Summe Stammaktien		70.521	98,45	Welltower, Inc.	178	11	0,02
Consolidated Edison, Inc.	1.327	103	0,14							366	0,51
DTE Energy Co.	163	17	0,02	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				<b>RECHTE</b>			
Duke Energy Corp.	2.429	192	0,27	Volkswagen AG	1.466	242	0,34	ACS Actividades de			
Edison International	926	59	0,08	<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>				ACS Construcción y Servicios			
Entergy Corp.	1.880	152	0,21	AGNC Investment Corp.	1.184	22	0,03	S.A. - Exp. 11.07.2018	2.827	2	0,01
Eversource Energy	669	39	0,05	Annaly Capital Management, Inc.	5.092	52	0,07	Intesa Sanpaolo SpA - Exp.	44.867	0	0,00
Exelon Corp.	4.664	199	0,28	British Land Co. PLC	2.562	23	0,03	17.07.2018	1.078	1	0,00
FirstEnergy Corp.	4.634	166	0,23	Cominar Real Estate				Repsol S.A. - Exp. 06.07.2018			
MDU Resources Group, Inc.	1.210	35	0,05	Investment Trust	1.510	15	0,02				
NextEra Energy, Inc.	306	51	0,07	CoreCivic, Inc.	1.847	44	0,06	Summe Übertragbare Wertpapiere			
NRG Energy, Inc.	1.794	55	0,08	Dream Office Real Estate				und Geldmarktinstrumente – Amtliche			
PG&E Corp.	2.088	89	0,12	Investment Trust	1.233	22	0,03	Börse/Geregelter Markt		\$ 71.132	99,31
Pinnacle West Capital Corp.	405	33	0,05	H&R Real Estate Investment Trust	915	14	0,02	Summe Anlagen		\$ 71.132	99,31
PPL Corp.	1.997	57	0,08	Hospitality Properties Trust	703	20	0,03	Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 494	0,69
Public Service Enterprise Group, Inc.	2.047	111	0,16	Intu Properties PLC	5.662	13	0,02	Nettovermögen		\$ 71.626	100,00
SCANA Corp.	1.332	51	0,07	Iron Mountain, Inc.	304	11	0,02				
Sempra Energy	177	21	0,03	Land Securities Group PLC	3.605	45	0,06				
Southern Co.	1.406	65	0,09								

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

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

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 38.999	\$ 32.133	\$ 0	\$ 71.132

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 53.155	\$ 49.137	\$ 0	\$ 102.292

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	93,87	99,20
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	5,42	0,00
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0,02	0,02

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
General Electric Co.	26.909	\$ 382	HSBC Holdings PLC	88.196	\$ 892
Apple, Inc.	1.331	246	Apple, Inc.	4.814	846
Exxon Mobil Corp.	2.568	205	Bank of America Corp.	24.199	750
Verizon Communications, Inc.	3.963	190	JPMorgan Chase & Co.	6.616	747
Gilead Sciences, Inc.	2.448	178	BHP Billiton Ltd.	22.891	555
CVS Health Corp.	2.699	177	Banco Santander S.A.	82.819	555
American International Group, Inc.	3.234	177	Pfizer, Inc.	13.898	513
Wal-Mart Stores, Inc.	2.028	176	Citigroup, Inc.	6.911	511
Vodafone Group PLC	59.368	162	BP PLC	62.803	439
AT&T, Inc.	4.576	154	Microsoft Corp.	4.338	408
Target Corp.	1.965	146	Royal Dutch Shell PLC 'A'	12.128	408
Pfizer, Inc.	3.652	131	Intel Corp.	8.038	405
International Business Machines Corp.	900	129	BHP Billiton PLC	18.044	390
JPMorgan Chase & Co.	1.168	124	International Business Machines Corp.	2.359	373
AbbVie, Inc.	1.156	124	BNP Paribas S.A.	4.512	345
Johnson & Johnson	954	120	Barclays PLC	114.101	325
Chevron Corp.	970	119	Wal-Mart Stores, Inc.	3.236	312
Daimler AG	1.460	117	Exxon Mobil Corp.	3.389	284
QUALCOMM, Inc.	1.906	115	Fiat Chrysler Automobiles NV	11.864	267
Home Depot, Inc.	621	114	American International Group, Inc.	4.440	261

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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets 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
<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
HarborView Mortgage Loan Trust				Fannie Mae, TBA				<b>PENSIONSGESCHÄFTE (i)</b>			
2,395 % fällig am 19.11.2035	\$ 15	\$ 15	0,03	3,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 7.700	\$ 7.656	15,19				
2,424 % fällig am 20.06.2035	7	7	0,01	4,000 % fällig am 01.09.2048	600	610	1,21		\$ 433		0,86
<b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>						<b>8.266</b>	<b>16,40</b>				
2,291 % fällig am 25.10.2036	15	15	0,03	<b>US-SCHATZOBIGLATIONEN</b>				<b>KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>			
2,361 % fällig am 25.10.2036	377	260	0,52	<b>U.S. Treasury Bonds</b>				Federal Home Loan Bank			
<b>JPMorgan Mortgage Trust</b>				3,000 % fällig am 15.02.2048	1.100	1.104	2,19	1,892 % fällig am 22.08.2018 (b)(c)	\$ 900	898	1,78
3,613 % fällig am 25.01.2037 ^	48	46	0,09	4,250 % fällig am 15.05.2039	400	483	0,96	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
3,782 % fällig am 25.06.2037 ^	119	117	0,23	4,375 % fällig am 15.11.2039	1.400	1.720	3,41	(2,677) % fällig am 12.10.2018 (b)(c)	ARS 70	3	0,01
<b>Lehman XS Trust</b>				4,375 % fällig am 15.05.2040	800	985	1,95	2,974 % fällig am 16.11.2018 (b)(c)	\$ 100	98	0,19
2,941 % fällig am 25.09.2047	37	36	0,07	4,500 % fällig am 15.08.2039	200	249	0,49				
<b>Melton Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust</b>				4,625 % fällig am 15.02.2040	300	381	0,76				
2,513 % fällig am 15.12.2030	4	4	0,01	<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)</b>							
<b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>				0,125 % fällig am 15.04.2021	317	312	0,62				
2,241 % fällig am 25.02.2047	102	65	0,13	0,125 % fällig am 15.01.2022	664	653	1,30				
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	184	172	0,34	0,125 % fällig am 15.04.2022	1.442	1.413	2,80				
<b>Residential Asset Securitization Trust</b>				0,125 % fällig am 15.07.2024	980	964	1,91				
2,541 % fällig am 25.04.2035 ^	72	59	0,12	0,125 % fällig am 15.07.2024	2.110	2.052	4,07				
<b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>				0,375 % fällig am 15.01.2027	622	605	1,20				
3,424 % fällig am 25.09.2037	17	17	0,03	1,000 % fällig am 15.07.2027	205	199	0,40				
<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>				2,500 % fällig am 15.02.2048	813	841	1,67				
2,867 % fällig am 25.01.2037 ^	5	5	0,01	2,500 % fällig am 15.01.2029	1.750	2.058	4,08				
3,097 % fällig am 25.12.2036 ^	5	4	0,01	<b>U.S. Treasury Notes</b>							
3,136 % fällig am 25.04.2037 ^	5	4	0,01	1,625 % fällig am 30.06.2020	200	196	0,39				
3,321 % fällig am 25.09.2036 ^	8	8	0,02	1,750 % fällig am 31.12.2020 (h)	2.900	2.842	5,64				
3,438 % fällig am 25.12.2036 ^	17	16	0,03	2,000 % fällig am 31.10.2021	400	392	0,78				
3,540 % fällig am 25.06.2037 ^	97	93	0,18	2,125 % fällig am 30.09.2021	400	394	0,78				
<b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>				2,125 % fällig am 30.06.2022	200	196	0,39				
2,401 % fällig am 25.06.2037	412	380	0,75	2,125 % fällig am 15.05.2025	2.400	2.297	4,56				
2,528 % fällig am 25.05.2046 ^	422	370	0,73	2,250 % fällig am 31.12.2023	800	779	1,54				
		<b>5.314</b>	<b>10,54</b>	2,750 % fällig am 15.11.2023	2.600	2.599	5,16				
						<b>23.714</b>	<b>47,05</b>				
				Summe USA		<b>45.756</b>	<b>90,79</b>				

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
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2018	106	\$ (61)	(0,12)
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2019	106	73	0,15
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2019	90	(58)	(0,12)
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03/2020	90	59	0,12
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2020	28	(8)	(0,02)
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09/2021	28	3	0,01
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	13	(15)	(0,03)
Euro-Bobl September Futures	Long	09/2018	20	13	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	15	19	0,04
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	15	(29)	(0,06)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09/2018	30	3	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	28	5	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09/2018	35	(14)	(0,03)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	14	(68)	(0,14)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	1	(2)	(0,01)
				\$ (80)	(0,16)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (80)	(0,16)

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	3-Month USD-LIBOR	1,500 %	21.06.2024	\$ 400	\$ 12	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	16.12.2018	15.900	260	0,51
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.12.2026	700	79	0,16
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	900	3	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000 %	20.06.2025	\$ 6.900	\$ 16	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	3.500	3	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	1.700	396	0,78
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,500	15.12.2023	4.900	(32)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	1.800	(8)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,540	23.03.2048	100	8	0,02
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,750	15.12.2026	400	3	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,900	05.03.2021	19.400	(21)	(0,04)
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,930	05.03.2022	19.400	8	0,02
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,985	05.06.2029	1.700	4	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	3,000	25.11.2020	1.400	8	0,02
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	3,007	30.05.2049	100	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.12.2048	€ 400	(11)	(0,02)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,514	04.01.2028	3.500	20	0,04
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	04.01.2028	700	14	0,03
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,036	03.02.2037	1.400	7	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,050	04.01.2038	7.000	17	0,03
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,099	04.01.2033	7.200	(22)	(0,05)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,150	04.01.2033	4.100	(31)	(0,06)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	19.09.2019	£ 16.000	(2)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	18.09.2020	16.000	9	0,02
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	2,000	18.03.2022	1.100	13	0,02
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	2,040	01.02.2037	400	(6)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	2,043	01.02.2037	1.000	(16)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.06.2022	¥ 1.760.000	6	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.06.2025	700.000	(9)	(0,02)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,500	20.09.2046	56.000	11	0,02
Zahlung	CPTFEMU	0,740	15.01.2020	€ 600	14	0,03
Zahlung	CPTFEMU	1,710	15.03.2033	1.000	4	0,01
Erhalt	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	1.000	(14)	(0,03)
					\$ 743	1,47
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 743</b>	<b>1,47</b>

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

#### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

#### OPTIONSKAUF

##### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Put - OTC EUR versus RUB	RUB 73,412	12.07.2018	€ 137	\$ 2	\$ 2	0,01
HUS	Put - OTC USD versus RUB	59,150	12.07.2018	\$ 138	2	0	0,00
					\$ 4	\$ 2	0,01

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	1,750 %	12.10.2018	£ 500	\$ 13	\$ 4	0,01
CBK	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,970	24.09.2018	\$ 300	16	7	0,01
DUB	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	1,670	08.10.2018	£ 300	8	3	0,01
FBF	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,850	30.11.2018	\$ 20.300	29	2	0,00
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,150	31.01.2019	12.500	13	4	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,970	24.09.2018	500	26	12	0,02
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	1,700	11.10.2018	£ 500	13	5	0,01
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,040	22.06.2020	\$ 23.800	85	91	0,18
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,650	15.11.2018	4.200	24	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,785	21.09.2018	5.000	28	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,050	12.12.2018	800	38	22	0,04
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,370	27.03.2020	2.300	93	83	0,17
					\$ 386	\$ 233	0,46		

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

##### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 69,000	05.07.2018	\$ 34.700	\$ 1	\$ 0	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund (Forts.)

## VERKAUFSOPTIONEN

### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC USD versus MXN	MXN 20,000	25.07.2018	\$ 479	\$ (8)	\$ (6)	(0,01)
CBK	Call - OTC EUR versus TRY	TRY 5,900	14.11.2018	€ 500	(16)	(17)	(0,04)
	Call - OTC USD versus TRY	4,900	14.11.2018	€ 600	(17)	(22)	(0,04)
GLM	Call - OTC EUR versus RUB	RUB 82,554	12.07.2018	€ 117	(2)	0	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 20,250	02.08.2018	\$ 479	(6)	(5)	(0,01)
HUS	Call - OTC USD versus RUB	RUB 66,450	12.07.2018	118	(2)	0	0,00
MSB	Put - OTC USD versus MXN	MXN 18,200	25.07.2018	479	(5)	0	0,00
					\$ (56)	\$ (50)	(0,10)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,600 %	24.09.2018	\$ 1.100	\$ (11)	\$ (18)	(0,03)
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,600	24.09.2018	2.300	(25)	(38)	(0,07)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,210	31.01.2019	2.500	(13)	(4)	(0,01)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,019	21.06.2021	23.800	(112)	(120)	(0,24)
	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	27.03.2020	16.400	(91)	(90)	(0,18)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,700	12.12.2018	3.900	(41)	(59)	(0,12)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,000	15.11.2018	900	(24)	0	0,00
							\$ (317)	\$ (329)	(0,65)

## 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
BOA	CDX.HY-23 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2019	\$ 100	\$ 13	\$ (6)	\$ 7	0,01

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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
GLM	Zahlung	CPTFEMU	0,993 %	30.03.2020	€ 800	\$ 0	\$ 5	\$ 5	0,01

## 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
FBF	Erhalt	ERAEMLT Index	737	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 2.126	07.11.2018	\$ 0	\$ (90)	\$ (90)	(0,18)
JPM	Erhalt	ERAEMLT Index	12.823	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	36.817	07.11.2018	0	(1.395)	(1.395)	(2,77)
MEI	Erhalt	ERAEMLT Index	4.702	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	13.565	12.09.2018	0	(578)	(578)	(1,15)
							\$ 0	\$ (2.063)	\$ (2.063)	(4,10)

## DEISENTERMINCONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	09/2018	\$ 157	SGD 210	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	(0,01)
	11/2018	€ 100	\$ 122	4	0	4	0,01
BOA	07/2018	BRL 302	\$ 81	2	0	2	0,01
	07/2018	\$ 10	BRL 37	0	0	0	0,00
	07/2018	€ 646	€ 552	1	(2)	(1)	0,00
	07/2018	172	RUB 10.759	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	BRL 37	\$ 10	0	0	0	0,00
	08/2018	NOK 250	30	0	0	0	0,00
	08/2018	RUB 18.207	286	0	(3)	(3)	(0,01)
	08/2018	SEK 750	86	2	0	2	0,00
	08/2018	\$ 446	ZAR 6.123	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	CNY 1.615	\$ 250	7	0	7	0,01
	09/2018	INR 5.715	83	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BPS	09/2018	SGD 2.154	\$ 1.622	\$ 40	\$ 0	\$ 40	0,08
	07/2018	ARS 3.219	117	6	0	6	0,01
	07/2018	€ 2.299	2.667	0	(18)	(18)	(0,03)
	07/2018	TRY 255	61	6	0	6	0,01
	07/2018	\$ 116	ARS 3.219	0	(6)	(6)	(0,01)
	08/2018	MXN 1.245	\$ 62	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	IDR 690.671	48	0	0	0	0,00
	09/2018	INR 4.598	66	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 293	CNY 1.948	0	0	0	0,00
	09/2018	75	TWD 2.247	0	(1)	(1)	0,00
	12/2018	¥ 70.000	\$ 638	0	(2)	(2)	0,00
BRC	09/2018	ARS 974	35	4	0	4	0,01
	09/2018	\$ 131	MYR 527	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2018	CAD 420	\$ 320	1	0	1	0,00
	07/2018	COP 73.354	25	0	0	0	0,00
	07/2018	£ 754	999	3	0	3	0,01
	07/2018	PEN 85	26	0	0	0	0,00
	07/2018	PLN 184	50	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 144	CAD 190	0	0	0	0,00
	07/2018	154	€ 133	2	0	2	0,00
	07/2018	148	£ 112	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	805	RUB 50.885	6	0	6	0,01
	07/2018	12	TRY 55	0	0	0	0,00
	08/2018	NOK 2.100	\$ 258	0	0	0	0,00
	08/2018	TRY 560	123	4	0	4	0,01
	08/2018	\$ 416	MXN 8.638	19	0	19	0,04
	08/2018	1.107	TRY 4.900	0	(57)	(57)	(0,11)
	08/2018	ZAR 5.979	\$ 441	7	0	7	0,01
	09/2018	CNY 1.376	209	2	0	2	0,00
	09/2018	PHP 810	15	0	0	0	0,00
	09/2018	TWD 1.484	49	0	0	0	0,00
	12/2018	¥ 110.000	1.004	0	(2)	(2)	0,00
	12/2018	\$ 1.631	¥ 180.000	15	0	15	0,03
	03/2019	€ 100	\$ 127	8	0	8	0,02
DUB	07/2018	\$ 115	ARS 3.219	0	(4)	(4)	(0,01)
FBF	07/2018	AUD 423	\$ 316	4	0	4	0,01
	10/2018	€ 100	125	7	0	7	0,01
GLM	07/2018	CLP 15.968	25	0	0	0	0,00
	07/2018	COP 205.995	73	3	0	3	0,01
	07/2018	€ 43	50	0	0	0	0,00
	07/2018	¥ 5.100	47	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 100	BRL 375	0	(2)	(2)	(0,01)
	07/2018	259	CAD 345	3	0	3	0,01
	07/2018	36	COP 104.439	0	0	0	0,00
	07/2018	478	€ 410	0	0	0	0,00
	07/2018	26	PEN 86	0	0	0	0,00
	07/2018	49	PLN 185	0	0	0	0,00
	07/2018	531	RUB 33.116	0	(4)	(4)	(0,01)
	08/2018	RUB 91.548	\$ 1.443	0	(9)	(9)	(0,02)
	08/2018	\$ 1.104	RUB 70.314	12	(1)	11	0,02
	08/2018	416	SEK 3.550	0	(18)	(18)	(0,04)
	09/2018	CNY 3.929	\$ 594	3	0	3	0,01
	09/2018	INR 10.799	155	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	KRW 341.292	307	1	(1)	0	0,00
	09/2018	PHP 1.889	35	0	0	0	0,00
	09/2018	TWD 4.695	158	3	0	3	0,01
	09/2018	\$ 25	CLP 15.968	0	0	0	0,00
	09/2018	667	CNH 4.267	0	(25)	(25)	(0,05)
	09/2018	126	CNY 838	0	0	0	0,00
	09/2018	265	INR 18.364	0	0	0	0,00
	09/2018	1.103	KRW 1.216.291	3	(11)	(8)	(0,02)
	09/2018	51	PHP 2.755	0	0	0	0,00
HUS	07/2018	RUB 62.557	\$ 980	0	(17)	(17)	(0,03)
	07/2018	TRY 1.356	284	0	(10)	(10)	(0,02)
	07/2018	\$ 62	COP 172.735	0	(3)	(3)	(0,01)
	07/2018	56	£ 42	0	0	0	0,00
	07/2018	127	RUB 8.002	1	0	1	0,00
	07/2018	27	TRY 124	0	0	0	0,00
	08/2018	MXN 1.872	\$ 93	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	NOK 520	64	0	0	0	0,00
	08/2018	RUB 8.002	126	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	\$ 476	RUB 29.724	0	(4)	(4)	(0,01)
	08/2018	253	ZAR 3.534	4	0	4	0,01
	08/2018	ZAR 805	\$ 64	5	0	5	0,01
	09/2018	CNY 357	55	1	0	1	0,00
	09/2018	HKD 2.173	278	0	0	0	0,00
	09/2018	IDR 287.940	20	0	0	0	0,00
	09/2018	INR 20.334	295	1	0	1	0,00
	09/2018	TWD 2.683	88	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 520	CNY 3.384	0	(12)	(12)	(0,02)
	09/2018	317	HKD 2.480	0	0	0	0,00
	09/2018	37	TWD 1.125	0	0	0	0,00
	01/2021	BRL 70	\$ 11	0	(5)	(5)	(0,01)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens	
IND	07/2018	TRY	746	\$ 163	\$ 1	\$ 0	0,00	
	09/2018	THB	1.534	47	1	0	0,00	
	09/2018	TWD	6.128	204	2	0	0,00	
JPM	07/2018	AUD	22	17	0	0	0,00	
	07/2018	BRL	110	29	0	0	0,00	
	07/2018	CAD	449	346	5	0	0,01	
	07/2018	€	42	49	0	0	0,00	
	07/2018	TRY	1.586	344	0	0	0,00	
	08/2018	MXN	32	2	0	0	0,00	
	08/2018	\$	354	NOK 2.870	0	(2)	0,00	
	08/2018		266	ZAR 3.675	1	0	0,00	
	09/2018	INR	8.764	\$ 127	0	0	0,00	
	09/2018	\$	35	IDR 501.200	0	0	0,00	
	09/2018		434	INR 29.981	0	(1)	0,00	
	09/2018		254	SGD 343	0	(2)	(0,01)	
	03/2019	€	567	\$ 677	2	0	0,00	
MSB	09/2018	TWD	1.505	51	1	0	0,00	
	09/2018	\$	368	TWD 10.990	0	(6)	(0,01)	
	11/2018	€	100	\$ 122	4	0	0,01	
RBC	07/2018	\$	114	TRY 548	6	0	0,01	
	08/2018		62	285	0	(1)	0,00	
RYL	08/2018	RUB	7.701	\$ 121	0	(1)	0,00	
	08/2018	\$	114	RUB 7.213	1	0	0,00	
	08/2018		59	ZAR 745	0	(6)	(0,01)	
	08/2018	ZAR	809	\$ 65	6	0	0,01	
	09/2018	\$	63	INR 4.394	1	0	0,00	
	09/2018		212	SGD 281	0	(5)	(0,01)	
SCX	07/2018		88	£ 66	0	(1)	0,00	
	08/2018		577	RUB 36.339	2	(2)	0,00	
	09/2018	KRW	2.168.801	\$ 2.011	60	(1)	0,12	
	09/2018	\$	83	INR 5.718	0	0	0,00	
	09/2018		183	KRW 201.801	0	(2)	0,00	
	09/2018		262	TWD 7.830	0	(4)	(0,01)	
SOG	07/2018		25	CLP 15.968	0	0	0,00	
	09/2018	INR	8.078	\$ 118	1	0	0,00	
	09/2018	KRW	191.492	174	2	0	0,00	
SSB	07/2018	\$	1.452	€ 1.247	5	0	0,01	
	08/2018	€	1.247	\$ 1.455	0	(5)	(0,01)	
	08/2018	MXN	4.025	192	0	(11)	(0,02)	
	09/2018	HKD	2.504	320	0	0	0,00	
TOR	07/2018	TRY	1.238	270	2	0	0,00	
UAG	07/2018	\$	706	£ 534	0	(1)	0,00	
	08/2018	£	534	\$ 707	1	0	0,00	
	08/2018	SEK	425	48	1	0	0,00	
	09/2018	HKD	215	27	0	0	0,00	
	09/2018	MYR	1.746	434	3	0	0,01	
	09/2018	TWD	5.484	183	2	0	0,00	
	09/2018	\$	35	IDR 499.497	0	(1)	0,00	
	09/2018		307	MYR 1.235	0	(2)	0,00	
					\$ 302	\$ (283)	\$ 19	0,04
Summe Freiverkehrsfondsderivate							\$ (2.176)	(4,32)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS
<b>Einlagenzertifikate</b>			
Barclays Bank PLC 1,940 % fällig am 04.09.2018	\$ 200	\$ 200	0,40
Summe Einlagenzertifikate		\$ 200	0,40
Summe Anlagen		\$ 57.114	113,33
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (6.717)	(13,33)
Nettovermögen		\$ 50.397	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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(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) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.254 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 914 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 3.480 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(i) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 433	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	\$ (443)	\$ 433	\$ 433	0,86

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

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 5.824	\$ 52.603	\$ 0	\$ 58.427
Einlagen bei Kreditinstituten	0	200	0	200
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(79)	(1.434)	0	(1.513)
<b>Summen</b>	<b>\$ 5.745</b>	<b>\$ 51.369</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 57.114</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 11.355	\$ 70.493	\$ 0	\$ 81.848
Einlagen bei Kreditinstituten	0	300	0	300
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(46)	4.544	0	4.498
<b>Summen</b>	<b>\$ 11.309</b>	<b>\$ 75.337</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 86.646</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 der Wertpapieranlagen.

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

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2018:**

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkaufgeschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	2,220 %	22.06.2018	23.07.2018	\$ (2.251)	\$ (2.252)	(4,47)
<b>Summe Rückkaufgeschäfte</b>					<b>\$ (2.252)</b>	<b>(4,47)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 3 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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 1	\$ 0	\$ 1
BOA	52	0	52
BPS	(22)	0	(22)
BRC	7	0	7
CBK	(42)	0	(42)
DUB	(1)	0	(1)
FBF	(77)	240	163
GLM	(67)	0	(67)
HUS	(42)	0	(42)
IND	4	0	4
JPM	(1.387)	2.490	1.103
MEI	(578)	750	172
MSB	(1)	0	(1)
MYC	(73)	(120)	(193)
RBC	5	0	5

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund (Forts.)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
RYL	\$ (4)	\$ 0	\$ (4)
SCX	52	0	52
SOG	3	0	3
SSB	(11)	0	(11)
TOR	2	0	2
UAG	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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	73,66	47,73
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	40,43	35,33
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,85	14,74
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,16)	(0,06)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,47	1,17
Freiverkehrsfinanzderivate	(4,32)	4,26
Einlagenzertifikate	0,40	0,36
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(4,47)	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)	
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>			
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 28.02.2025	\$ 5.200	\$ 5.190	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 28.02.2025	\$ 5.200	\$ 5.191	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	¥ 420.000	3.954	Facebook, Inc. 'A'	AKTIEN 13.233	2.402	
United Kingdom Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2018	£ 2.200	3.071		PARI (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.24 (b)	\$ 2.607	2.533	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.08.2027	\$ 2.500	2.376	
Facebook, Inc. 'A'	AKTIEN 13.233	2.357	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.29 (b)	1.507	1.776	
	PARI (000S)		PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)	15.770	1.601	
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 22.08.2018	\$ 1.600	1.595		PARI (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	1.425	1.404	Countrywide Asset-Backed Certificates 2,691 % fällig am 25.02.2036	\$ 1.600	1.601	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.06.2018	¥ 130.000	1.226	Chevron Corp.	AKTIEN 10.144	1.282	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.48 (b)	\$ 1.202	1.205		PARI (000S)		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	¥ 120.000	1.131	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,000 % fällig am 15.01.26 (b)	\$ 882	963	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.05.2018	\$ 120.000	1.103	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 2,371 % fällig am 25.08.2036	900	833	
U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 15.02.2048	1.100	1.071		AKTIEN 722	780	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.22 (b)	969	958	Alphabet, Inc. 'C'	20.802	765	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.29 (b)	810	953	Pfizer, Inc.	PARI (000S)		
	AKTIEN 722	795	Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 22.08.2018	\$ 700	698	
Alphabet, Inc. 'C'	20.802	744	Fremont Home Loan Trust 3,141 % fällig am 25.11.2034	700	695	
Pfizer, Inc.	6.750	736	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.27 (b)	706	690	
Chevron Corp.	PARI (000S)			AKTIEN 5.743	591	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.22 (b)	\$ 656	649	Walt Disney Co.	3.879	560	
	AKTIEN 5.743	603	Union Pacific Corp.	3.765	549	
Walt Disney Co.	5.743	603	International Business Machines Corp.	PARI (000S)		
International Business Machines Corp.	PARI (000S)	580		U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.24 (b)	\$ 527	514
United Kingdom Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.04.2018	£ 400	559		AKTIEN 11.409	506	
	AKTIEN 3.879	537	Cisco Systems, Inc.	4.450	483	
Union Pacific Corp.	PARI (000S)		Texas Instruments, Inc.	PARI (000S)		
Spain Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.04.2018	€ 400	496	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 2,361 % fällig am 25.04.2035	\$ 441	428	
	AKTIEN 11.409	494		AKTIEN 5.971	423	
Cisco Systems, Inc.	11.409	494	Activision Blizzard, Inc.	PARI (000S)		
Texas Instruments, Inc.	4.450	461		U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.48 (b)	\$ 404	412
				AKTIEN 4.714	410	
				PARI (000S)		
			U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.27 (b)	\$ 413	398	
				AKTIEN 8.310	391	
			Oracle Corp.	5.877	381	
			Republic Services, Inc.	9.145	373	
			Archer-Daniels-Midland Co.	6.914	366	
			Realty Income Corp.	PARI (000S)		
				U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.08.2026	\$ 400	357
				AKTIEN 2.035	355	
			Amgen, Inc.	1.383	345	
			Broadcom Ltd.	9.679	320	
			Neilsen Holdings PLC			

(a) Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS
3,608 % fällig am 20.10.2035	\$ 2.301	\$ 1.776	0,71	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust	\$ 98	\$ 98	0,04	0,375 % fällig am 15.01.2027	6.119	5.947	2,37
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	59	54	0,02	3,607 % fällig am 25.09.2036 ^	13	12	0,00	1,000 % fällig am 15.02.2048	2.946	3.049	1,22
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	393	340	0,14	3,640 % fällig am 25.10.2036 ^	11	11	0,00	2,000 % fällig am 15.01.2026	11.612	12.728	5,07
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	840	553	0,22	5,500 % fällig am 25.01.2036 ^				U.S. Treasury Notes			
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust						35.999	14,35	2,000 % fällig am 31.10.2021 (h)(i)(j)	\$ 38.800	\$ 37.994	15,14
2,571 % fällig am 25.04.2035	3	3	0,00	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				2,125 % fällig am 31.12.21 (h)(i)(j)	43.200	42.429	16,91
2,731 % fällig am 25.03.2035	11	11	0,00	Fannie Mae, TBA						159.451	63,55
2,751 % fällig am 25.02.2035	147	143	0,06	3,500 % fällig am 01.07.2048	33.600	33.410	13,32	Summe USA		270.439	107,79
2,951 % fällig am 25.09.2034	5	5	0,00	4,000 % fällig am 01.09.2048	3.500	3.558	1,42	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
3,215 % fällig am 20.02.2036	628	518	0,21	Freddie Mac				PENSIONSGESCHÄFTE (j)		2.311	0,92
Deutsche ALT-A Securities, Inc.				2,473 % fällig am 15.11.2043	1.108	1.114	0,44	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
3,590 % fällig am 25.02.2036 ^	1.663	1.597	0,64	<b>US-SCHATZobligationen</b>				2,974 % fällig am 16.11.2018 (b)(c)	400	393	0,15
IndyMac Mortgage Loan Trust				U.S. Treasury Bonds				Summe kurzfristige Instrumente		2.704	1,07
2,361 % fällig am 25.10.2036	6.131	4.220	1,68	2,750 % fällig am 15.08.2047	3.100	2.959	1,18	<b>AKTIEN</b>			
JPMorgan Mortgage Trust				4,250 % fällig am 15.05.2039	6.100	7.361	2,93	<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
3,782 % fällig am 25.06.2037 ^	338	332	0,13	4,375 % fällig am 15.05.2040	8.900	10.954	4,37	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO			
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				4,500 % fällig am 15.08.2039	6.400	7.983	3,18	US Dollar Short-Term Floating			
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	738	687	0,27	4,625 % fällig am 15.02.2040	3.400	4.316	1,72	NAV Fund (f)	1.357	14	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				Summe Übertragbare Wertpapiere und			
2,298 % fällig am 25.01.2047 ^	94	87	0,03	0,125 % fällig am 15.04.2021	1.480	1.457	0,58	Geldmarktinstrumente – Amtliche			
2,395 % fällig am 25.07.2046	234	229	0,09	0,125 % fällig am 15.01.2022	3.099	3.047	1,22	Börse/Geregelter Markt		\$ 320.510	127,74
2,511 % fällig am 25.05.2044	2.587	2.614	1,04	0,125 % fällig am 15.07.2022	4.575	4.500	1,79				
2,511 % fällig am 25.07.2044	882	887	0,35	0,125 % fällig am 15.04.2022	6.593	6.458	2,58				
3,306 % fällig am 25.02.2037 ^	505	469	0,19	0,125 % fällig am 15.07.2024	5.064	4.924	1,96				
3,540 % fällig am 25.06.2037 ^	970	931	0,37	0,250 % fällig am 15.01.2025	3.437	3.345	1,33				
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust											
2,401 % fällig am 25.06.2037	5.475	5.057	2,02								
Wells Fargo Alternative Loan Trust											
3,716 % fällig am 28.12.2037 ^	450	444	0,18								

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

\* Auf null lautende Saldı 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
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2018	638	\$ (763)	(0,31)
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2019	638	947	0,38
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2019	524	(492)	(0,20)
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03/2020	524	523	0,21
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	57	(74)	(0,03)
Euro-Bobl September Futures	Long	09/2018	15	11	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	93	74	0,03
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	77	(99)	(0,04)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09/2018	321	25	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2018	195	14	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09/2018	195	(15)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	70	151	0,06
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	163	(988)	(0,39)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09/2018	86	191	0,08
				\$ (495)	(0,20)

#### OPTIONSKAUF

##### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Call - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2018 Futures	\$ 107,750	24.08.2018	272	\$ 2	\$ 1	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	120,000	24.08.2018	2	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	120,250	24.08.2018	13	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	133,000	24.08.2018	129	1	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	137,000	24.08.2018	4	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	137,500	24.08.2018	42	1	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	113,000	24.08.2018	3	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2018 Futures	200,000	24.08.2018	139	1	0	0,00
				\$ 5	\$ 1	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (494)	(0,20)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund

## 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 Nettover- mögens
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000 %	20.12.2023	\$ 1.800	\$ 50	0,02
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2022	400	(6)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2021	1.100	(17)	(0,01)
General Motors Co.	5,000	20.06.2022	100	(1)	0,00
				\$ 26	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 Nettover- mögens
CDX.IG-25 5-Year Index	1,000 %	20.12.2020	\$ 8.500	\$ 126	0,05
CDX.IG-26 5-Year Index	1,000	20.06.2021	400	2	0,00
CDX.IG-27 5-Year Index	1,000	20.12.2021	300	1	0,00
CDX.IG-28 5-Year Index	1,000	20.06.2022	3.900	(7)	0,00
CDX.IG-30 5-Year Index	1,000	20.06.2023	6.200	(12)	0,00
				\$ 110	0,05

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500 %	21.06.2024	\$ 200	\$ 6	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	14.300	46	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2025	25.400	66	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	14.700	(43)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,300	03.12.2025	6.400	269	0,11
Zahlung <sup>(3)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,500	15.12.2023	51.700	(343)	(0,14)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027	500	26	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,750	15.12.2026	27.400	201	0,08
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	16.12.2045	9.400	571	0,23
Zahlung <sup>(3)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,900	05.03.2021	82.000	(104)	(0,04)
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,930	05.03.2022	82.000	40	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,985	05.06.2029	3.900	10	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month USD-LIBOR	3,000	25.11.2020	13.200	79	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month USD-LIBOR	3,005	23.04.2049	100	0	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month USD-LIBOR	3,007	30.05.2049	2.900	(11)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month USD-LIBOR	3,080	14.12.2048	1.300	(26)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.12.2048	€ 1.700	(46)	(0,02)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,514	04.01.2028	12.100	56	0,02
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	04.01.2028	7.600	147	0,06
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,036	03.02.2037	7.600	41	0,02
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,050	04.01.2038	32.100	105	0,04
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,099	04.01.2033	31.800	(133)	(0,05)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,150	04.01.2033	18.300	(140)	(0,06)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	19.09.2019	£ 73.200	(70)	(0,03)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	18.09.2020	73.400	136	0,05
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	3.300	(55)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	1.000	8	0,00
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	2,000	18.03.2022	4.500	(147)	(0,06)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	2,040	01.02.2037	1.900	(50)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	2,043	01.02.2037	5.400	(141)	(0,06)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.06.2022	¥ 050.000	29	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.06.2025	600.000	(47)	(0,02)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,500	20.09.2046	300.000	91	0,04
Zahlung	CPTFEMU	0,740	15.01.2020	€ 3.300	48	0,02
Zahlung	CPTFEMU	1,710	15.03.2033	700	3	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	700	(10)	0,00
					\$ 612	0,24

### Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

\$ 748 0,30

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

## OPTIONSKAUF

## DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Put - OTC EUR versus RUB	RUB 73,412	12.07.2018	€ 603	\$ 9	\$ 7	0,00
HUS	Put - OTC USD versus RUB	59,150	12.07.2018	\$ 608	7	0	0,00
					\$ 16	\$ 7	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	1,750 %	12.10.2018	£ 5.100	\$ 134	\$ 36	0,02
CBK	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,970	24.09.2018	\$ 7.100	361	176	0,07
DUB	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	1,670	08.10.2018	£ 3.600	95	35	0,01
FBF	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,850	30.11.2018	\$ 105.200	152	10	0,00
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,150	31.01.2019	56.500	59	19	0,01
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	1,700	11.10.2018	£ 5.500	148	49	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,040	22.06.2020	\$ 126.200	457	484	0,19
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,650	15.11.2018	43.700	248	1	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,785	21.09.2018	33.000	182	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,050	12.12.2018	3.050	147	83	0,03
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,370	27.03.2020	8.700	350	314	0,13
							\$ 2.333	\$ 1.207	0,48

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

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 69,000	05.07.2018	\$ 47.800	\$ 2	\$ 0	0,00

## VERKAUFSOPTIONEN

## DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC USD versus MXN	MXN 20,000	25.07.2018	\$ 3.768	\$ (64)	\$ (48)	(0,02)
CBK	Call - OTC EUR versus TRY	TRY 5,900	14.11.2018	€ 3.100	(99)	(103)	(0,04)
	Call - OTC USD versus TRY	4,900	14.11.2018	\$ 3.600	(99)	(129)	(0,05)
GLM	Call - OTC EUR versus RUB	RUB 82,554	12.07.2018	€ 517	(9)	0	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 20,250	02.08.2018	\$ 3.768	(51)	(40)	(0,02)
HUS	Call - OTC USD versus RUB	RUB 66,450	12.07.2018	521	(8)	0	0,00
MSB	Put - OTC USD versus MXN	MXN 18,200	25.07.2018	3.768	(41)	(3)	0,00
					\$ (371)	\$ (323)	(0,13)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,600 %	24.09.2018	\$ 35.200	\$ (366)	\$ (575)	(0,23)
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,210	31.01.2019	11.300	(60)	(17)	(0,01)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,019	21.06.2021	126.200	(593)	(638)	(0,25)
	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	27.03.2020	63.000	(349)	(346)	(0,14)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,700	12.12.2018	15.100	(160)	(229)	(0,09)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,000	15.11.2018	9.400	(248)	(2)	0,00
							\$ (1.776)	\$ (1.807)	(0,72)

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
BOA	CDX.HY-23 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2019	\$ 700	\$ 94	\$ (42)	\$ 52	0,02

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (Forts.)

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettover- mögens
GLM	Zahlung	CPTFEMU	0,993 %	30.03.2020	€ 11.200	\$ (2)	\$ 69	\$ 67	0,03

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettover- mögens
DUB	Erhalt	ERAGDEVT Index	40.453	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 86.485	08.11.2018	\$ 0	\$(1.932)	\$(1.932)	(0,77)
	Erhalt	ERAGDEVT Index	40.453	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	86.485	08.05.2019	0	(1.934)	(1.934)	(0,77)
SOG	Erhalt	ERAGDEVT Index	4.117	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	8.802	11.10.2018	0	(195)	(195)	(0,08)
	Erhalt	ERAGDEVT Index	34.333	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	73.401	13.02.2019	0	(1.640)	(1.640)	(0,65)
							\$ 0	\$(5.701)	\$(5.701)	(2,27)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
AZD	09/2018	\$ 1.613	SGD 2.159	\$ 0	\$ (27)	\$(27)	(0,01)
BOA	07/2018	1.428	AUD 1.934	1	0	1	0,00
	07/2018	6.193	€ 5.283	0	(25)	(25)	(0,01)
	07/2018	1.038	RUB 64.714	0	(7)	(7)	0,00
	08/2018	AUD 1.934	\$ 1.428	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	SEK 3.700	420	6	0	6	0,00
	08/2018	\$ 2.409	ZAR 33.075	0	(6)	(6)	0,00
	08/2018	ZAR 12.792	\$ 963	34	0	34	0,01
	09/2018	SGD 9.456	7.121	174	0	174	0,07
BPS	07/2018	ARS 26.853	978	47	0	47	0,02
	07/2018	€ 12.345	14.318	0	(95)	(95)	(0,04)
	07/2018	TRY 644	140	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 970	ARS 26.853	0	(48)	(48)	(0,02)
	07/2018	570	CAD 756	5	0	5	0,00
	12/2018	¥ 660.000	\$ 6.015	0	(19)	(19)	(0,01)
BRC	07/2018	\$ 385	£ 294	3	0	3	0,00
	09/2018	ARS 5.600	\$ 202	22	0	22	0,01
CBK	07/2018	CAD 1.443	1.099	2	0	2	0,00
	07/2018	£ 4.728	6.264	22	0	22	0,01
	07/2018	TRY 10.259	2.146	0	(76)	(76)	(0,03)
	07/2018	\$ 218	€ 184	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	424	£ 316	0	(7)	(7)	0,00
	07/2018	3.977	RUB 251.531	31	0	31	0,01
	08/2018	MXN 30.353	\$ 1.482	0	(49)	(49)	(0,02)
	12/2018	¥ 1.130.000	10.308	0	(23)	(23)	(0,01)
	12/2018	\$ 16.220	¥ 1.790.000	145	0	145	0,06
DUB	07/2018	963	ARS 26.853	0	(32)	(32)	(0,01)
FBF	07/2018	AUD 1.775	\$ 1.326	15	0	15	0,01
GLM	07/2018	¥ 20.000	183	2	0	2	0,00
	07/2018	NOK 12.145	1.492	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 1.499	CAD 1.995	18	0	18	0,01
	07/2018	645	€ 557	5	0	5	0,00
	07/2018	828	£ 621	0	(8)	(8)	0,00
	07/2018	1.994	RUB 124.515	0	(11)	(11)	0,00
	08/2018	RUB 38.816	\$ 614	0	(2)	(2)	0,00
	09/2018	\$ 4.278	CNH 27.347	0	(163)	(163)	(0,07)
HUS	07/2018	RUB 267.703	\$ 4.251	3	(19)	(16)	(0,01)
	08/2018	94.663	1.503	4	(3)	1	0,00
	08/2018	\$ 3.972	RUB 251.531	18	0	18	0,01
	09/2018	CNY 5.058	\$ 781	20	0	20	0,01
	01/2021	BRL 1.150	177	0	(89)	(89)	(0,04)
IND	07/2018	TRY 3.275	715	5	0	5	0,00
	08/2018	ZAR 902	71	6	0	6	0,00
JPM	07/2018	AUD 159	120	2	0	2	0,00
	07/2018	CAD 2.677	2.051	23	(7)	16	0,01
	07/2018	TRY 7.231	1.568	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 1.460	NOK 12.100	25	0	25	0,01
	08/2018	2	MXN 41	0	0	0	0,00
	08/2018	1.508	ZAR 20.825	5	0	5	0,00
	09/2018	2.049	KRW 2.210.871	0	(58)	(58)	(0,02)
	03/2019	€ 2.781	\$ 3.319	8	0	8	0,00
MSB	07/2018	BRL 900	239	5	0	5	0,00
	07/2018	\$ 245	BRL 900	0	(11)	(11)	0,00
	07/2018	163	€ 141	2	0	2	0,00
	08/2018	238	BRL 900	0	(5)	(5)	0,00
SCX	08/2018	1.866	SEK 16.200	0	(49)	(49)	(0,02)
	08/2018	4.671	TRY 20.863	0	(200)	(200)	(0,08)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
	09/2018	KRW 9.882.340	\$ 9.194	\$ 296	\$ 0	\$ 296	0,12
	09/2018	\$ 1.070	KRW 1.195.308	6	0	6	0,00
SOG	08/2018	ZAR 6.365	\$ 501	39	0	39	0,02
	09/2018	CNY 1.376	214	7	0	7	0,00
SSB	07/2018	CAD 183	141	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 7.642	€ 6.565	23	0	23	0,01
	08/2018	€ 6.565	\$ 7.659	0	(22)	(22)	(0,01)
	09/2018	\$ 873	SGD 1.183	1	(5)	(4)	0,00
TOR	07/2018	TRY 1.192	\$ 260	2	0	2	0,00
UAG	07/2018	\$ 366	CHF 365	2	0	2	0,00
	07/2018	5.013	£ 3.791	0	(8)	(8)	0,00
	08/2018	£ 3.791	\$ 5.020	8	0	8	0,00
	09/2018	CNY 5.114	791	22	0	22	0,01
				\$ 1.070	\$ (1.079)	\$ (9)	0,00

#### ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen für die Class Institutional EUR (Hedged) und die Class E EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BOA	07/2018	\$ 6.935	AUD 9.395	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
	07/2018	51.941	€ 44.249	0	(279)	(279)	(0,11)
	07/2018	410	¥ 45.202	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	AUD 9.395	\$ 6.936	0	(6)	(6)	0,00
	09/2018	SGD 2.317	1.745	43	0	43	0,02
BPS	07/2018	¥ 2.822.248	25.985	506	0	506	0,20
	07/2018	\$ 143	CHF 142	0	0	0	0,00
	07/2018	89.097	€ 76.817	591	0	591	0,24
BRC	07/2018	€ 690	\$ 798	0	(7)	(7)	0,00
CBK	07/2018	CAD 11.930	9.164	95	0	95	0,04
	07/2018	DKK 14.463	2.410	143	0	143	0,06
	07/2018	€ 100	116	0	0	0	0,00
	07/2018	£ 12.636	16.741	58	0	58	0,02
	07/2018	\$ 742	CAD 986	7	0	7	0,00
	07/2018	154	€ 133	2	0	2	0,00
	07/2018	300	£ 225	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	3.044	¥ 334.633	0	(23)	(23)	(0,01)
GLM	07/2018	AUD 9.395	\$ 7.062	121	0	121	0,05
	07/2018	CHF 7.871	7.954	27	0	27	0,01
	07/2018	€ 1.348	1.574	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 7	€ 6	0	0	0	0,00
	07/2018	187	£ 140	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	275	SEK 2.473	1	0	1	0,00
HUS	07/2018	€ 72.399	\$ 83.621	0	(909)	(909)	(0,36)
	07/2018	\$ 8.806	CAD 11.716	101	0	101	0,04
	08/2018	CAD 11.716	\$ 8.811	0	(100)	(100)	(0,04)
	08/2018	\$ 83.806	€ 72.399	908	0	908	0,36
JPM	07/2018	NOK 9.445	\$ 1.139	0	(20)	(20)	(0,01)
	07/2018	\$ 7.800	CHF 7.729	0	(16)	(16)	(0,01)
	08/2018	CHF 7.729	\$ 7.820	17	0	17	0,01
RBC	07/2018	\$ 584	AUD 795	3	0	3	0,00
RYL	07/2018	€ 1.983	\$ 2.332	17	0	17	0,01
SCX	07/2018	3.503	4.082	0	(8)	(8)	0,00
	07/2018	\$ 2.267	DKK 14.463	0	0	0	0,00
	07/2018	915	€ 778	0	(7)	(7)	0,00
	07/2018	157	¥ 17.205	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	1.158	NOK 9.445	1	0	1	0,00
	07/2018	363	NZD 515	0	(14)	(14)	(0,01)
	07/2018	3.262	SEK 29.044	0	(15)	(15)	(0,01)
	08/2018	NOK 9.445	\$ 1.160	0	0	0	0,00
	08/2018	SEK 29.044	3.269	15	0	15	0,01
	10/2018	DKK 14.463	2.283	1	0	1	0,00
SOG	07/2018	SEK 29.044	3.260	13	0	13	0,01
	08/2018	ILS 1.531	424	5	0	5	0,00
SSB	07/2018	€ 72.017	83.835	0	(249)	(249)	(0,10)
	07/2018	\$ 164	CAD 214	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	657	CHF 655	3	0	3	0,00
	07/2018	89.570	€ 76.973	300	0	300	0,12
	07/2018	1.365	£ 1.043	12	0	12	0,00
	08/2018	84.021	€ 72.017	245	0	245	0,10
	09/2018	355	HKD 2.783	0	0	0	0,00
	09/2018	141	SGD 192	0	0	0	0,00
TOR	07/2018	23.940	¥ 2.631.015	0	(187)	(187)	(0,08)
	08/2018	¥ 2.425.208	\$ 22.119	180	0	180	0,07
UAG	07/2018	€ 16.151	£ 18.716	0	(141)	(141)	(0,06)
	07/2018	\$ 16.226	£ 12.271	0	(25)	(25)	(0,01)
	08/2018	£ 12.271	\$ 16.249	25	0	25	0,01
	09/2018	HKD 33.193	4.239	2	0	2	0,00
				\$ 3.448	\$ (2.017)	\$ 1.431	0,57

# Aufstellung der Wertpapiieranlagen des PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (Forts.)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate		\$ (5.076)	(2,02)
	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Barclays Bank PLC			
1,940 % fällig am 04.09.2018	\$ 2.700	\$ 2.699	1,08
Summe Anlagen		\$ 318.387	126,90
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (67.485)	(26,90)
Nettovermögen		\$ 250.902	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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.
- (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) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 4.809 als Sicherheiten verpfändet.
- (i) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 35.830 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 6.488 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 8.380 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 2.311	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.01.2022	\$ (2.358)	\$ 2.311	\$ 2.311	0,92
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (2.358)</b>	<b>\$ 2.311</b>	<b>\$ 2.311</b>	<b>0,92</b>

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 25.503	\$ 295.007	\$ 0	\$ 320.510
Einlagen bei Kreditinstituten	0	2.699	0	2.699
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(494)	(4.328)	0	(4.822)
<b>Summen</b>	<b>\$ 25.009</b>	<b>\$ 293.378</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 318.387</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 59.219	\$ 492.493	\$ 0	\$ 551.712
Einlagen bei Kreditinstituten	0	3.501	0	3.501
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	243	7.848	0	8.091
<b>Summen</b>	<b>\$ 59.462</b>	<b>\$ 503.842</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 563.304</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 der Wertpapiieranlagen.

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
GRE	2,170 %	18.06.2018	18.07.2018	\$ (4.835)	\$ (4.839)	(1,93)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (4.839)</b>	<b>(1,93)</b>

## Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkaufgeschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BCY	2,300 %	25.06.2018	02.07.2018	\$ (1.669)	\$ (1.670)	(0,66)
		29.06.2018	06.07.2018	(1.179)	(1.179)	(0,47)
BPG	2,210	26.06.2018	26.07.2018	(1.571)	(1.571)	(0,63)
		28.06.2018	05.07.2018	(23.309)	(23.314)	(9,29)
MSC	2,280	21.06.2018	05.07.2018	(1.175)	(1.176)	(0,47)
		25.06.2018	02.07.2018	(2.256)	(2.257)	(0,90)
TDM	1,900	11.04.2018	11.07.2018	(368)	(370)	(0,15)
	2,170	14.06.2018	13.07.2018	(4.402)	(4.406)	(1,76)
<b>Summe Rückkaufgeschäfte</b>					<b>\$ (35.943)</b>	<b>(14,33)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 7 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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (27)	\$ 0	\$ (27)
BOA	(10)	550	540
BPS	938	(400)	538
BRC	54	(270)	(216)
CBK	(310)	0	(310)
DUB	(3.863)	(2.090)	(5.953)
FBF	25	0	25
GLM	26	0	26
HUS	(66)	0	(66)
IND	11	0	11
JPM	30	0	30
MSB	(12)	0	(12)
MYC	(333)	47	(286)
RBC	3	0	3
RYL	17	(10)	7
SCX	24	0	24
SOG	(1.771)	2.600	829
SSB	308	590	898
TOR	(5)	0	(5)
UAG	(115)	0	(115)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	86,31	89,42
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	40,12	39,42
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,31	1,91
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,20)	0,06
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,30	0,23
Freiverkehrsfinanzderivate	(2,02)	1,63
Einlagenzertifikate	1,08	0,83
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,93)	(27,83)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(14,33)	(5,24)

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des  
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund  
2018

30. Juni

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 28.02.2025	\$ 24.600	\$ 24.552	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.08.2022	\$ 36.800	\$ 35.689
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	¥ 1.680.000	15.817	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.07.2022	26.900	26.258
United Kingdom Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2018	£ 9.800	13.682	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 28.02.2025	24.600	24.560
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.06.2018	¥ 780.000	7.356	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.12.2021	22.000	21.483
	<b>AKTIEN</b>		U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.03.2022	17.000	16.473
Facebook, Inc. 'A'	40.270	7.169		<b>AKTIEN</b>	
	<b>PARI (000S)</b>		PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)	149.290	15.158
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	\$ 6.516	6.420		<b>PARI (000S)</b>	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	¥ 580.000	5.468	U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 15.11.2039	\$ 10.500	12.469
U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 15.02.2048	\$ 4.900	4.770	U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 30.09.2022	12.900	12.427
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b)	4.520	4.471		<b>AKTIEN</b>	
U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.08.2022	4.400	4.268	Facebook, Inc. 'A'	40.270	7.416
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.05.2018	¥ 440.000	4.029		<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)	\$ 3.799	3.796	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)	\$ 5.949	5.801
	<b>AKTIEN</b>		U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.07.2022	5.600	5.434
Alphabet, Inc. 'C'	3.270	3.599	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.08.2027	5.600	5.312
Pfizer, Inc.	94.122	3.366	U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 15.02.2048	4.900	4.699
Chevron Corp.	30.542	3.331	Fremont Home Loan Trust 3,141 % fällig am 25.11.2034	4.700	4.656
	<b>PARI (000S)</b>		HarborView Mortgage Loan Trust 2,325 % fällig am 19.12.2036	4.903	4.527
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2022 (b)	\$ 3.062	3.029	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.11.2022	4.600	4.475
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	3.063	3.001		<b>AKTIEN</b>	
United Kingdom Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.04.2018	£ 2.000	2.797	Chevron Corp.	30.542	3.774
	<b>AKTIEN</b>		Amgen, Inc.	20.053	3.593
Walt Disney Co.	25.983	2.730	Alphabet, Inc. 'C'	3.270	3.531
International Business Machines Corp.	17.035	2.623	Pfizer, Inc.	94.122	3.464
Union Pacific Corp.	17.551	2.432			
Cisco Systems, Inc.	51.621	2.236			
Texas Instruments, Inc.	20.132	2.087			
	<b>PARI (000S)</b>				
U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.07.2022	\$ 2.100	2.050			
	<b>AKTIEN</b>				
Oracle Corp.	37.597	1.858			
Amgen, Inc.	9.206	1.679			

(a) Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	MARKT- PARI (000S)	WERT (000S)	NETTOVER- MÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	MARKT- WERT (000S)	NETTOVER- MÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	MARKT- PARI (000S)	WERT (000S)	NETTOVER- MÖGENS	% DES	
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>					<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>					<b>USA</b>				
<b>ARGENTINIEN</b>					<b>ETFS plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (I)</b>					<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>					<b>Summe Irland</b>					<b>AmeriCredit Automobile Receivables Trust</b>				
Argentina Government International Bond					103.650 \$	10.517	8,27		1.510 % fällig am 18.05.2020	\$	135 \$	135	0,11	
2,500 % fällig am 31.12.2038	\$	600	342	0,27					Argent Mortgage Loan Trust					
5,875 % fällig am 11.01.2028		300	245	0,19		11.569	9,10		2,331 % fällig am 25.05.2035		535	510	0,40	
21,200 % fällig am 19.09.2018	ARS	20	1	0,00					Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust		600	598	0,47	
34,188 % fällig am 03.04.2022		297	9	0,01					3,291 % fällig am 25.06.2034					
40,000 % fällig am 21.06.2020		5.246	190	0,15					Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust		633	639	0,50	
Summe Argentinien			787	0,62					BNC Mortgage Loan Trust		349	350	0,28	
<b>AUSTRALIEN</b>					<b>ITALIEN</b>					<b>Countrywide Asset-Backed Certificates</b>				
<b>NON-AGENCY-MBS</b>					<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>					<b>2,991 % fällig am 25.05.2036</b>				
Puma SE					<b>Towers CQ SRL</b>					<b>EMC Mortgage Loan Trust</b>				
2,705 % fällig am 18.10.2045	AUD	297	219	0,17	0,627 % fällig am 28.12.2033	€	607	711	0,56	<b>2,831 % fällig am 25.05.2040</b>				
2,825 % fällig am 13.05.2045		282	209	0,17	<b>NON-AGENCY-MBS</b>					<b>Fremont Home Loan Trust</b>				
Summe Australien			428	0,34	<b>Claris Finance SRL</b>					<b>2,226 % fällig am 25.10.2036</b>				
<b>BRASILIEN</b>					<b>JAPAN</b>					<b>GSAMP Trust</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>2,321 % fällig am 25.01.2037</b>				
Banco do Brasil S.A.	€	300	351	0,28	<b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b>					<b>Home Equity Loan Trust</b>				
Petrobras Global Finance BV					3,495 % fällig am 19.10.2021	\$	400	406	0,32	<b>2,431 % fällig am 25.04.2037</b>				
5,299 % fällig am 27.01.2025	\$	212	196	0,15	<b>NIEDERLANDE</b>					<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>				
5,999 % fällig am 27.01.2028		116	105	0,08	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>2,401 % fällig am 25.12.2035</b>				
Summe Brasilien			652	0,51	<b>Cooperative Rabobank UA</b>					<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>				
<b>KANADA</b>					<b>PORTUGAL</b>					<b>5,988 % fällig am 25.11.2036 ^</b>				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>Option One Mortgage Loan Trust</b>				
Golden Credit Card Trust					<b>Banco Espirito Santo S.A.</b>					<b>2,871 % fällig am 25.02.2035</b>				
2,473 % fällig am 15.02.2021		500	501	0,39	2,625 % fällig am 08.05.2017 ^		600	207	0,16	<b>Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>SCHWEIZ</b>					<b>2,351 % fällig am 25.11.2036</b>				
Enbridge, Inc.					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>Residential Asset Securities Corp. Trust</b>				
3,041 % fällig am 15.06.2020		100	100	0,08	<b>Credit Suisse Group AG</b>					<b>2,331 % fällig am 25.09.2036</b>				
Fairfax Financial Holdings Ltd.					3,574 % fällig am 09.01.2023	\$	700	686	0,54	<b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b>				
2,750 % fällig am 29.03.2028	€	100	117	0,09	<b>UBS AG</b>					<b>3,066 % fällig am 25.03.2035</b>				
Summe Kanada			718	0,56	3,150 % fällig am 01.06.2020		400	404	0,32	<b>3,141 % fällig am 25.03.2035</b>				
<b>CAYMAN INSELN</b>					<b>GROSSBRITANNIEN</b>					<b>Soundview Home Loan Trust</b>				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>2,271 % fällig am 25.05.2036</b>				
Eagle Ltd.					<b>Banco Espirito Santo S.A.</b>					<b>2,931 % fällig am 25.08.2035 ^</b>				
2,570 % fällig am 15.12.2039	\$	84	84	0,07	2,650 % fällig am 01.02.2022		800	771	0,60	<b>VOLT LLC</b>				
<b>FRANKREICH</b>					<b>SCHWEIZ</b>					<b>3,250 % fällig am 25.06.2047</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>Summe Schweiz</b>				
Societe Generale S.A.					<b>Credit Suisse Group AG</b>					<b>1.861</b>				
8,250 % fällig am 29.11.2018 (e)(g)		400	405	0,32	3,574 % fällig am 09.01.2023	\$	700	686	0,54	<b>4.311</b>				
<b>DEUTSCHLAND</b>					<b>GROSSBRITANNIEN</b>					<b>Summe Großbritannien</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>8.137</b>				
Deutsche Bank AG					<b>Barclays PLC</b>					<b>6.40</b>				
3,549 % fällig am 27.02.2023		500	483	0,38	3,710 % fällig am 16.05.2024		300	298	0,23	<b>2.900 % fällig am 06.11.2022</b>				
4,263 % fällig am 10.05.2019		400	402	0,32	4,463 % fällig am 10.08.2021		500	519	0,41	<b>AT&amp;T, Inc.</b>				
Summe Deutschland			885	0,70	7,250 % fällig am 15.03.2023 (e)(g)	€	200	272	0,21	<b>2,975 % fällig am 01.06.2021</b>				
<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>					<b>GROSSBRITANNIEN</b>					<b>3,298 % fällig am 15.07.2021</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>AXA Equitable Holdings, Inc.</b>				
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.					<b>HSBC Holdings PLC</b>					<b>4,350 % fällig am 20.04.2028</b>				
4,645 % fällig am 16.04.2021		400	418	0,33	2,926 % fällig am 18.05.2021	\$	200	200	0,16	<b>Bank of America Corp.</b>				
<b>INDIEN</b>					<b>GROSSBRITANNIEN</b>					<b>2,650 % fällig am 01.04.2019</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>BAT Capital Corp.</b>				
Bharti Airtel International Netherlands BV	€	100	123	0,10	4,561 % fällig am 08.03.2021		400	419	0,33	<b>2,764 % fällig am 15.08.2022</b>				
3,375 % fällig am 20.05.2021					4,750 % fällig am 04.07.2029 (e)(g)	€	300	346	0,27	<b>3,223 % fällig am 15.08.2022</b>				
<b>IRLAND</b>					<b>GROSSBRITANNIEN</b>					<b>Citigroup, Inc.</b>				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>2,700 % fällig am 30.03.2021</b>				
Cork Street CLO Designated Activity Co.					<b>Lloyds Banking Group PLC</b>					<b>3,249 % fällig am 07.06.2019</b>				
0,760 % fällig am 27.11.2028		900	1.052	0,83	3,000 % fällig am 11.01.2022		600	585	0,46	<b>Dell International LLC</b>				
<b>USA</b>					<b>NON-AGENCY-MBS</b>					<b>Energy Transfer Partners LP</b>				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>5,000 % fällig am 01.10.2022</b>				
<b>AMERIKANISCHE ANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>FirstEnergy Corp.</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>4,250 % fällig am 15.03.2023</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>2,943 % fällig am 08.01.2019</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>3,156 % fällig am 12.03.2019</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>3,472 % fällig am 26.04.2022</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>2,550 % fällig am 01.03.2021</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>2,945 % fällig am 18.06.2022</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>3,780 % fällig am 01.03.2021</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>Kimco Realty Corp.</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>2,700 % fällig am 01.03.2024</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>600</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>558</b>				
<b>EUROANLEIHER</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>0,44</b>				



Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	20	\$ (121)	(0,10)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09/2018	4	9	0,01
				\$ (13)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (13)	(0,01)

## 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	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500 %	21.06.2027	\$ 200	\$ 12	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.12.2026	14.000	1.583	1,24
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2025	5.100	10	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	3.500	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2036	500	39	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027	100	6	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	15.06.2046	1.400	222	0,17
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	4.000	(49)	(0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	16.12.2045	2.000	(26)	(0,02)
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,900	05.03.2021	33.200	(42)	(0,03)
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,930	05.03.2022	33.300	16	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	2,985	05.06.2029	2.500	6	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.12.2048	€ 700	(19)	(0,02)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,514	04.01.2028	4.500	21	0,02
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	04.01.2028	2.700	52	0,04
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,036	03.02.2037	2.000	(17)	(0,01)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,050	04.01.2038	12.000	39	0,03
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,099	04.01.2033	11.400	(47)	(0,04)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	2,150	04.01.2033	7.100	(54)	(0,04)
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	19.09.2019	£ 23.000	(22)	(0,02)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,000	18.09.2020	23.000	42	0,03
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	1.800	(18)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	1.700	(29)	(0,02)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	300	4	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	2,043	01.02.2037	1.700	27	0,02
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.06.2022	¥ 3.360.000	11	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.06.2025	1.340.000	(17)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.03.2026	460.000	(15)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	1,710	15.03.2033	€ 2.000	8	0,01
Erhalt	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	2.000	(27)	(0,02)
					\$ 1.717	1,35
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 1.717	1,35

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

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

## OPTIONSKAUF

## DEVIENOPTIEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Put - OTC EUR versus RUB	RUB 73,412	12.07.2018	€ 201	\$ 3	\$ 2	0,00
HUS	Put - OTC USD versus RUB	59,150	12.07.2018	\$ 202	2	0	0,00
					\$ 5	\$ 2	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variable Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfallsda- tum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
FBF	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,850 %	30.11.2018	\$ 30.900	\$ 44	\$ 3	0,00
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,150	31.01.2019	22.000	23	7	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,940	20.08.2018	500	49	11	0,01
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,040	22.06.2020	59.300	215	228	0,18
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,785	21.09.2018	8.000	44	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,370	27.03.2020	3.400	137	123	0,09
							\$ 512	\$ 372	0,29

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

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund (Forts.)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 69,000	05.07.2018	\$ 47.400	\$ 2	\$ 0	0,00

## VERKAUFSoPTIONEN

### DEVIsoENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC USD versus MXN	MXN 20,000	25.07.2018	\$ 1.247	\$ (21)	\$ (16)	(0,01)
CBK	Call - OTC EUR versus TRY	TRY 5,900	14.11.2018	€ 800	(26)	(27)	(0,02)
	Call - OTC USD versus TRY	4,900	14.11.2018	\$ 900	(25)	(32)	(0,03)
GLM	Call - OTC EUR versus RUB	RUB 82,554	12.07.2018	€ 172	(3)	0	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	MXN 20,250	02.08.2018	\$ 1.247	(17)	(13)	(0,01)
HUS	Call - OTC USD versus RUB	RUB 66,450	12.07.2018	173	(2)	0	0,00
MSB	Put - OTC USD versus MXN	MXN 18,200	25.07.2018	1.247	(13)	(1)	0,00
					\$ (107)	\$ (89)	(0,07)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,800 %	20.08.2018	\$ 2.200	\$ (49)	\$ (16)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,210	31.01.2019	4.400	(23)	(7)	(0,01)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,019	21.06.2021	59.300	(279)	(299)	(0,23)
	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	27.03.2020	24.900	(138)	(137)	(0,11)
							\$ (489)	\$ (459)	(0,36)

## 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
DUB	CMBX.NA.BBB-.7 Index	3,000 %	17.01.2047	\$ 600	\$ (108)	\$ 66	\$ (42)	(0,03)
FBF	CMBX.NA.BBB-.6 Index	3,000	11.05.2063	300	(28)	(3)	(31)	(0,03)
	CMBX.NA.BBB-.7 Index	3,000	17.01.2047	800	(101)	45	(56)	(0,04)
					\$ (237)	\$ 108	\$ (129)	(0,10)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	ERAUSLT Index	187.377	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 56.650	30.07.2018	\$ 0	\$ 222	\$ 222	0,18
CBK	Erhalt	ERAUSLT Index	137.822	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	42.841	07.11.2018	0	(975)	(975)	(0,77)
DUB	Erhalt	ERAUSLT Index	95.282	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	29.617	15.01.2019	0	(674)	(674)	(0,53)
							\$ 0	\$ (1.427)	\$ (1.427)	(1,12)

## DEVIsoENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	11/2018	€ 100	\$ 122	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
BOA	07/2018	\$ 1.098	AUD 1.487	1	0	1	0,00
	07/2018	1.230	€ 1.052	1	(3)	(2)	0,00
	07/2018	695	RUB 43.330	0	(5)	(5)	(0,01)
	08/2018	AUD 1.487	\$ 1.098	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	\$ 714	ZAR 9.800	0	(2)	(2)	0,00
	09/2018	SGD 3.204	\$ 2.413	59	0	59	0,04
BPS	07/2018	ARS 4.991	182	9	0	9	0,01
	07/2018	€ 4.957	5.750	0	(38)	(38)	(0,03)
	07/2018	\$ 180	ARS 4.991	0	(9)	(9)	(0,01)
CBK	07/2018	CAD 843	\$ 642	1	0	1	0,00
	07/2018	£ 4.616	6.115	21	0	21	0,02
	07/2018	\$ 1.539	RUB 97.304	12	0	12	0,01
	08/2018	NOK 5.205	\$ 641	1	0	1	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
	08/2018	\$ 1.545	TRY 6.839	\$ 0	\$ (80)	\$ (80)	(0,06)
	03/2019	€ 200	\$ 255	16	0	16	0,01
DUB	07/2018	\$ 179	ARS 4.991	0	(7)	(7)	(0,01)
FBF	07/2018	AUD 826	\$ 617	7	0	7	0,01
	10/2018	€ 100	125	7	0	7	0,01
GLM	07/2018	AUD 32	24	0	0	0	0,00
	07/2018	¥ 6.700	61	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 642	CAD 855	8	0	8	0,01
	07/2018	297	€ 255	0	0	0	0,00
	07/2018	684	RUB 42.742	0	(3)	(3)	0,00
	09/2018	1.519	CNH 9.713	0	(58)	(58)	(0,05)
HUS	07/2018	RUB 102.716	\$ 1.627	0	(10)	(10)	(0,01)
	08/2018	ARS 1.572	59	7	0	7	0,01
	08/2018	RUB 7.527	120	1	0	1	0,00
	08/2018	\$ 1.292	RUB 81.812	6	0	6	0,00
	09/2018	CNY 1.681	\$ 262	10	0	10	0,01
IND	07/2018	TRY 1.434	313	2	0	2	0,00
JPM	07/2018	AUD 629	474	9	0	9	0,01
	07/2018	CAD 824	636	9	0	9	0,01
	07/2018	€ 75	88	1	0	1	0,00
	07/2018	TRY 3.181	690	1	0	1	0,00
	08/2018	\$ 1	MXN 27	0	0	0	0,00
	08/2018	643	NOK 5.210	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	535	ZAR 7.307	2	(6)	(4)	0,00
	03/2019	€ 1.135	\$ 1.355	3	0	3	0,00
MSB	11/2018	200	244	8	0	8	0,01
SCX	08/2018	\$ 615	SEK 5.340	0	(16)	(16)	(0,01)
	09/2018	KRW 3.501.582	\$ 3.258	105	0	105	0,08
SSB	07/2018	\$ 4.457	€ 3.828	13	0	13	0,01
	08/2018	€ 3.828	\$ 4.466	0	(13)	(13)	(0,01)
UAG	07/2018	\$ 6.103	£ 4.616	0	(9)	(9)	(0,01)
	08/2018	£ 4.616	\$ 6.112	10	0	10	0,01
				\$ 335	\$ (263)	\$ 72	0,06
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (1.658)	(1,30)
Summe Anlagen						\$ 147.613	116,12
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (20.490)	(16,12)
Nettovermögen						\$ 127.123	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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(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) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.828 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 1.800 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 1.390 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(i) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettover- mögens
JPS	2,210 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 21.400	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.06.2021	\$ (21.840)	\$ 21.400	\$ 21.403	16,83
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	919	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	(940)	919	919	0,73
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (22.780)	\$ 22.319	\$ 22.322	17,56

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund (Forts.)

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 10.523	\$ 137.044	\$ 0	\$ 147.567
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(13)	59	0	46
<b>Summen</b>	<b>\$ 10.510</b>	<b>\$ 137.103</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 147.613</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 17.275	\$ 121.181	\$ 0	\$ 138.456
Einlagen bei Kreditinstituten	0	1.001	0	1.001
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(42)	727	0	685
<b>Summen</b>	<b>\$ 17.233</b>	<b>\$ 122.909</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 140.142</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 der Wertpapieranlagen.

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

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
GRE	1,930 %	18.04.2018	18.07.2018	\$ (2.846)	\$ (2.857)	(2,25)

### 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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 4	\$ 0	\$ 4
BOA	50	0	50
BPS	168	(40)	128
CBK	(1.063)	970	(93)
DUB	(723)	(1.030)	(1.753)
FBF	(70)	130	60
GLM	(68)	0	(68)
HUS	14	0	14
IND	2	0	2
JPM	16	0	16
MSB	7	0	7
MYC	(85)	0	(85)
SCX	89	(260)	(171)
UAG	1	0	1

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	58,75	50,48
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	39,77	36,36
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	17,56	6,06
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,35	0,74
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,30)	(0,25)
Einlagenzertifikate	0,00	0,67
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(2,25)	0,00
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0,00	(2,59)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 28.02.2025	\$ 9.900	\$ 9.881	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 28.02.2025	\$ 9.900	\$ 9.884
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	¥ 870.000	8.191	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.02.2018	¥ 400.000	3.613
UK Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2018	£ 4.100	5.724			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (a)	\$ 4.361	4.234	Facebook, Inc. 'A'	\$ 15.605	2.878
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.02.2018	¥ 390.000	3.434			
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 13.07.2018	\$ 2.900	2.896			
			U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (a)	\$ 1.980	1.932
			U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (a)	1.817	1.775
Facebook, Inc. 'A'		2.778			
			Chevron Corp.	12.283	1.518
			Alphabet, Inc. 'C'	1.315	1.420
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.06.2018	¥ 270.000	2.546	Pfizer, Inc.	37.853	1.393
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (a)	\$ 2.545	2.508			
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	¥ 230.000	2.168			
United States Treasury Note/Bond 3,000 % fällig am 15.02.2048	\$ 1.900	1.850	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.02.2018	¥ 145.700	1.316
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2022 (a)	1.829	1.810	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2022 (a)	\$ 1.204	1.191
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (a)	1.600	1.598			
			Walt Disney Co.	10.450	1.075
Alphabet, Inc. 'C'	10.450	1.098	JPMorgan Chase & Co.	1.000	1.051
Pfizer, Inc.	6.851	1.055	Ventas, Inc.	20.413	1.026
Union Pacific Corp.	7.059	978	Union Pacific Corp.	7.059	1.018
			International Business Machines Corp.	6.851	999
			Cisco Systems, Inc.	20.761	920
			Texas Instruments, Inc.	8.097	880
			Oracle Corp.	15.121	711
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (a)	\$ 919	900			
Cisco Systems, Inc.	20.761	899			
Texas Instruments, Inc.	8.097	839			
Federal Home Loan Bank Discount Notes 0,000 % fällig am 06.07.2018	\$ 800	799			
Oracle Corp.	15.121	747			

(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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental US Fund

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGLER MARKT</b>											
<b>STAMMAKTIVEN</b>											
<b>BERMUDAS</b>											
<b>FINANZWERTE</b>											
XL Group Ltd.	627	\$ 35	0,26	Sears Holdings Corp. (a)	1.107	\$ 3	0,02	Kinder Morgan, Inc.	1.142	\$ 20	0,14
<b>IRLAND</b>											
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>											
Accenture PLC 'A'	154	25	0,18	Signet Jewelers Ltd.	148	8	0,06	Marathon Oil Corp.	482	10	0,07
<b>USA</b>											
<b>LUXUSGÜTER</b>											
Abercrombie & Fitch Co. 'A'	1.874	46	0,33	Six Flags Entertainment Corp.	63	4	0,03	Marathon Petroleum Corp.	760	53	0,38
American Eagle Outfitters, Inc.	604	14	0,10	Tapestry, Inc.	279	13	0,09	Murphy Oil Corp.	414	14	0,10
Ascena Retail Group, Inc. (a)	935	4	0,03	Target Corp.	1.552	118	0,85	Nabors Industries Ltd.	1.247	8	0,06
Bed Bath & Beyond, Inc.	2.331	46	0,33	TEGNA, Inc.	310	3	0,02	National Oilwell Varco, Inc.	273	12	0,09
Best Buy Co., Inc.	498	37	0,27	Tiffany & Co.	30	4	0,03	Occidental Petroleum Corp.	585	49	0,35
Big Lots, Inc.	284	12	0,09	TJX Cos., Inc.	210	20	0,14	Oceaneering International, Inc.	276	7	0,05
Brinker International, Inc.	233	11	0,08	Tribune Media Co. 'A'	284	11	0,08	PBF Energy, Inc. 'A'	163	7	0,05
Caesars Entertainment Corp. (a)	607	7	0,05	Topperware Brands Corp.	159	7	0,05	Phillips 66	387	44	0,32
Carnival Corp.	402	23	0,17	Twenty-First Century Fox, Inc. 'A'	1.621	81	0,59	Rowan Cos. PLC 'A' (a)	336	5	0,04
Carter's, Inc.	36	4	0,03	Urban Outfitters, Inc. (a)	223	10	0,07	Valero Energy Corp.	864	96	0,70
CBS Corp. NVDR 'B'	657	37	0,27	VF Corp.	194	16	0,12	Whiting Petroleum Corp. (a)	83	4	0,03
Chico's FAS, Inc.	899	7	0,05	Viacom, Inc. 'B'	2.469	74	0,54	Williams Cos., Inc.	305	8	0,06
Comcast Corp. 'A'	2.193	72	0,52	Visteon Corp. (a)	123	16	0,12				
Dick's Sporting Goods, Inc.	245	9	0,06	Walt Disney Co.	678	71	0,51				
Dillard's, Inc. 'A'	321	30	0,22	Weight Watchers International, Inc. (a)	255	26	0,19				
Discovery, Inc. (a)	464	13	0,09	Wendy's Co.	664	11	0,08	<b>FINANZWERTE</b>			
Dollar General Corp.	154	15	0,11	Whirlpool Corp.	25	4	0,03	Afiac, Inc.	698	30	0,22
Foot Locker, Inc.	219	12	0,09	Williams-Sonoma, Inc.	70	4	0,03	Allstate Corp.	502	46	0,33
Ford Motor Co.	3.760	42	0,30	Wyndham Destinations, Inc.	297	13	0,09	Ally Financial, Inc.	2.764	73	0,53
Fossil Group, Inc. (a)	1.681	45	0,33	Wyndham Hotels & Resorts, Inc.	297	18	0,13	American Express Co.	1.000	98	0,71
GameStop Corp. 'A'	1.585	23	0,17	Wynn Resorts Ltd.	27	5	0,04	American Financial Group, Inc.	56	6	0,04
Gap, Inc.	1.356	44	0,32	Yum! Brands, Inc.	200	16	0,12	American International Group, Inc.	3.591	190	1,38
General Motors Co.	1.726	68	0,49								
Genuine Parts Co.	75	7	0,05								
GNC Holdings, Inc. 'A' (a)	2.609	9	0,07	<b>BASISKONSUMGÜTER</b>							
Goodyear Tire & Rubber Co.	375	9	0,07	Altria Group, Inc.	342	19	0,14	Ameriprise Financial, Inc.	221	31	0,22
Graham Holdings Co. 'B'	7	4	0,03	Archer-Daniels-Midland Co.	788	35	0,25	Assurant, Inc.	193	20	0,14
H&R Block, Inc.	301	7	0,05	Bunge Ltd.	132	9	0,07	Bank of America Corp.	6.798	192	1,39
Harley-Davidson, Inc.	133	6	0,04	Coca-Cola Co.	2.014	88	0,64	Bank of New York Mellon Corp.	890	48	0,35
Home Depot, Inc.	660	129	0,93	Colgate-Palmolive Co.	307	20	0,14	BB&T Corp.	473	24	0,17
International Game Technology PLC	141	3	0,02	Costco Wholesale Corp.	134	28	0,20	Berkshire Hathaway, Inc. 'B' (a)	528	99	0,72
Interpublic Group of Cos., Inc.	471	11	0,08	Dr Pepper Snapple Group, Inc.	148	18	0,13	BlackRock, Inc.	40	20	0,14
JC Penney Co., Inc. (a)	4.750	11	0,08	Estee Lauder Cos., Inc. 'A'	51	7	0,05	Brighthouse Financial, Inc. (a)	91	4	0,03
Kohl's Corp.	1.320	96	0,70	Flowers Foods, Inc.	211	4	0,03	Capital One Financial Corp.	1.006	92	0,67
L Brands, Inc.	391	14	0,10	General Mills, Inc.	510	23	0,17	CIT Group, Inc.	437	22	0,16
Las Vegas Sands Corp.	131	10	0,07	Herbalife Nutrition Ltd. (a)	530	29	0,21	Citigroup, Inc.	3.339	223	1,62
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM (a)	429	19	0,14	HRG Group, Inc. (a)	732	10	0,07	Citizens Financial Group, Inc.	537	21	0,15
Lowe's Cos., Inc.	813	78	0,56	JM Smucker Co.	78	8	0,06	CNO Financial Group, Inc.	505	10	0,07
Macy's, Inc.	2.015	75	0,54	Kimberly-Clark Corp.	46	5	0,04	Comerica, Inc.	47	4	0,03
Mattel, Inc.	771	13	0,09	Kroger Co.	3.538	101	0,73	Discover Financial Services	741	52	0,38
McDonald's Corp.	562	88	0,64	Mondelez International, Inc. 'A'	1.130	46	0,33	Fifth Third Bancorp	1.014	29	0,21
NIKE, Inc. 'B'	280	22	0,16	Nu Skin Enterprises, Inc. 'A'	131	10	0,07	Franklin Resources, Inc.	425	14	0,10
Nordstrom, Inc.	606	31	0,22	PepsiCo, Inc.	940	102	0,74	Genworth Financial, Inc. 'A' (a)	3.400	15	0,11
NVR, Inc. (a)	1	3	0,02	Philip Morris International, Inc.	966	78	0,57	Goldman Sachs Group, Inc.	230	51	0,37
O'Reilly Automotive, Inc. (a)	29	8	0,06	Procter & Gamble Co.	1.777	139	1,01	Hartford Financial Services Group, Inc.	640	33	0,24
Office Depot, Inc.	3.640	9	0,07	Rite Aid Corp. (a)	5.908	10	0,07	Invesco Ltd.	372	10	0,07
Omnicom Group, Inc.	175	13	0,09	Sysco Corp.	202	14	0,10	Jefferies Financial Group, Inc.	202	5	0,04
PulteGroup, Inc.	252	7	0,05	U.S. Foods Holding Corp. (a)	462	18	0,13	JPMorgan Chase & Co.	2.787	290	2,10
PVH Corp.	28	4	0,03	Wal-Mart Stores, Inc.	2.379	204	1,48	KeyCorp	272	5	0,04
Qurate Retail, Inc. (a)	1.222	26	0,19	Walgreens Boots Alliance, Inc.	106	6	0,04	Legg Mason, Inc.	467	16	0,12
Ralph Lauren Corp.	173	22	0,16					Lincoln National Corp.	241	15	0,11
Royal Caribbean Cruises Ltd.	52	5	0,04					Loews Corp.	420	20	0,14
Sally Beauty Holdings, Inc. (a)	769	12	0,09					LPL Financial Holdings, Inc.	175	11	0,08
								MetLife, Inc.	773	34	0,25
				<b>ENERGIE</b>				Morgan Stanley	84	4	0,03
				Andeavor	141	19	0,14	Navient Corp.	2.465	32	0,23
				Apache Corp.	108	5	0,04	New York Community Bancorp, Inc.	531	6	0,04
				Chesapeake Energy Corp. (a)	3.906	21	0,15	OneMain Holdings, Inc. (a)	218	7	0,05
				Chevron Corp.	1.323	167	1,21	PHH Corp. (a)	370	4	0,03
				ConocoPhillips	1.124	78	0,56	PNC Financial Services Group, Inc.	350	47	0,34
				CONSOL Energy, Inc. (a)	52	2	0,01	Progressive Corp.	157	9	0,07
				CVR Energy, Inc.	289	11	0,08	Prudential Financial, Inc.	273	26	0,19
				Diamond Offshore Drilling, Inc. (a)	712	15	0,11	Regions Financial Corp.	1.102	20	0,14
				Exxon Mobil Corp.	3.262	270	1,96	Reinsurance Group of America, Inc.	78	10	0,07
				Helmerich & Payne, Inc.	63	4	0,03	Santander Consumer USA Holdings, Inc.	1.134	22	0,16
				Hess Corp.	433	29	0,21				
				HollyFrontier Corp.	719	49	0,35				

BESCHREIBUNG	MARKT- WERT NETTOVER-		BESCHREIBUNG	MARKT- WERT NETTOVER-		BESCHREIBUNG	MARKT- WERT NETTOVER-					
	AKTIEN	(000S) MÖGENS		AKTIEN	(000S) MÖGENS		AKTIEN	(000S) MÖGENS				
SLM Corp. (a)	862	\$ 10	0,07	Eaton Corp. PLC	54	\$	0,03	Juniper Networks, Inc.	653	\$	18	0,13
State Street Corp.	389	36	0,26	Emerson Electric Co.	786	54	0,39	KLA-Tencor Corp.	132	14	0,10	
SunTrust Banks, Inc.	354	23	0,17	Expeditors International of Washington, Inc.	59	4	0,03	Maxim Integrated Products, Inc.	73	4	0,03	
Synchrony Financial	963	32	0,23	FedEx Corp.	115	26	0,19	Micron Technology, Inc. (a)	133	7	0,05	
T Rowe Price Group, Inc.	149	17	0,12	Flowerserve Corp.	97	4	0,03	Microsoft Corp.	2.507	247	1,79	
Travelers Cos., Inc.	766	94	0,68	Fluor Corp.	365	18	0,13	Motorola Solutions, Inc.	347	40	0,29	
U.S. Bancorp	1.064	53	0,38	General Dynamics Corp.	194	36	0,26	NetApp, Inc.	621	49	0,36	
Unum Group	101	4	0,03	General Electric Co.	12.924	176	1,27	Oracle Corp.	2.328	103	0,75	
Voya Financial, Inc.	1.165	55	0,40	Hertz Global Holdings, Inc. (a)	1.561	24	0,17	Perspecta, Inc.	21	0	0,00	
Wells Fargo & Co.	3.512	195	1,41	Honeywell International, Inc.	228	33	0,24	Qorvo, Inc. (a)	104	8	0,06	
White Mountains Insurance Group Ltd.	6	5	0,04	Illinois Tool Works, Inc.	195	27	0,20	QUALCOMM, Inc.	1.592	89	0,64	
		<u>2.564</u>	<u>18,57</u>	JetBlue Airways Corp. (a)	199	4	0,03	Seagate Technology PLC	1.549	88	0,64	
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>				JetBlue Airways Corp. (a)	199	4	0,03	Symantec Corp.	875	18	0,13	
Abbott Laboratories	612	37	0,27	L3 Technologies, Inc.	98	19	0,14	Tech Data Corp. (a)	50	4	0,03	
AbbVie, Inc.	658	61	0,44	ManpowerGroup, Inc.	131	11	0,08	Teradata Corp. (a)	438	18	0,13	
Aetna, Inc.	302	55	0,40	Neilsen Holdings PLC	138	4	0,03	Texas Instruments, Inc.	335	37	0,27	
Allergan PLC	194	32	0,23	Norfolk Southern Corp.	179	27	0,20	Visa, Inc. 'A'	39	5	0,04	
Amgen, Inc.	420	77	0,56	Northrop Grumman Corp.	212	65	0,47	Western Digital Corp.	183	14	0,10	
Anthem, Inc.	511	122	0,88	Owens Corning	53	3	0,02	Western Union Co.	1.171	24	0,17	
Bio-Rad Laboratories, Inc. 'A' (a)	15	4	0,03	Parker-Hannifin Corp.	61	10	0,07	Xerox Corp.	845	20	0,14	
Bristol-Myers Squibb Co.	418	23	0,17	Pitney Bowes, Inc.	1.271	11	0,08			<u>2.306</u>	<u>16,70</u>	
Brookdale Senior Living, Inc. (a)	1.637	15	0,11	Quanta Services, Inc. (a)	186	6	0,04	Alcoa Corp. (a)	608	28	0,20	
Cardinal Health, Inc.	255	12	0,09	Raytheon Co.	225	43	0,31	Ashland Global Holdings, Inc.	123	10	0,07	
Cigna Corp.	94	16	0,11	Republic Services, Inc.	81	6	0,04	Avery Dennison Corp.	51	5	0,04	
Community Health Systems, Inc. (a)	2.288	8	0,06	Robert Half International, Inc.	121	8	0,06	Bemis Co., Inc.	147	6	0,04	
CVS Health Corp.	1.290	83	0,60	Ryder System, Inc.	145	10	0,07	CF Industries Holdings, Inc.	339	15	0,11	
DaVita, Inc. (a)	98	7	0,05	Southwest Airlines Co.	71	4	0,03	Domtar Corp.	485	23	0,17	
Eli Lilly & Co.	412	35	0,25	Stanley Black & Decker, Inc.	28	4	0,03	DowDuPont, Inc.	544	36	0,26	
Encompass Health Corp.	66	4	0,03	TransDigm Group, Inc.	46	16	0,12	Eastman Chemical Co.	40	4	0,03	
Envision Healthcare Corp. (a)	100	4	0,03	Trinity Industries, Inc.	336	12	0,09	Graphic Packaging Holding Co.	287	4	0,03	
Express Scripts Holding Co. (a)	1.213	94	0,68	Union Pacific Corp.	567	80	0,58	Huntsman Corp.	128	4	0,03	
Gilead Sciences, Inc.	1.399	99	0,72	United Continental Holdings, Inc. (a)	228	16	0,12	International Paper Co.	396	21	0,15	
HCA Healthcare, Inc.	962	99	0,72	United Parcel Service, Inc. 'B'	39	4	0,03	LyondellBasell Industries NV 'A'	811	89	0,64	
Humana, Inc.	101	30	0,22	United Rentals, Inc. (a)	39	6	0,04	Mosaic Co.	1.504	42	0,30	
Johnson & Johnson	1.309	159	1,15	United Technologies Corp.	770	96	0,69	Newmont Mining Corp.	108	4	0,03	
Kindred Healthcare, Inc. (a)	999	9	0,06	Waste Management, Inc.	125	10	0,07	PPG Industries, Inc.	141	15	0,11	
LifePoint Health, Inc. (a)	391	19	0,14	WW Grainger, Inc.	90	28	0,20	Praxair, Inc.	100	16	0,12	
Mallinckrodt PLC (a)	844	16	0,12			<u>1.240</u>	<u>8,98</u>	Reliance Steel & Aluminum Co.	89	8	0,06	
McKesson Corp.	89	12	0,09	<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>					<u>330</u>	<u>2,39</u>		
MEDNAX, Inc. (a)	78	3	0,02	Activision Blizzard, Inc.	313	24	0,17	<b>IMMOBILIEN</b>				
Merck & Co., Inc.	2.516	153	1,11	Alphabet, Inc. 'C' (a)	31	35	0,25	Jones Lang LaSalle, Inc.	26	4	0,03	
Mylan NV (a)	106	4	0,03	Amdocs Ltd.	92	6	0,04	AT&T, Inc.	5.452	175	1,27	
Patterson Cos., Inc.	213	5	0,04	Apple, Inc.	2.846	527	3,82	CenturyLink, Inc.	3.605	67	0,49	
Pfizer, Inc.	8.852	321	2,32	Applied Materials, Inc.	138	6	0,04	Frontier Communications Corp.	2.387	13	0,09	
Quest Diagnostics, Inc.	178	20	0,14	Arrow Electronics, Inc. (a)	167	13	0,09	Sprint Corp. (a)	445	3	0,02	
Tenet Healthcare Corp. (a)	2.206	74	0,54	Avaya Holdings Corp. (a)	195	4	0,03	Telephone & Data Systems, Inc.	482	13	0,09	
United Therapeutics Corp. (a)	41	5	0,04	Avnet, Inc.	415	18	0,13	Verizon Communications, Inc.	3.928	198	1,43	
UnitedHealth Group, Inc.	454	111	0,80	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	456	20	0,15	Windstream Holdings, Inc.	454	2	0,02	
Universal Health Services, Inc. 'B'	114	13	0,09	CA, Inc.	648	23	0,17		<u>471</u>	<u>3,41</u>		
Valeant Pharmaceuticals International, Inc. (a)	3.253	76	0,55	Cisco Systems, Inc.	2.626	113	0,82	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				
Varian Medical Systems, Inc. (a)	37	4	0,03	Conduent, Inc. (a)	367	7	0,05	AES Corp.	3.646	49	0,35	
		<u>1.921</u>	<u>13,92</u>	Corning, Inc.	2.319	64	0,46	Ameren Corp.	433	26	0,19	
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				DXC Technology Co.	42	3	0,02	American Electric Power Co., Inc.	577	40	0,29	
3M Co.	234	46	0,33	eBay, Inc. (a)	253	9	0,07	CenterPoint Energy, Inc.	764	21	0,15	
AGCO Corp.	134	8	0,06	F5 Networks, Inc. (a)	25	4	0,03	CMS Energy Corp.	204	10	0,07	
American Airlines Group, Inc.	1.226	47	0,34	First Solar, Inc. (a)	159	8	0,06	Consolidated Edison, Inc.	487	38	0,28	
Avis Budget Group, Inc. (a)	980	32	0,23	Flex Ltd. (a)	214	3	0,02	DTE Energy Co.	64	7	0,05	
Caterpillar, Inc.	486	66	0,48	Hewlett Packard Enterprise Co.	3.576	52	0,38	Duke Energy Corp.	860	68	0,49	
CSX Corp.	473	30	0,22	HP, Inc.	1.878	43	0,31	Edison International	344	22	0,16	
Cummins, Inc.	89	12	0,09	Intel Corp.	4.448	221	1,60	Entergy Corp.	637	51	0,37	
Deere & Co.	494	69	0,50	InterActiveCorp (a)	115	18	0,13	Eversource Energy	138	8	0,06	
Delta Air Lines, Inc.	128	6	0,04	International Business Machines Corp.	1.814	253	1,83		210	12	0,09	
Dover Corp.	102	8	0,06	Intuit, Inc.	58	12	0,09					
Dun & Bradstreet Corp.	58	7	0,05	Jabil, Inc.	465	13	0,09					

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Fundamental US Fund (Forts.)

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
Exelon Corp.	1.776	\$ 76	0,55	<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>				VEREIT, Inc.	484	\$ 4	0,03
FirstEnergy Corp.	1.600	57	0,41	AGNC Investment Corp.	502	\$ 9	0,06	Welltower, Inc.	129	8	0,06
Hawaiian Electric Industries, Inc.	120	4	0,03	Annaly Capital Management, Inc.	1.480	15	0,11	Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds)		120	0,87
MDU Resources Group, Inc.	494	14	0,10	Brixmor Property Group, Inc.	274	5	0,03				
NextEra Energy, Inc.	93	15	0,11	CoreCivic, Inc.	617	15	0,11	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt		\$ 13.720	99,38
NRG Energy, Inc.	772	24	0,17	DDR Corp.	429	8	0,06	Summe Anlagen		\$ 13.720	99,38
PG&E Corp.	793	34	0,25	Equity Residential	68	4	0,03	Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 86	0,62
Pinnacle West Capital Corp.	167	13	0,09	HCP, Inc.	311	8	0,06	Nettovermögen		\$ 13.806	100,00
PPL Corp.	734	21	0,15	Hospitality Properties Trust	176	5	0,03				
Public Service Enterprise Group, Inc.	713	39	0,28	Host Hotels & Resorts, Inc.	195	4	0,03				
SCANA Corp.	457	18	0,13	Iron Mountain, Inc.	164	6	0,04				
Sempra Energy	73	8	0,06	Kimco Realty Corp.	278	5	0,04				
Southern Co.	479	22	0,16	Quality Care Properties, Inc. (a)	376	8	0,06				
Vectren Corp.	78	6	0,04	Senior Housing Properties Trust	239	4	0,03				
Vistra Energy Corp. (a)	787	19	0,14	Spirit MTA REIT (a)	48	0	0,00				
Xcel Energy, Inc.	348	16	0,12	Spirit Realty Capital, Inc.	487	4	0,03				
		738	5,34	Ventas, Inc.	136	8	0,06				
Summe USA		13.540	98,07								
Summe Stammaktien		13.600	98,51								

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

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

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 13.720	\$ 0	\$ 0	\$ 13.720

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 13.992	\$ 0	\$ 0	\$ 13.992

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	91,17	99,35
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	8,21	0,00

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>		
General Electric Co.	7.023	\$ 99
CVS Health Corp.	901	59
Exxon Mobil Corp.	706	57
Gilead Sciences, Inc.	642	47
Verizon Communications, Inc.	880	42
Target Corp.	538	39
Apple, Inc.	225	39
AT&T, Inc.	1.084	37
AbbVie, Inc.	321	35
Wal-Mart Stores, Inc.	380	34
American International Group, Inc.	575	32
L3 Technologies, Inc.	145	30
Home Depot, Inc.	156	28
Chevron Corp.	210	26
Kroger Co.	973	26
McDonald's Corp.	149	24
QUALCOMM, Inc.	385	23
Berkshire Hathaway, Inc. 'B'	114	23
Johnson & Johnson	175	23
Ford Motor Co.	2.013	23

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
Bank of America Corp.	4.669	\$ 142
JPMorgan Chase & Co.	1.142	127
Apple, Inc.	535	99
DowDuPont, Inc.	1.122	78
Citigroup, Inc.	1.041	73
Intel Corp.	1.056	56
Microsoft Corp.	418	41
Deere & Co.	254	40
Pfizer, Inc.	1.094	40
Caterpillar, Inc.	254	39
Anthem, Inc.	166	38
Goldman Sachs Group, Inc.	145	36
Calpine Corp.	2.301	35
CSX Corp.	555	33
HP, Inc.	1.420	32
Oracle Corp.	663	32
Seagate Technology PLC	512	29
Micron Technology, Inc.	511	26
Alcoa Corp.	549	26
Chevron Corp.	205	25

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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Socially Responsible Emerging Markets 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 UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGLTER MARKT</b>				<b>KAMERUN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>KOLUMBIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>ARGENTINIEN STAATSEMISSIONEN</b>				Republic of Cameroon International Bond 9,500 % fällig am 19.11.2025 \$ 500 \$ 529 0,10				Ecopetrol S.A. 5,375 % fällig am 26.06.2026 \$ 500 \$ 514 0,10 5,875 % fällig am 28.05.2045 3.100 2.952 0,54 7,375 % fällig am 18.09.2043 1.100 1.216 0,22			
Argentina Government International Bond				<b>CAYMAN INSELN FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
2,260 % fällig am 31.12.2038 € 5.300 \$ 3.666 0,67				Halcyon Loan Advisors Funding Ltd. 3,279 % fällig am 20.04.2027 250 250 0,04				Colombia Government International Bond			
2,500 % fällig am 31.12.2038 \$ 700 400 0,07				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,625 % fällig am 15.03.2023 650 618 0,11			
3,375 % fällig am 15.01.2023 € 2.100 2.234 0,41				Lima Metro Line Finance Ltd. 5,875 % fällig am 05.07.2034 700 716 0,13				3,875 % fällig am 25.04.2027 1.500 1.452 0,27			
5,250 % fällig am 15.01.2028 € 700 705 0,13				Odebrecht Drilling Norbe Ltd. 6,350 % fällig am 01.12.2021 1.703 1.610 0,30				5,000 % fällig am 15.06.2045 1.000 986 0,18			
5,625 % fällig am 26.01.2022 \$ 1.500 1.405 0,26				Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar oder 7,350 % PIK) 7,350 % fällig am 01.12.2026 (a) 1.702 846 0,16				6,125 % fällig am 18.01.2041 200 225 0,04			
5,875 % fällig am 11.01.2028 2.600 2.121 0,39				Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar oder 7,350 % PIK) 6,720 % fällig am 01.12.2022 625 567 0,10				7,375 % fällig am 18.09.2037 850 1.062 0,19			
6,250 % fällig am 22.04.2019 850 856 0,16				Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. 6,720 % fällig am 01.12.2022 625 567 0,10				8,125 % fällig am 21.05.2024 500 602 0,11			
6,875 % fällig am 22.04.2021 2.400 2.373 0,43				QNB Finance Ltd. 3,705 % fällig am 12.02.2020 2.300 2.311 0,42				10,375 % fällig am 28.01.2033 800 1.226 0,23			
6,875 % fällig am 26.01.2027 2.150 1.900 0,35				3,713 % fällig am 07.02.2020 1.500 1.511 0,28				Summe Kolumbien			
6,875 % fällig am 11.01.2048 3.350 2.524 0,46				SPARC EM SPC Panama Metro Line SP 0,000 % fällig am 05.12.2022 (b) 1.300 1.168 0,21				6,171 1,13			
7,125 % fällig am 06.07.2036 600 484 0,09				Summe Cayman Inseln				10,853 1,99			
7,125 % fällig am 28.06.2117 200 153 0,03											
7,500 % fällig am 22.04.2026 3.150 2.918 0,53				<b>CHILE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>COSTA RICA STAATSEMISSIONEN</b>			
7,625 % fällig am 22.04.2046 € 50 41 0,01				Corp. Nacional del Cobre de Chile				Costa Rica Government International Bond			
7,820 % fällig am 31.12.2033 € 6.468 7.557 1,38				3,000 % fällig am 17.07.2022 1.700 1.658 0,30				4,250 % fällig am 26.01.2023 200 190 0,03			
8,280 % fällig am 31.12.2033 \$ 3.225 3.031 0,55				4,250 % fällig am 17.07.2022 3.000 2.867 0,52				4,375 % fällig am 30.04.2025 700 650 0,12			
Provincia de Buenos Aires				4,500 % fällig am 16.09.2025 1.000 1.023 0,19				5,625 % fällig am 30.04.2043 3.600 3.056 0,56			
9,950 % fällig am 09.06.2021 350 362 0,07				4,875 % fällig am 04.11.2044 2.200 2.275 0,42				Summe Costa Rica			
10,875 % fällig am 26.01.2021 900 929 0,17				Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A. 4,875 % fällig am 30.10.2024 800 797 0,15				3,896 0,71			
Provincia de la Rioja				GNL Quintero S.A. 4,634 % fällig am 31.07.2029 900 884 0,16							
9,750 % fällig am 24.02.2025 400 374 0,07				Latam Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.08.2029 1.827 1.737 0,32				<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK STAATSEMISSIONEN</b>			
Provincia de Neuguen				4,500 % fällig am 15.08.2025 536 515 0,09				Dominican Republic International Bond			
7,500 % fällig am 27.04.2025 310 260 0,05				Summe Chile				5,000 % fällig am 27.01.2025 4.000 3.979 0,73			
Summe Argentinien				11,756 2,15				5,875 % fällig am 18.04.2024 400 411 0,08			
34,293 6,28								5,950 % fällig am 25.01.2027 3.600 3.568 0,65			
<b>ASERBAIDSCHAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>CHINA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,500 % fällig am 15.02.2048 1.000 951 0,17			
Southern Gas Corridor CJSC				CCCCI Treasure Ltd.				6,850 % fällig am 27.01.2045 500 497 0,09			
6,875 % fällig am 24.03.2026 8.300 8.968 1,64				3,500 % fällig am 21.04.2020 (d) 900 882 0,16				6,875 % fällig am 29.01.2026 600 637 0,12			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				China Construction Bank Corp. 3,875 % fällig am 13.05.2025 (f) 100 99 0,02				Summe Dominikanische Republik			
Republic of Azerbaijan International Bond				CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 3,500 % fällig am 19.07.2022 600 580 0,10				10,043 1,84			
4,750 % fällig am 18.03.2024 600 596 0,11				Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 3,538 % fällig am 08.11.2027 500 471 0,09				<b>ECUADOR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Summe Aserbaidschan				Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd. 3,125 % fällig am 27.07.2021 2.000 1.948 0,36				Petroamazonas EP			
9,564 1,75				4,200 % fällig am 27.07.2026 1.800 1.723 0,31				4,625 % fällig am 06.11.2020 500 456 0,08			
<b>Bahamas Government International Bond</b>				Rongshi International Finance Ltd. 2,875 % fällig am 04.05.2022 600 580 0,11				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
6,000 % fällig am 21.11.2028 2.750 2.764 0,51				2,625 % fällig am 04.05.2027 700 664 0,12				Ecuador Government International Bond			
<b>BRASILIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Sinopec Group Overseas Development Ltd. 3,250 % fällig am 13.09.2027 4.500 4.171 0,76				7,875 % fällig am 23.01.2028 3.600 3.029 0,56			
Banco do Brasil S.A.				3,900 % fällig am 17.05.2022 2.100 2.115 0,39				8,750 % fällig am 02.06.2023 1.000 941 0,17			
3,875 % fällig am 10.10.2022 3.693 3.458 0,63				Summe China				9,625 % fällig am 02.06.2027 400 373 0,07			
6,000 % fällig am 22.01.2020 670 695 0,13				18,889 3,46				9,650 % fällig am 13.12.2026 700 658 0,12			
Banco do Nordeste do Brasil S.A.								Summe Ecuador			
4,375 % fällig am 03.05.2019 230 230 0,04								5,001 0,92			
Braskem Netherlands Finance BV								5,457 1,00			
4,500 % fällig am 10.01.2028 1.450 1.336 0,25											
Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais											
5,333 % fällig am 15.02.2028 11.510 11.021 2,02											
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.											
0,000 % fällig am 30.07.2018 (b)(d) 1.233 19 0,00											
Samarco Mineracao S.A.											
5,750 % fällig am 24.10.2023 ^ 300 221 0,04											
Summe Brasilien											
16,980 3,11											
<b>STAATSEMISSIONEN</b>											
Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social											
6,500 % fällig am 10.06.2019 2.100 2.165 0,40											
Brazil Government International Bond											
4,250 % fällig am 07.01.2025 5.800 5.488 1,00											
5,000 % fällig am 27.01.2045 3.470 2.755 0,50											
5,625 % fällig am 07.01.2041 1.600 1.394 0,26											
5,625 % fällig am 21.02.2047 1.300 1.106 0,20											
Summe Brasilien											
29,888 5,47											



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Socially Responsible Emerging Markets 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
5,550 % fällig am 21.01.2045	\$ 2,540	\$ 2,664	0,49	Union Andina de Cementos S.A.A.	\$ 150	\$ 154	0,03	FirstRand Bank Ltd.	\$ 1,400	\$ 1,396	0,25
5,750 % fällig am 12.10.2110	2,800	2,764	0,51	5,875 % fällig am 30.10.2021				Growthpoint Properties International Pty. Ltd.	1,100	1,119	0,20
6,050 % fällig am 11.01.2040	3,208	3,545	0,65			940	0,17	5,872 % fällig am 02.05.2023			
		16,042	2,94	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Myriad International Holdings BV	400	413	0,08
Summe Mexiko		53,277	9,75	Fondo MIVIVIENDA S.A.	200	194	0,04	5,500 % fällig am 21.07.2025			
<b>MONGOLEI</b>				3,500 % fällig am 31.01.2023						3,234	0,59
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Peru Government International Bond	1,890	2,367	0,43	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Mongolia Government International Bond	200	188	0,03	6,550 % fällig am 14.03.2037	1,200	1,764	0,32	South Africa Government International Bond	3,000	2,958	0,54
5,125 % fällig am 05.12.2022				8,750 % fällig am 21.11.2033				4,875 % fällig am 14.04.2026	2,500	2,410	0,44
5,625 % fällig am 01.05.2023	2,000	1,898	0,35			4,325	0,79	5,000 % fällig am 12.10.2046	2,000	1,667	0,31
Summe Mongolei		2,086	0,38	Summe Peru		5,265	0,96	5,875 % fällig am 22.06.2030	700	696	0,13
<b>MAROKKO</b>				<b>PHILIPPINEN</b>						7,731	1,42
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Südafrika		10,965	2,01
Morocco Government International Bond	1,000	1,018	0,19	Power Sector Assets & Liabilities Management Corp.	2,000	2,365	0,43				
5,500 % fällig am 11.12.2042				7,390 % fällig am 02.12.2024				<b>SRI LANKA</b>			
<b>NAMIBIA</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Poland Government International Bond	2,200	2,128	0,39	National Savings Bank	600	593	0,11
Namibia Government International Bond	1,200	1,111	0,20	3,250 % fällig am 06.04.2026				5,150 % fällig am 10.09.2019	800	803	0,15
5,250 % fällig am 29.10.2025				<b>KATAR</b>				8,875 % fällig am 18.09.2018		1,396	0,26
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Qatar Government International Bond	1,200	1,230	0,23	Sri Lanka Government International Bond	200	200	0,04
CIMPOR Financial Operations BV	1,700	1,368	0,25	4,500 % fällig am 20.01.2022	1,700	1,699	0,31	5,125 % fällig am 11.04.2019	2,000	1,970	0,36
5,750 % fällig am 17.07.2024				5,103 % fällig am 23.04.2048				5,750 % fällig am 18.01.2022	200	187	0,03
Kazakhstan Temir Zholy Finance BV	1,400	1,520	0,28	Summe Katar		2,929	0,54	6,125 % fällig am 03.06.2025	1,400	1,281	0,23
6,950 % fällig am 10.07.2042				<b>RUMANIEN</b>				6,200 % fällig am 11.05.2027	2,800	2,842	0,52
Metinvest BV	1,500	1,411	0,26	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				6,250 % fällig am 04.10.2020	200	202	0,04
7,750 % fällig am 23.04.2023				Romania Government International Bond	100	119	0,02	6,250 % fällig am 27.07.2021	600	576	0,11
Syngenta Finance NV	200	199	0,03	2,875 % fällig am 26.05.2028				6,825 % fällig am 18.07.2026	400	388	0,07
4,441 % fällig am 24.04.2023				Summe Rumänien		4,152	0,76	6,850 % fällig am 03.11.2025		7,646	1,40
Summe Niederlande		4,498	0,82	<b>RUSSLAND</b>				Summe Sri Lanka		9,042	1,66
<b>OMAN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>ÜBERNATIONAL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Russia Government International Bond	1,600	1,630	0,30	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Oman Government International Bond	1,700	1,605	0,29	4,500 % fällig am 04.04.2022	2,200	2,306	0,42	Africa Finance Corp.	400	401	0,07
5,375 % fällig am 08.03.2027	5,500	5,190	0,95	5,625 % fällig am 04.04.2042	200	216	0,04	4,375 % fällig am 29.04.2020	800	765	0,14
5,625 % fällig am 17.01.2028	300	270	0,05	5,875 % fällig am 16.09.2043				Banque Ouest Africaine de Developpement		1,166	0,21
6,500 % fällig am 08.03.2047				Summe Russland		4,152	0,76	5,000 % fällig am 27.07.2027			
Summe Oman		7,065	1,29	<b>SENEGAL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>PAKISTAN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Ghana Government International Bond	200	244	0,05
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Senegal Government International Bond	500	546	0,10	10,750 % fällig am 14.10.2030			
Pakistan Government International Bond	1,300	1,133	0,21	4,750 % fällig am 13.03.2028	2,000	1,778	0,33	Summe übernational		1,410	0,26
6,875 % fällig am 05.12.2027				6,250 % fällig am 23.05.2033	600	515	0,09	<b>TANSANIA</b>			
<b>PANAMA</b>				6,750 % fällig am 13.03.2048				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Senegal		2,839	0,52	Ministry of Finance and Economic Affairs	3,800	3,804	0,70
Panama Government International Bond	1,000	972	0,18	<b>SERBIEN</b>				7,825 % fällig am 10.12.2019			
4,500 % fällig am 15.05.2047	1,000	1,370	0,25	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
8,125 % fällig am 28.04.2034	150	202	0,03	Serbia Government International Bond	2,700	2,746	0,50	Tanzania Government International Bond	1,822	1,862	0,34
8,875 % fällig am 30.09.2027	180	222	0,04	4,875 % fällig am 25.02.2020				8,241 % fällig am 09.03.2020		5,666	1,04
9,375 % fällig am 16.01.2023	300	422	0,08	Summe Serbien		1,429	0,26	Summe Tansania			
9,375 % fällig am 01.04.2029				<b>SINGAPUR</b>				<b>TRINIDAD UND TOBAGO</b>			
Summe Panama		3,188	0,58	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>PARAGUAY</b>				BOC Aviation Ltd.	1,300	1,237	0,23	Petroleum Co. of Trinidad & Tobago Ltd.	710	694	0,13
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				2,750 % fällig am 18.09.2022	200	192	0,03	6,000 % fällig am 08.05.2022			
Paraguay Government International Bond	800	784	0,14	United Overseas Bank Ltd.				<b>TÜRKEI</b>			
4,700 % fällig am 27.03.2027	1,000	1,028	0,19	2,880 % fällig am 08.03.2027 (f)				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,100 % fällig am 11.08.2044				Summe Singapur		1,429	0,26	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S	200	189	0,03
Summe Paraguay		1,812	0,33	<b>SLOWENIEN</b>				5,004 % fällig am 06.04.2023	320	300	0,05
<b>PERU</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Turkish Airlines Pass-Through Trust	2,400	2,383	0,44
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Slovenia Government International Bond	594	647	0,12	4,200 % fällig am 15.09.2028			
Peru LNG SRL	300	299	0,05	5,250 % fällig am 18.02.2024				Turkiye Garanti Bankasi A/S			
5,375 % fällig am 22.03.2030				<b>SÜDAFRIKA</b>				3,606 % fällig am 11.02.2019			
Petroleos del Peru S.A.	500	487	0,09	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
5,625 % fällig am 19.06.2047				AngloGold Ashanti Holdings PLC	300	306	0,06				
				5,375 % fällig am 15.04.2020							

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS
<b>TÜRKEI</b>				<b>USA</b>				<b>VIETNAM</b>			
Türkiye İb Bankası				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
6,125 % fällig am 25.04.2024	\$ 400	\$ 365	0,07	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust	1.500	1.459	0,26	Vietnam Government International Bond	1.000	995	0,18
				2,331 % fällig am 25.02.2037	640	660	0,12	4,800 % fällig am 19.11.2024			
		3.237	0,59	2,841 % fällig am 25.11.2035				<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Long Beach Mortgage Loan Trust	1.328	1.047	0,19	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Export-Credit Bank of Turkey	700	626	0,11	2,241 % fällig am 25.09.2036				Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	1.000	1.000	0,18
4,250 % fällig am 18.09.2022				MASTR Asset-Backed Securities Trust	1.368	988	0,18	4,875 % fällig am 07.10.2020	\$ 600	631	0,12
5,375 % fällig am 24.10.2023	900	820	0,15	2,311 % fällig am 25.11.2036	1.587	1.569	0,29	Rosneft Finance S.A.			
Turkey Government International Bond	1.000	889	0,16	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust	356	257	0,05	7,250 % fällig am 02.02.2020			
3,250 % fällig am 23.03.2023	400	299	0,05	2,886 % fällig am 25.03.2034	1.000	869	0,16	Summe Jungferneinseln (Britisch)		1.631	0,30
4,875 % fällig am 16.04.2043	400	299	0,05	Option One Mortgage Loan Trust	232	99	0,02	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
5,125 % fällig am 17.02.2028	4.900	4.328	0,79	2,611 % fällig am 25.09.2035	207	176	0,03	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (h)</b>			
5,750 % fällig am 22.03.2024	300	290	0,05	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates						563	0,10
5,750 % fällig am 11.05.2047	1.800	1.457	0,27	2,611 % fällig am 25.09.2035				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
6,000 % fällig am 25.03.2027	5.100	4.802	0,88	Soundview Home Loan Trust				JPMorgan Structured Products BV			
6,000 % fällig am 14.01.2041	600	511	0,09	2,271 % fällig am 25.02.2037				16,623 % fällig am			
6,125 % fällig am 24.10.2028	3.200	3.005	0,55	2,991 % fällig am 25.10.2037				30.08.2018 (b)(c)(g)	EGP 9.700	526	0,10
6,750 % fällig am 30.05.2040	3.200	2.936	0,54	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
6,875 % fällig am 17.03.2036	4.030	3.804	0,70	Rio Oil Finance Trust				<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
7,000 % fällig am 11.03.2019	5.145	5.219	0,96	8,200 % fällig am 06.04.2028	1.200	1.219	0,22	0,919 % fällig am 13.07.2018			
7,250 % fällig am 05.03.2038	200	196	0,04	9,250 % fällig am 06.07.2024	3.100	3.332	0,61	(b)(c)	\$ 170	170	0,03
Summe Türkei	32.419	29.182	5,34	9,750 % fällig am 06.01.2027	1.754	1.895	0,35	0,996 % fällig am 10.08.2018			
								(b)(c)	500	498	0,09
<b>UKRAINE</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				1,196 % fällig am 24.08.2018		520	0,10
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				CitiMortgage Alternative Loan Trust	197	164	0,03	(b)(c)	280	278	0,05
Ukraine Government International Bond				2,741 % fällig am 25.10.2036				1,855 % fällig am 14.09.2018			
0,000 % fällig am 31.05.2040	900	573	0,11	Countrywide Alternative Loan Trust	190	111	0,02	(b)(c)	80	80	0,01
7,375 % fällig am 25.09.2032	400	344	0,06	2,441 % fällig am 25.05.2036 ^				3,154 % fällig am 26.10.2018		100	0,02
7,750 % fällig am 01.09.2019	1.750	1.750	0,32	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates	600	529	0,10	(b)(c)		1.641	0,30
7,750 % fällig am 01.09.2020	4.800	4.786	0,88	2,460 % fällig am 30.11.2037				<b>GREECE TREASURY BILLS</b>			
7,750 % fällig am 01.09.2021	1.400	1.384	0,25	IndyMac Mortgage Loan Trust	519	481	0,09	1,082 % fällig am 05.10.2018			
7,750 % fällig am 01.09.2022	3.400	3.336	0,61	2,271 % fällig am 25.02.2037	117	113	0,02	(b)(c)	€ 500	582	0,10
7,750 % fällig am 01.09.2023	1.000	966	0,18	JPMorgan Resecuritization Trust	142	131	0,02	1,674 % fällig am 06.07.2018	1.300	1.518	0,28
7,750 % fällig am 01.09.2024	3.000	2.853	0,52	2,500 % fällig am 25.03.2056	142	1078	0,20	(b)(c)		2.100	0,38
Summe Ukraine	15.992	15.992	2,93	Structured Asset Mortgage Investments Trust	1.146	1.078	0,20				
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				Suntrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust	235	223	0,04	Summe kurzfristige Instrumente		4.830	0,88
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,721 % fällig am 25.10.2037 ^							
DP World Ltd.						2.830	0,52	<b>AKTIEN</b>			
6,850 % fällig am 02.07.2037	580	664	0,12	<b>URUGUAY</b>				<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				PIMCO Funds Ireland p.l.c. -			
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond				Uruguay Government International Bond				PIMCO US Dollar Short-			
2,500 % fällig am 11.10.2022	1.200	1.151	0,21	4,375 % fällig am 27.10.2027	2.160	2.194	0,40	Term Floating Nav Fund			
Summe Vereinigte Arabische Emirate		1.815	0,33	4,975 % fällig am 20.04.2055	800	778	0,14	(e)	3.687.494	36.923	6,76
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				5,100 % fällig am 18.06.2050	1.700	1.677	0,31	Summe Übertragbare Wertpapiere und			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,625 % fällig am 21.03.2036	1.080	1.401	0,26	Geldmarktinstrumente – Amtliche			
Afren PLC				7,875 % fällig am 15.01.2033	2.130	2.787	0,51	Börse/Geregelter Markt	\$ 530.463	97,10	
11,500 % fällig am 01.02.2016 ^	282	1	0,00	Summe Uruguay		8.837	1,62				
15,000 % fällig am 25.04.2049 ^ (g)	788	87	0,02	<b>VENEZUELA</b>							
<b>Polyus Finance PLC</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
4,700 % fällig am 29.01.2024	300	282	0,05	Petroleos de Venezuela S.A.							
State Savings Bank of Ukraine Via SSB PLC	200	202	0,04	5,375 % fällig am 12.04.2027 ^	11.120	2.613	0,48				
9,375 % fällig am 10.03.2023				5,500 % fällig am 12.04.2037 ^	6.300	1.449	0,26				
Ukreximbank Via Biz Finance PLC	150	151	0,03	Summe Venezuela		4.062	0,74				
9,625 % fällig am 27.04.2022											
Summe Großbritannien		723	0,14								

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
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	428	\$ 445	0,08

# Aufstellung der Wertpapiieranlagen des Socially Responsible Emerging Markets Bond 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 KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 33.700	\$ (358)	(0,07)

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,285 %	02.01.2025	BRL 4.000	\$ 2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,440	02.01.2019	13.400	151	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	16,150	04.01.2021	11.710	(119)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.06.2027	\$ 7.100	(204)	(0,03)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	€ 2.000	(29)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	1.600	(38)	(0,01)
					\$ (237)	(0,04)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

\$ (595) (0,11)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (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>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlt/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2020	\$ 400	\$ (25)	\$ 21	\$ (4)	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2019	1.400	15	(4)	11	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2018	1.100	(9)	13	4	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	100	0	1	1	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.09.2020	300	(16)	18	2	0,00	
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2021	1.900	(22)	55	33	0,01	
	Peru Government International Bond	0,000	20.06.2023	5.000	63	(37)	26	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2018	0	0	0	0	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.09.2020	200	(8)	11	3	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2022	100	(4)	1	(3)	0,00	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2018	0	0	0	0	0,00	
	BPS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2018	0	0	0	0	0,00
		Peru Government International Bond	1,000	20.06.2018	0	0	0	0	0,00
		Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	800	(11)	0	(11)	0,00
BRC		Colombia Government International Bond	0,000	20.06.2023	1.000	0	(11)	(11)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	200	0	1	1	0,00	
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2024	200	(28)	22	(6)	0,00	
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2019	200	1	1	2	0,00	
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2018	2.900	18	(7)	11	0,00	
	Russia Government International Bond	1,000	20.03.2019	2.100	(66)	70	4	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	600	(43)	29	(14)	0,00	
	CBK	Colombia Government International Bond	0,000	20.12.2022	1.600	(10)	2	(8)	0,00
Colombia Government International Bond		1,000	20.12.2018	600	(5)	7	2	0,00	
Indonesia Government International Bond		1,000	20.03.2024	300	(41)	33	(8)	0,00	
Mexico Government International Bond		0,000	20.06.2023	1.000	(9)	(6)	(15)	0,00	
Mexico Government International Bond		1,000	20.12.2027	5.500	(322)	(121)	(443)	(0,08)	
Russia Government International Bond		1,000	20.12.2022	5.200	(77)	9	(68)	(0,01)	
DUB	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	600	4	0	4	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.09.2020	200	(11)	13	2	0,00	
	Panama Government International Bond	1,000	20.03.2019	3.300	(19)	40	21	0,00	
	Penerbangan Malaysia Bhd.	1,000	20.12.2018	2.600	(32)	43	11	0,00	
	Penerbangan Malaysia Bhd.	1,000	20.03.2020	300	(3)	6	3	0,00	
FBF	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2018	1.500	(20)	26	6	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.09.2020	200	(11)	13	2	0,00	
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2018	600	(4)	7	3	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.03.2019	2.300	(34)	48	14	0,00	
GST	Brazil Government International Bond	0,000	20.06.2023	100	(4)	(3)	(7)	0,00	

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2019	\$ 100	\$ (4)	\$ 4	\$ 0	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2020	200	(12)	10	(2)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	700	1	3	4	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2024	200	(27)	21	(6)	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2018	2.000	(14)	23	9	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2019	100	1	0	1	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2018	0	0	0	0	0,00
	Russia Government International Bond	0,000	20.12.2022	1.300	(16)	(1)	(17)	0,00
	Russia Government International Bond	0,000	20.06.2023	3.700	(40)	(29)	(69)	(0,01)
HUS	Argentine Republic Government International Bond	0,000	20.12.2018	500	5	1	6	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.03.2019	1.100	1	(2)	(1)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.09.2020	5.000	(415)	343	(72)	(0,01)
	Colombia Government International Bond	1,000	20.03.2020	5.000	(101)	141	40	0,01
	Indonesia Government International Bond	0,000	20.06.2023	6.700	(89)	(19)	(108)	(0,02)
	Mexico Government International Bond	0,000	20.06.2023	5.200	(46)	(32)	(78)	(0,02)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.03.2019	200	(11)	10	(1)	0,00
JPM	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2020	0	0	0	0	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2019	700	7	(1)	6	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2018	300	(2)	3	1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2019	1.100	5	1	6	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2019	500	2	2	4	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2021	3.800	(41)	105	64	0,01
MYC	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	2.300	(18)	57	39	0,01
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.03.2019	1.400	(27)	29	2	0,00
	South Africa Government International Bond	0,000	20.12.2022	2.000	(38)	(44)	(82)	(0,02)
NGF	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2018	2.700	(26)	17	(9)	0,00
					\$ (1.638)	\$ 943	\$ (695)	(0,13)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	07/2018	\$ 518	ARS 13.450	\$ 0	\$ (52)	\$ (52)	(0,01)
	07/2018	2.728	COP 7.804.808	0	(72)	(72)	(0,01)
	07/2018	379	€ 324	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	ARS 13.623	\$ 597	147	0	147	0,03
BPS	07/2018	13.450	490	24	0	24	0,00
	07/2018	€ 25.634	29.732	0	(197)	(197)	(0,04)
	07/2018	\$ 486	ARS 13.450	0	(24)	(24)	0,00
CBK	08/2018	2.459	TRY 10.884	0	(127)	(127)	(0,02)
FBF	10/2018	€ 400	\$ 498	28	0	28	0,01
GLM	07/2018	BRL 2.397	630	7	0	7	0,00
	07/2018	£ 3.031	4.042	41	0	41	0,01
	07/2018	\$ 641	BRL 2.397	0	(18)	(18)	0,00
	07/2018	1.262	€ 1.069	0	(14)	(14)	0,00
	08/2018	312	BRL 1.199	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	1.782	TWD 52.471	0	(52)	(52)	(0,01)
HUS	08/2018	2.505	RUB 156.587	0	(22)	(22)	0,00
	09/2018	CNY 1.355	\$ 212	8	0	8	0,00
	09/2018	TWD 52.455	1.766	37	0	37	0,01
	10/2018	€ 100	124	6	0	6	0,00
JPM	08/2018	\$ 2.616	MXN 51.013	0	(43)	(43)	(0,01)
	08/2018	ZAR 13.308	\$ 1.043	76	0	76	0,01
	09/2018	\$ 478	EGP 8.744	0	0	0	0,00
	09/2018	512	KRW 551.014	0	(16)	(16)	0,00
SCX	07/2018	€ 1.300	\$ 1.581	63	0	63	0,01
	09/2018	KRW 551.023	513	16	0	16	0,00
SSB	07/2018	\$ 28.219	€ 24.241	84	0	84	0,01
	08/2018	€ 24.241	\$ 28.282	0	(82)	(82)	(0,02)
UAG	07/2018	\$ 4.008	£ 3.031	0	(6)	(6)	0,00
	08/2018	£ 3.031	\$ 4.013	6	0	6	0,00
				\$ 543	\$ (727)	\$ (184)	(0,03)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (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 Nettover- mögens
BOA	07/2018	\$ 114.708	€ 97.720	\$ 0	\$ (615)	\$ (615)	(0,11)
BRC	07/2018	€ 377	\$ 436	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	\$ 68	€ 58	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2018	847	727	5	(3)	2	0,00
GLM	07/2018	197	168	0	(1)	(1)	0,00
MSB	07/2018	€ 96.797	\$ 111.800	0	(1.214)	(1.214)	(0,22)
	08/2018	\$ 112.047	€ 96.797	1.214	0	1.214	0,22
RBC	07/2018	€ 89	\$ 103	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 45	€ 39	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	€ 1.250	\$ 1.465	6	0	6	0,00
SCX	07/2018	\$ 114.468	€ 98.797	890	(7)	883	0,16
SSB	07/2018	€ 96.888	\$ 112.787	0	(334)	(334)	(0,06)
	07/2018	\$ 113.929	€ 97.906	381	0	381	0,07
	08/2018	113.038	96.888	330	0	330	0,06
				\$ 2.826	\$ (2.180)	\$ 646	0,12

Zum 30. Juni 2018 standen für die Investor NOK (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 Nettover- mögens
BOA	07/2018	NOK 2.234	\$ 272	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07/2018	\$ 278	NOK 2.269	0	0	0	0,00
	08/2018	272	2.234	2	0	2	0,00
JPM	07/2018	274	2.270	4	0	4	0,00
SCX	07/2018	NOK 2.234	\$ 274	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 276	NOK 2.273	3	0	3	0,00
	08/2018	274	2.234	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	NOK 34	\$ 4	0	0	0	0,00
				\$ 9	\$ (2)	\$ 7	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Investor SEK (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 Nettover- mögens
GLM	07/2018	SEK 301	\$ 35	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07/2018	\$ 367	SEK 3.214	0	(8)	(8)	0,00
HUS	07/2018	SEK 340	\$ 38	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 1	SEK 12	0	0	0	0,00
IND	07/2018	SEK 2.955	\$ 328	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	\$ 328	SEK 2.947	3	0	3	0,00
JPM	07/2018	363	3.220	0	(3)	(3)	0,00
RBC	07/2018	SEK 35	\$ 4	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	2.948	331	2	0	2	0,00
	08/2018	\$ 332	SEK 2.948	0	(2)	(2)	0,00
SOG	07/2018	361	3.212	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07/2018	SEK 27	\$ 3	0	0	0	0,00
				\$ 6	\$ (17)	\$ (11)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (237) (0,04)

Summe Anlagen

\$ 530.076 97,03

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 16.205 2,97

Nettovermögen

\$ 546.281 100,00

## 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) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(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:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettover- mögens
Afren PLC	15,000 %	25.04.2049	30.04.2015	\$ 761	\$ 87	0,02
JPMorgan Structured Products BV	16,623	25.04.2018	30.01.2018	535	526	0,10
				\$ 1.296	\$ 613	0,12

Barmittel in Höhe von USD 5.431 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 3.350 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(h) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 563	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	\$ (579)	\$ 563	\$ 563	0,10
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (579)</b>	<b>\$ 563</b>	<b>\$ 563</b>	<b>0,10</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 41.853	\$ 484.377	\$ 4.233	\$ 530.463
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	445	(832)	0	(387)
<b>Summen</b>	<b>\$ 42.298</b>	<b>\$ 483.545</b>	<b>\$ 4.233</b>	<b>\$ 530.076</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 28.480	\$ 465.818	\$ 3.210	\$ 497.508
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(106)	3.780	0	3.674
<b>Summen</b>	<b>\$ 28.374</b>	<b>\$ 469.598</b>	<b>\$ 3.210</b>	<b>\$ 501.182</b>

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (520)	\$ 1.670	\$ 1.150
BPS	(208)	0	(208)
BRC	(18)	0	(18)
CBK	(665)	680	15
DUB	47	(100)	(53)
FBF	47	(40)	7
GLM	(45)	0	(45)
GST	(87)	0	(87)
HUS	(185)	260	75
JPM	99	0	99
MSB	0	0	0
MYC	(41)	0	(41)
NGF	(9)	0	(9)
RBC	(1)	0	(1)
RYL	6	0	6
SCX	965	(230)	735
SOG	(1)	0	(1)
SSB	379	740	1.119

(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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	79,05	83,49
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	7,82	5,89
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	10,23	7,81
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,08	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,11)	0,20
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,04)	0,53
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	0,00	(0,33)

**Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des  
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund**

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	19.904.250	\$ 199.275	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	17.419.604	\$ 174.400
	<b>PARI (000S)</b>		PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)	113.230	11.490
Southern Gas Corridor CJSC 6,875 % fällig am 24.03.2026	\$ 5.500	6.052	<b>PARI (000S)</b>		
Argentina Government International Bond 5,875 % fällig am 11.01.2028	5.500	5.449	Brazil Government International Bond 2,625 % fällig am 05.01.2023	\$ 3.750	3.643
Turkey Government International Bond 6,125 % fällig am 24.10.2028	5.300	5.270	Croatia Government International Bond 6,750 % fällig am 05.11.2019	3.000	3.180
KazMunayGas National Co. JSC 4,750 % fällig am 24.04.2025	5.200	5.200	Israel Government International Bond 4,125 % fällig am 17.01.2048	3.000	2.963
Pelabuhan Indonesia Persero PT 4,500 % fällig am 02.05.2023	5.000	4.945	Argentina Government International Bond 5,875 % fällig am 11.01.2028	2.900	2.756
Turkey Government International Bond 5,125 % fällig am 17.02.2028	4.900	4.871	Eskom Holdings SOC Ltd. 6,750 % fällig am 06.08.2023	2.500	2.600
Petroleos Mexicanos 3,500 % fällig am 30.01.2023	5.000	4.870	Argentina Government International Bond 6,875 % fällig am 26.01.2027	2.200	2.404
Israel Government International Bond 4,125 % fällig am 17.01.2048	4.000	3.999	Qatar Government International Bond 3,875 % fällig am 23.04.2023	2.200	2.187
Oman Government International Bonds 5,625 % fällig am 17.01.2028	4.000	3.992	Ecuador Government International Bond 8,875 % fällig am 23.10.2027	2.000	2.177
Ecuador Government International Bonds 7,875 % fällig am 23.01.2028	3.800	3.832	Turkey Government International Bond 6,125 % fällig am 24.10.2028	2.100	2.104
Ministry of Finance and Economic Affairs 7,825 % fällig am 10.12.2019	3.800	3.800	Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 10.02.2023	2.000	2.101
Egypt Government International Bond 4,750 % fällig am 16.04.2026	€ 3.000	3.722	Romania Government International Bond 2,750 % fällig am 29.10.2025	€ 1.500	2.017
Petroleos Mexicanos 6,500 % fällig am 13.03.2027	\$ 3.400	3.656	Paraguay Government International Bonds 4,700 % fällig am 27.03.2027	\$ 1.800	1.871
Argentina Government International Bond 6,875 % fällig am 11.01.2048	3.350	3.263	Pertamina Persero PT 4,875 % fällig am 03.05.2022	1.800	1.869
Indonesia Government International Bond 3,375 % fällig am 15.04.2023	3.000	2.958	Ecopetrol S.A. 5,875 % fällig am 18.09.2023	1.500	1.592
Argentina Government International Bond 7,820 % fällig am 31.12.2033	€ 1.789	2.505	France Treasury Bills 0,000 % fällig am 31.01.2027	1.500	1.434
Ghana Government International Bond 7,875 % fällig am 07.08.2023	\$ 2.300	2.496	Turkey Government International Bond 6,250 % fällig am 26.09.2022	1.400	1.408
Türkiye Garanti Bankasi A/S 3,606 % fällig am 11.02.2019	2.400	2.400	Panama Government International Bond 8,875 % fällig am 30.09.2027	1.000	1.400
QNB Finance Ltd. 3,705 % fällig am 12.02.2020	2.300	2.300	Uruguay Government International Bond 4,375 % fällig am 27.10.2027	1.240	1.338

(a) Der Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.









BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS
Dominion Gas Holdings LLC 2,300 % fällig am 10.07.2018	\$ 3.900	\$ 3.897	0,20	Sempra Energy Holdings 2,520 % fällig am 26.07.2018	\$ 6.800	\$ 6.788	0,34	Letras del Banco Central de la Republica Argentina 25,600 % fällig am 18.07.2018	ARS 1.965	\$ 67	0,00
Dominion Resources 2,300 % fällig am 23.07.2018	600	599	0,03	Southern Co. 2,600 % fällig am 23.07.2018	3.300	3.295	0,17			129.203	6,49
Duke Energy Corp. 2,300 % fällig am 01.08.2018	1.100	1.098	0,05	Starbucks Corp. 2,350 % fällig am 10.08.2018	600	599	0,03	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
Enterprise Prods Oper LLC 2,320 % fällig am 06.07.2018	3.900	3.898	0,20	Toronto Dominion Bank 1,537 % fällig am 03.07.2018	CAD 4.100	3.116	0,16	2,974 % fällig am 16.11.2018 (c)(d)	\$ 1.500	1.475	0,07
Enterprise Products Operating LLC 2,350 % fällig am 26.07.2018	700	699	0,03	Virginia Electric & Power Co. 2,360 % fällig am 16.07.2018	\$ 4.400	4.395	0,22	25,800 % fällig am 19.09.2018 (c)(d)	ARS 1.595	51	0,00
Hitachi Capital America 2,450 % fällig am 13.07.2018	1.900	1.898	0,10	VW CR, Inc. 2,540 % fällig am 15.08.2018	5.800	5.782	0,29			1.526	0,07
HSBC Bank Canada 1,579 % fällig am 06.07.2018	CAD 2.600	1.976	0,10			110.594	5,56	<b>GREECE TREASURY BILLS</b>			
Marriot International 2,350 % fällig am 27.08.2018	\$ 1.600	1.594	0,08			303.053	15,23	0,706 % fällig am 02.11.2018 (c)(d)	€ 3.400	3.958	0,20
Mondelez International, Inc. 2,480 % fällig am 16.08.2018	1.800	1.794	0,09	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (h)</b>				1,082 % fällig am 05.10.2018 (c)(d)	1.500	1.747	0,09
National Bank Of Canada 1,525 % fällig am 03.07.2018	CAD 4.400	3.344	0,17	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				1,267 % fällig am 15.03.2019 (c)(d)	3.500	4.059	0,20
Reckitt Benckiser Treasury 2,390 % fällig am 16.08.2018	\$ 2.600	2.593	0,13	Federal Home Loan Bank 1,860 % fällig am 12.07.2018 (c)(d)	20.100	20.090	1,01			9.764	0,49
Rogers Communications 2,370 % fällig am 19.07.2018	1.600	1.598	0,08	1,860 % fällig am 13.07.2018 (c)(d)	35.000	34.980	1,76	Summe kurzfristige Instrumente		554.140	27,84
Royal Bank of Canada 1,527 % fällig am 06.07.2018	CAD 2.600	1.976	0,10	1,872 % fällig am 27.07.2018 (c)(d)	9.400	9.388	0,47	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt		\$ 2.150.416	108,05
1,537 % fällig am 03.07.2018	4.400	3.344	0,17	1,890 % fällig am 24.07.2018 (c)(d)	12.900	12.885	0,65				
				1,890 % fällig am 08.08.2018 (c)(d)	20.400	20.360	1,02				
				1,895 % fällig am 10.08.2018 (c)(d)	19.300	19.260	0,97				
				1,921 % fällig am 31.08.2018 (c)(d)	9.200	9.171	0,46				
				Harris Corp. 2,794 % fällig am 27.02.2019	3.000	3.002	0,15				

## 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
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2018	1.309	\$ (977)	(0,05)
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2019	1.621	1.622	0,08
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2019	2.457	(2.113)	(0,10)
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03/2020	2.457	2.230	0,11
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09/2019	752	468	0,02
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09/2018	2.734	(8.167)	(0,41)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	16	(13)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2018	1.071	(263)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	2.912	444	0,02
				\$ (6.769)	(0,34)

## OPTIONSKAUF

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 121,000	27.07.2018	695	\$ 164	\$ 130	0,01

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	¥ 120,000	27.07.2018	695	\$ (390)	\$ (380)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (7.019)	(0,35)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ 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 Nettover- mögens
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000 %	20.12.2021	\$ 1.900	\$ 5	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.06.2022	700	2	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.12.2022	400	1	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2021	700	28	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2022	1.500	(22)	0,00
Kinder Morgan, Inc.	1,000	20.06.2021	900	12	0,00
Kinder Morgan, Inc.	1,000	20.12.2021	100	2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2022	500	(2)	0,00
				\$ 26	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500 %	21.06.2027	\$ 11.500	\$ 558	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	16.12.2020	3.500	(67)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2025	311.200	227	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,215	05.02.2026	4.500	102	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	19.600	129	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	164.400	(363)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027	1.500	93	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	10.200	(164)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,540	23.03.2048	1.800	151	0,01
					\$ 666	0,04
					\$ 692	0,04

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* 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	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettover- mögens
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,000 %	19.12.2018	\$ 208.000	\$ 461	\$ 27	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,970	24.09.2018	6.800	346	168	0,01
FBF	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,850	30.11.2018	205.700	297	20	0,00
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,150	31.01.2019	258.000	271	85	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,970	24.09.2018	18.200	940	450	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,040	22.06.2020	582.900	2.110	2.235	0,11
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,370	27.03.2020	43.100	1.733	1.555	0,08
						\$ 6.158	\$ 4.540		0,23

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

#### VERKAUFSOPTIONEN

#### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettover- mögens
BOA	Put - OTC USD versus JPY	¥ 80,000	18.02.2019	\$ 200	\$ (11)	\$ 0	0,00

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettover- mögens
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,600 %	24.09.2018	\$ 34.000	\$ (354)	\$ (555)	(0,03)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,190	19.12.2018	43.800	(462)	(39)	0,00
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,600	24.09.2018	91.100	(968)	(1.488)	(0,07)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,210	31.01.2019	51.600	(271)	(79)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettöver- mögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,019 %	21.06.2021	\$ 582.900	\$ (2.740)	\$ (2.945)	(0,15)
	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	27.03.2020	313.000	(1.734)	(1.718)	(0,09)
							\$ (6.529)	\$ (6.824)	(0,34)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettöver- mögens
GST	Qatar Government International Bond	1,000 %	20.12.2018	\$ 2.800	\$ 14	\$ (4)	\$ 10	0,00
NGF	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2023	16.700	111	(36)	75	0,00
					\$ 125	\$ (40)	\$ 85	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettöver- mögens
BPS	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	26.071	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 135.767	24.04.2019	\$ 0	\$ 3.011	\$ 3.011	0,15
CBK	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	21.885	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	117.505	07.12.2018	0	(706)	(706)	(0,04)
DUB	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	23.005	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	123.518	07.12.2018	0	(742)	(742)	(0,04)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	22.548	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	120.549	14.12.2018	0	(168)	(168)	(0,01)
FAR	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	28.127	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	146.065	07.11.2018	0	3.778	3.778	0,19
GST	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	35.735	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	190.042	15.11.2018	0	783	783	0,04
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	14.589	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	79.735	30.11.2018	0	(1.768)	(1.768)	(0,09)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	21.671	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	115.860	07.12.2018	0	(237)	(237)	(0,01)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	15.333	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	80.280	16.10.2019	0	1.379	1.379	0,07
MYI	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	963	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	4.881	15.10.2018	0	239	239	0,01
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	875	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	4.527	25.10.2018	0	128	128	0,01
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	89.057	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	473.614	30.11.2018	0	1.954	1.954	0,10
							\$ 0	\$ 7.651	\$ 7.651	0,38

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettöver- mögens		
AZD	11/2018	€	1.200	\$ 45	\$ 0	\$ 45	0,00		
BOA	07/2018	CAD	5.200	4.007	54	0	0,00		
	07/2018	DKK	47.045	7.252	0	(120)	(0,01)		
	07/2018	€	148	173	0	0	0,00		
	07/2018	TRY	42.740	9.163	0	(96)	0,00		
	08/2018	ARS	3.250	151	43	0	0,00		
	09/2018		1.595	72	21	0	0,00		
BPS	07/2018	DKK	9.640	1.454	0	(57)	0,00		
	07/2018	€	10.775	12.514	5	(72)	0,00		
	08/2018	ARS	2.200	102	29	0	0,00		
	09/2018	INR	10.370	152	2	0	0,00		
BRC	08/2018	RUB	2.007	32	0	0	0,00		
CBK	07/2018	CAD	25.385	19.542	245	0	245	0,01	
	07/2018	DKK	113.696	17.550	38	(304)	(266)	(0,01)	
	07/2018	£	9.779	12.956	45	0	45	0,00	
	07/2018	TRY	14.466	3.161	27	0	27	0,00	
	07/2018	\$	17	ARS	456	0	(2)	0,00	
	07/2018		735	TRY	3.288	0	(22)	0,00	
	03/2019	€	3.500	\$	4.455	283	0	283	0,02
FBF	10/2018		1.500	1.867	104	0	104	0,01	
GLM	07/2018		1.114	1.293	0	(7)	(7)	0,00	
	07/2018	\$	2.881	€	2.466	0	(2)	0,00	
	08/2018	RUB	616.119	\$	9.557	0	(216)	(216)	(0,01)
	08/2018	\$	12.518	TRY	55.773	0	(566)	(566)	(0,03)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
HUS	10/2018	DKK 19.490	\$ 3.007	\$ 0	\$ (70)	\$ (70)	0,00
	07/2018	ARS 2.817	133	37	0	37	0,00
	07/2018	€ 24	28	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 15	ARS 396	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	9.086	CAD 12.089	104	0	104	0,01
	07/2018	24	€ 21	0	0	0	0,00
	08/2018	ARS 830	\$ 38	11	0	11	0,00
	08/2018	CAD 12.089	9.091	0	(103)	(103)	(0,01)
JPM	08/2018	\$ 13.448	RUB 840.539	0	(116)	(116)	(0,01)
	07/2018	CAD 7.100	\$ 5.471	73	0	73	0,00
	07/2018	DKK 56.600	8.702	0	(167)	(167)	(0,01)
	07/2018	NZD 212	149	6	0	6	0,00
	07/2018	\$ 17.869	DKK 111.508	0	(396)	(396)	(0,02)
	08/2018	RUB 269.955	\$ 4.311	29	0	29	0,00
MSB	11/2018	€ 2.200	2.680	87	0	87	0,01
RBC	07/2018	CAD 25.604	19.829	365	0	365	0,02
SCX	07/2018	13.500	10.437	174	0	174	0,01
	07/2018	DKK 7.010	1.099	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 790	RUB 49.484	0	(5)	(5)	0,00
SSB	10/2018	1.107	DKK 7.010	0	0	0	0,00
	07/2018	11.142	€ 9.571	33	0	33	0,00
	08/2018	€ 9.571	\$ 11.166	0	(33)	(33)	0,00
TOR	08/2018	\$ 9.075	¥ 989.840	0	(114)	(114)	(0,01)
UAG	10/2018	DKK 13.436	\$ 2.080	0	(41)	(41)	0,00
	07/2018	\$ 12.930	£ 9.779	0	(20)	(20)	0,00
	08/2018	£ 9.779	\$ 12.949	20	0	20	0,00
				\$ 1.880	\$ (2.531)	\$ (651)	(0,03)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutionell EUR (Hegend) Class und Class E EUR (Hegend) 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	07/2018	\$ 77.728	€ 66.216	\$ 0	\$ (417)	\$ (417)	(0,02)
BPS	07/2018	88.278	76.111	585	0	585	0,03
BRC	07/2018	€ 6.372	\$ 7.371	0	(68)	(68)	0,00
	07/2018	\$ 2.148	€ 1.821	0	(23)	(23)	0,00
CBK	07/2018	€ 63	\$ 73	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07/2018	484	561	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	\$ 3.045	€ 2.592	0	(19)	(19)	0,00
MSB	07/2018	€ 72.758	\$ 84.035	0	(913)	(913)	(0,05)
	08/2018	\$ 84.220	€ 72.758	912	0	912	0,05
RBC	07/2018	€ 21	\$ 24	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	2.498	2.933	16	0	16	0,00
	07/2018	\$ 252	€ 215	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2018	€ 53	\$ 62	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 2.409	€ 2.061	0	(3)	(3)	0,00
SSB	07/2018	€ 72.471	\$ 84.364	0	(250)	(250)	(0,01)
	07/2018	\$ 88.747	€ 76.266	297	0	297	0,01
	08/2018	84.551	72.471	247	0	247	0,01
				\$ 2.057	\$ (1.698)	\$ 359	0,02

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 5.160 0,26

	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVERMÖGENS
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Barclays Bank PLC			
1,940 % fällig am 04.09.2018	\$ 4.400	\$ 4.398	0,22
Credit Suisse AG			
2,722 % fällig am 28.09.2018	6.000	6.006	0,30
<b>Summe Einlagenzertifikate</b>		<b>\$ 10.404</b>	<b>0,52</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 2.159.653</b>	<b>108,52</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (169.511)</b>	<b>(8,52)</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 1.990.142</b>	<b>100,00</b>

### 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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(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) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von USD 37.373 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 6.830 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(h) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BSN	2,300 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 138.100	U.S. Treasury Notes 3,750 % fällig am 15.11.2018	\$ (140.963)	\$ 138.100	\$ 138.118	6,94
MFK	2,270	29.06.2018	02.07.2018	150.000	U.S. Treasury Bonds 3,750 % fällig am 15.11.2043	(152.564)	150.000	150.019	7,54
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	14.953	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	(15.257)	14.953	14.953	0,75
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (308.784)</b>	<b>\$ 303.053</b>	<b>\$ 303.090</b>	<b>15,23</b>

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 2.142.108	\$ 8.308	\$ 2.150.416
Einlagen bei Kreditinstituten	0	10.404	0	10.404
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(7.018)	5.851	0	(1.167)
<b>Summen</b>	<b>\$ (7.018)</b>	<b>\$ 2.158.363</b>	<b>\$ 8.308</b>	<b>\$ 2.159.653</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 55.399	\$ 1.842.714	\$ 1.056	\$ 1.899.169
Einlagen bei Kreditinstituten	0	18.817	0	18.817
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.759	12.382	0	14.141
Leerverkäufe	0	(71.805)	0	(71.805)
<b>Summen</b>	<b>\$ 57.158</b>	<b>\$ 1.802.108</b>	<b>\$ 1.056</b>	<b>\$ 1.860.322</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 der Wertpapieranlagen.<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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 45	\$ 0	\$ 45
BOA	(515)	1.070	555
BPS	3.503	(2.790)	713
BRC	(91)	0	(91)
CBK	(796)	460	(336)
DUB	(910)	(10.020)	(10.930)
FAR	3.778	(3.680)	98
FBF	124	0	124
GLM	(1.915)	1.630	(285)
GST	167	250	417
HUS	(69)	0	(69)
JPM	(455)	530	75
MSB	86	0	86

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
MYC	\$ (873)	\$ 640	\$ (233)
MYI	2.321	(2.000)	321
NGF	75	0	75
RBC	365	(540)	(175)
RYL	15	(55)	(40)
SCX	166	(260)	(94)
SSB	180	650	830
TOR	(41)	260	219

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	54,79	43,99
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	30,73	58,85
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	22,53	9,17
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,35)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,04	0,05
Freiverkehrsfinanzderivate	0,26	0,68
Einlagenzertifikate	0,52	1,11
Leerverkaufte Wertpapiere	0,00	(4,23)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des StocksPLUS™ Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	¥ 12.020.000	\$ 111.742	Facebook, Inc. 'A'	167.827	\$ 30.720
U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 31.03.2019	\$ 79.100	78.701	International Business Machines Corp.	93.331	13.910
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 28.02.2019	79.100	78.652	Chevron Corp.	109.996	13.593
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (a)	75.020	73.874	Alphabet, Inc. 'C'	11.775	12.713
United Kingdom Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2018	£ 50.300	70.225	Pfizer, Inc.	338.976	12.474
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.05.2018	¥ 7.440.000	69.035		<b>PARI (000S)</b>	
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 23.05.2018	\$ 52.700	52.695	Deutsche Bank AG 4,250 % fällig am 14.10.2021	\$ 11.200	11.596
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 29.05.2018	49.200	49.191	UBS Group Funding Switzerland AG 2,859 % fällig am 15.08.2023	10.600	10.368
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 31.05.2018	47.300	47.296	General Motors Financial Co., Inc. 3,003 % fällig am 30.06.2022	9.600	9.776
Italy Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2018	€ 31.500	38.931	Walt Disney Co.	<b>AKTIEN</b> 93.575	9.628
Federal Home Loan Bank 1,854 % fällig am 13.07.2018	\$ 35.000	34.908		<b>PARI (000S)</b>	
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 01.06.2018	31.700	31.699	CIFC Funding Ltd. 2,385 % fällig am 24.10.2025	9.165	9.165
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	¥ 2.920.000	27.527	Union Pacific Corp.	<b>AKTIEN</b> 63.209	9.119
Facebook, Inc. 'A'	114.526	20.378	Cisco Systems, Inc.	185.910	8.237
	<b>AKTIEN</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Federal Home Loan Bank 1,890 % fällig am 08.08.2018	\$ 20.400	20.340	Barclays Commercial Mortgage Securities Trust 2,727 % fällig am 15.05.2032	8.181	8.181
Federal Home Loan Bank 1,860 % fällig am 12.07.2018	20.100	20.048	Japan Bank for International Cooperation 1,753 % fällig am 21.07.2020	8.100	8.129
Federal Home Loan Bank 1,895 % fällig am 10.08.2018	19.300	19.243	Texas Instruments, Inc.	<b>AKTIEN</b> 72.505	7.877
AT&T, Inc. 2,975 % fällig am 01.06.2021	14.900	14.900		<b>PARI (000S)</b>	
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 30.05.2018	14.600	14.594	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a)	7.980	7.745
United Kingdom Treasury Bills 0,250 % fällig am 03.04.2018	10.100	14.125	Venture CLO Ltd. 2,439 % fällig am 15.07.2026	7.700	7.700
			Royal Bank of Scotland Group PLC 3,813 % fällig am 15.05.2023	7.300	7.454
			U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (a)	7.059	7.143
			U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a)	7.026	6.885
			<b>AKTIEN</b>		
			Microsoft Corp.	71.068	6.589
			Amazon.com, Inc.	4.442	6.522
				<b>PARI (000S)</b>	
			Verizon Communications, Inc. 2,879 % fällig am 22.05.2020	6.400	6.442
				<b>AKTIEN</b>	
			Oracle Corp.	135.404	6.367
			Amgen, Inc.	33.154	5.791
				<b>PARI (000S)</b>	
			Fidelity National Information Services, Inc. 2,850 % fällig am 15.10.2018	5.500	5.504
				<b>AKTIEN</b>	
			Apple, Inc.	31.980	5.496
				<b>PARI (000S)</b>	
			Cardinal Health, Inc. 3,079 % fällig am 15.06.2024	5.600	5.428
				<b>AKTIEN</b>	
			PayPal Holdings, Inc.	55.463	4.497
				<b>PARI (000S)</b>	
			AT&T, Inc. 2,850 % fällig am 14.02.2023	4.500	4.486
			Federal Home Loan Bank 1,921 % fällig am 31.08.2018	4.500	4.482
			ITC Holdings Corp. 2,700 % fällig am 15.11.2022	4.400	4.397
			U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (a)	4.530	4.387

(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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTOVER-MÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTOVER-MÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTOVER-MÖGENS	% DES			
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>					<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>					<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>							
Alfice Financing S.A.					Post Holdings, Inc.					Avolon Holdings Funding Ltd.							
5,098 % fällig am 31.01.2026	\$	16	\$	16	0,00	4,100 % fällig am 24.05.2024	\$	40	\$	39	0,00	5,500 % fällig am 15.01.2023	\$	190	\$	190	0,02
Aramark Services, Inc.					RPI Finance Trust					AXA Equitable Holdings, Inc.							
TBD% fällig am 11.03.2025		100		100	0,01	4,334 % fällig am 27.03.2023		59		59	0,01	3,900 % fällig am 20.04.2023		24		24	0,00
Avantor, Inc.					Sequa Mezzanine Holdings LLC												
6,094 % fällig am 21.11.2024		50		50	0,01	7,046 % fällig am 28.11.2021		149		149	0,02	4,350 % fällig am 20.04.2028		150		144	0,02
Avolon Holdings Ltd.					Sinclair Broadcast Group, Inc.												
3,698 % - 3,838 % fällig am 30.09.2020		50		50	0,01	11,099 % fällig am 28.04.2022		60		61	0,01	5,000 % fällig am 20.04.2048		86		80	0,01
4,088 % fällig am 15.01.2025	3.990			3.949	0,43	TBD% fällig am 12.12.2024		300		300	0,03	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.					
Axalta Coating Systems U.S. Holdings, Inc.					SS&C Technologies Holdings Europe SARL												
4,084 % fällig am 01.06.2024		30		30	0,00	4,594 % fällig am 16.04.2025		98		98	0,01	6,750 % fällig am 18.02.2020 (h)(j)	€	200		243	0,03
B. C. Unlimited Liability Co.					SS&C Technologies, Inc.												
4,344 % fällig am 16.02.2024		38		38	0,00	4,594 % fällig am 16.04.2025		278		279	0,03	7,000 % fällig am 19.02.2019 (h)(j)		1.000		1.197	0,13
Beacon Roofing Supply, Inc.					TEX Operations Co. LLC												
4,280 % - 6,250 % fällig am 02.01.2025		30		30	0,00	4,094 % fällig am 08.08.2023		57		57	0,01	Banco de Galicia y Buenos Aires S.A.					
BWAY Holding Co.					Unitymedia Finance LLC												
5,587 % - 7,250 % fällig am 03.04.2024		40		40	0,00	4,323 % fällig am 15.01.2026		100		100	0,01	25,980 % fällig am 26.04.2020	ARS	4.000		115	0,01
Caesars Resort Collection LLC					Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG												
4,844 % fällig am 22.12.2024		398		398	0,04	2,750 % fällig am 15.01.2027	€	200		232	0,03	Banco Espirito Santo S.A.					
California Resources Corp.					Univision Communications, Inc.												
6,838 % fällig am 31.12.2022		50		51	0,01	4,844 % fällig am 15.03.2024	\$	489		474	0,05	2,625 % fällig am 08.05.2017 ^	€	100		34	0,00
CenturyLink, Inc.					Valeant Pharmaceuticals International, Inc.												
4,844 % fällig am 31.01.2025		995		976	0,11	West Corp.											
Charter Communications Operating LLC					4,844 % fällig am 10.10.2024												
4,100 % fällig am 30.04.2025		99		99	0,01	3,726 % fällig am 30.05.2025		100		100	0,01	Banco Santander S.A.					
Community Health Systems, Inc.					Wyndham Hotels & Resorts, Inc.												
5,307 % fällig am 31.12.2019		273		273	0,03	3,726 % fällig am 30.05.2025		100		100	0,01	4,750 % fällig am 19.03.2025 (h)(j)		600		648	0,07
5,557 % fällig am 27.01.2021		788		770	0,08												
Core & Main LP																	
5,211 % - 5,300 % fällig am 01.08.2024		30		30	0,00												
Crown Americas LLC																	
4,312 % fällig am 29.01.2025		50		50	0,01												
CSC Holdings LLC																	
4,573 % fällig am 25.01.2026		100		100	0,01												
DaVita HealthCare Partners, Inc.																	
4,844 % fällig am 24.06.2021		96		96	0,01												
Dell, Inc.																	
4,100 % fällig am 07.09.2023		182		182	0,02												
Delos Finance SARL																	
4,084 % fällig am 06.10.2023		5		5	0,00												
Diamond Resorts Corp.																	
TBD% fällig am 11.08.2023		286		287	0,03												
First Data Corp.																	
4,091 % fällig am 08.07.2022		96		96	0,01												
Global Medical Response, Inc.																	
6,335 % fällig am 14.03.2025		100		98	0,01												
HCA, Inc.																	
3,844 % fällig am 18.03.2023		83		83	0,01												
4,094 % fällig am 13.03.2025		6		6	0,00												
Hilton Worldwide Finance LLC																	
3,841 % fällig am 25.10.2023		357		357	0,04												
iHeartCommunications, Inc.																	
TBD% fällig am 30.07.2019 ^		300		229	0,03												
TBD% - 9,052 % fällig am 30.01.2019 ^	1.375			1.054	0,12												
Las Vegas Sands, LLC																	
3,844 % fällig am 27.03.2025		99		99	0,01												
McDermott International, Inc.																	
7,094 % fällig am 12.05.2025		724		729	0,08												
MGM Growth Properties Operating Partnership LP																	
4,094 % fällig am 25.04.2023		68		68	0,01												
MH Sub LLC																	
5,835 % fällig am 13.09.2024		89		89	0,01												
Ministry of Finance and Economic Affairs																	
7,825 % fällig am 10.12.2019		200		200	0,02												
Multi Color Corp.																	
4,344 % fällig am 31.10.2024		13		13	0,00												
PetSmart, Inc.																	
5,010 % fällig am 11.03.2022		270		224	0,02												
Ply Gem Industries, Inc.																	
6,089 % fällig am 12.04.2025		200		200	0,02												











# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

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	
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	
Hokuhoku Financial Group, Inc.	12.000	\$ 159	0,02	<b>GESUNDHEITSWESEN</b>				Mitsui & Co. Ltd.	45.900	\$ 764	0,08	
Home Capital Group, Inc.	10.222	117	0,01	Anthem, Inc.	9.501	\$ 2.262	0,25	Mitsui E&S Holdings Co. Ltd.	9.100	119	0,01	
HSBC Holdings PLC	621.626	5.811	0,63	Bayer AG	9.910	1.088	0,12	Nippon Yusen KK	10.900	216	0,02	
IGM Financial, Inc.	1.934	56	0,01	Community Health Systems, Inc. (d)	70.232	233	0,02	Norfolk Southern Corp.	3.127	472	0,05	
Iyo Bank Ltd.	3.900	26	0,00	Daichi Sankyo Co. Ltd.	15.900	607	0,07	Obracon Huarte Lain S.A.	46.913	150	0,02	
JPMorgan Chase & Co.	42.609	4.440	0,48	Encompass Health Corp.	733	50	0,01	Oesterreichische Post AG	2.138	97	0,01	
Legal & General Group PLC	20.746	73	0,01	Getinge AB 'B'	5.231	48	0,01	Pitney Bowes, Inc.	31.538	270	0,03	
Loews Corp.	1.838	89	0,01	Gilead Sciences, Inc.	8.218	582	0,06	PostNL NV	30.887	116	0,01	
LPL Financial Holdings, Inc.	3.371	221	0,02	GlaxoSmithKline PLC	46.951	947	0,10	Rexel S.A.	11.849	170	0,02	
Mapfre S.A.	49.301	148	0,02	HCA Healthcare, Inc.	16.039	1.646	0,18	Rolls-Royce Holdings PLC	41.269	538	0,06	
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	336.800	1.907	0,21	Koninklijke Philips NV	22.501	953	0,10	Royal Mail PLC	62.150	414	0,05	
Mizrahi Tefahot Bank Ltd.	3.410	63	0,01	Merck & Co., Inc.	45.061	2.735	0,30	Ryder System, Inc.	2.876	207	0,02	
Mizuho Financial Group, Inc.	871.500	1.467	0,16	Pfizer, Inc.	155.963	5.658	0,61	Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA	9.981	150	0,02	
Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen	6.071	1.276	0,14	Primary Health Care Ltd.	55.877	144	0,02	Stagecoach Group PLC	40.777	76	0,01	
National Australia Bank Ltd.	46.990	953	0,10	Quest Diagnostics, Inc.	3.351	368	0,04	Sumitomo Corp.	43.700	716	0,08	
National Bank of Canada	6.588	316	0,03	Roche Holding AG	5.733	1.268	0,14	Toppa Printing Co. Ltd.	16.000	125	0,01	
Natixis S.A.	27.156	192	0,02	Sanofi	32.683	2.623	0,28	Toyota Tsusho Corp.	7.800	261	0,03	
Navient Corp.	45.909	598	0,06	Sonic Healthcare Ltd.	5.659	102	0,01	Trinity Industries, Inc.	6.166	211	0,02	
New York Community Bancorp, Inc.	7.488	83	0,01	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.	6.600	278	0,03	United Technologies Corp.	2.889	361	0,04	
Nordea Bank AB	51.353	493	0,05			21.592	2,35	WestJet Airlines Ltd.	9.574	132	0,01	
North Pacific Bank Ltd.	22.100	74	0,01	<b>RIEWERTE</b>								
Old Mutual Ltd. (d)	280.824	555	0,06	ABB Ltd.	5.415	118	0,01				20.321	2,21
ORIX Corp.	9.500	150	0,02	ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.	17.873	721	0,08	<b>RMATIONSTECHNOLOGIE</b>				
People's United Financial, Inc.	2.460	44	0,00	AGCO Corp.	3.170	192	0,02	Anritsu Corp.	3.300	45	0,01	
PNC Financial Services Group, Inc.	3.936	532	0,06	Aggreco PLC	4.292	38	0,00	Avnet, Inc.	5.805	249	0,03	
Poste Italiane SpA	105.595	881	0,10	Air New Zealand Ltd.	20.317	44	0,01	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	8.419	368	0,04	
Power Corp. of Canada	14.624	327	0,03	Alstom S.A.	5.197	238	0,03	CA, Inc.	10.254	366	0,04	
Power Financial Corp.	5.202	122	0,01	American Airlines Group, Inc.	7.116	270	0,03	Canon, Inc.	30.700	1.006	0,11	
Progressive Corp.	776	46	0,01	AP Moller - Maersk A/S 'B'	223	276	0,03	Corning, Inc.	21.967	604	0,07	
Quilter PLC (d)	93.608	179	0,02	Arcadis NV	2.314	42	0,00	Fujitsu Ltd.	136.000	823	0,09	
Raiffeisen Bank International AG	12.976	397	0,04	Asahi Glass Co. Ltd.	8.600	334	0,04	Gree, Inc.	18.300	98	0,01	
Ratos AB 'B'	11.115	37	0,00	BAE Systems PLC	14.295	122	0,01	GungHo Online Entertainment, Inc.	13.400	34	0,00	
Resona Holdings, Inc.	72.900	388	0,04	Bilfinger SE	3.773	191	0,02	Hitachi Ltd.	318.000	2.239	0,24	
Santander Consumer USA Holdings, Inc.	21.597	412	0,04	Bouygues S.A.	14.364	617	0,07	Ibiden Co. Ltd.	9.700	155	0,02	
SBI Holdings, Inc.	10.100	259	0,03	Caterpillar, Inc.	9.216	1.250	0,14	Intel Corp.	22.304	1.109	0,12	
SLM Corp. (d)	11.354	130	0,01	Cie de Saint-Gobain	11.903	530	0,06	International Business Machines Corp.	33.184	4.636	0,50	
Societe Generale S.A.	41.058	1.725	0,19	CSX Corp.	8.763	559	0,06	Jabil, Inc.	8.157	226	0,02	
Standard Chartered PLC	100.143	910	0,10	Cummins, Inc.	1.209	161	0,02	Kingboard Chemical Holdings Ltd.	34.000	124	0,01	
Standard Life Aberdeen PLC	10.705	46	0,01	Dai Nippon Printing Co. Ltd.	13.100	293	0,03	KLA-Tencor Corp.	2.364	242	0,03	
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	45.900	1.790	0,19	Deere & Co.	10.197	1.426	0,16	Konica Minolta, Inc.	11.900	110	0,01	
Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc.	13.100	517	0,06	Delta Air Lines, Inc.	2.024	100	0,01	Nippon Electric Glass Co. Ltd.	6.100	169	0,02	
Suncorp Group Ltd.	66.998	721	0,08	Deutsche Lufthansa AG	43.765	1.048	0,11	OKI Electric Industry Co. Ltd.	14.400	161	0,02	
Swiss Life Holding AG	1.805	624	0,07	Deutsche Post AG	6.594	214	0,02	Ricoh Co. Ltd.	81.200	743	0,08	
Swiss Re AG	12.745	1.110	0,12	Downer EDI Ltd.	45.749	229	0,03	Seagate Technology PLC	31.173	1.760	0,19	
T Rowe Price Group, Inc.	2.572	299	0,03	easyJet PLC	13.050	287	0,03	Symantec Corp.	20.913	432	0,05	
Talantx AG	4.795	175	0,02	Emerson Electric Co.	14.273	987	0,11	TE Connectivity Ltd.	3.192	288	0,03	
T&D Holdings, Inc.	22.800	342	0,04	Firstgroup PLC (d)	58.251	64	0,01	Venture Corp. Ltd.	5.900	77	0,01	
Talanx AG	42.675	68	0,01	Fluor Corp.	6.957	339	0,04	Western Digital Corp.	1.723	133	0,01	
TIG FinCo PLC (k)	12.828	1.569	0,17	Hino Motors Ltd.	2.900	31	0,00	Western Union Co.	22.886	465	0,05	
Travelers Cos., Inc.	10.732	537	0,06	Hitachi Construction Machinery Co. Ltd.	2.700	87	0,01	Xerox Corp.	15.907	382	0,04	
U.S. Bancorp	9.190	35	0,00	Hitachi Zosen Corp.	19.800	93	0,01				17.044	1,85
Unipol Gruppo Finanziario SpA				ITOCHU Corp.	33.400	604	0,07					
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	3.311	90	0,01	Japan Airlines Co. Ltd.	12.400	439	0,05	<b>TOFFE</b>				
Voya Financial, Inc.	17.736	834	0,09	Kanematsu Corp.	11.600	167	0,02	Asahi Kasei Corp.	3.300	42	0,00	
Wells Fargo & Co.	36.457	2.021	0,22	Kawasaki Heavy Industries Ltd.	7.500	220	0,02	BASF SE	15.125	1.444	0,16	
Westpac Banking Corp.	15.919	345	0,04	Keppel Corp. Ltd.	90.200	472	0,05	BHP Billiton Ltd.	80.726	2.017	0,22	
Yamaguchi Financial Group, Inc.	8.000	90	0,01	Komatsu Ltd.	7.500	213	0,02	CF Industries Holdings, Inc.	7.660	340	0,04	
Zurich Insurance Group AG	4.669	1.377	0,15	ManpowerGroup, Inc.	507	44	0,00	Cleveland-Cliffs, Inc. (d)	6.028	51	0,01	
				Marubeni Corp.	62.300	474	0,05	Denka Co. Ltd.	1.200	40	0,00	
				Mitsubishi Corp.	19.700	546	0,06	DIC Corp.	3.800	118	0,01	
				Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	18.600	676	0,07	Domtar Corp.	8.991	429	0,05	
								DowDuPont, Inc.	3.073	203	0,02	
								Eastman Chemical Co.	442	44	0,00	
								Evonik Industries AG	5.095	174	0,02	

BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES			PARI (000S)	% DES		
	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	GENS		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	GENS		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>	<b>AKTIEN</b>	<b>MARKT- WERT (000S)</b>	<b>% DES NETTO- VERMÖ- GENS</b>	<b>BESCHREIBUNG</b>	<b>AKTIEN</b>	<b>MARKT- WERT (000S)</b>	<b>% DES NETTO- VERMÖ- GENS</b>	<b>BESCHREIBUNG</b>	<b>MARKT- WERT (000S)</b>	<b>% DES NETTO- VERMÖ- GENS</b>	
Huntsman Corp.	2.730	\$ 80	0,01	CenterPoint Energy, Inc.	12.815	\$ 355	0,04	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
Icitech Pivot Ltd.	48.758	131	0,01	Centrica PLC	304.076	632	0,07	<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
International Paper Co.	6.268	326	0,04	Chugoku Electric Power Co., Inc.	23.700	306	0,03	Boston Scientific Corp.			
Israel Chemicals Ltd.	44.959	206	0,02	Consolidated Edison, Inc.	8.911	695	0,08	2.450 % fällig am 17.07.2018	\$ 900	\$ 899 0,10	
K+S AG	13.104	322	0,04	Contact Energy Ltd.	11.240	44	0,00	McKesson Corp.			
Kobe Steel Ltd.	18.200	166	0,02	Drax Group PLC	10.444	45	0,01	2.400 % fällig am 19.07.2018	3.500	3.495 0,38	
Kuraray Co. Ltd.	6.900	95	0,01	E.ON SE	35.403	377	0,04			4.394 0,48	
LyondellBasell Industries NV 'A'	15.247	1.675	0,18	EDP - Energias de Portugal S.A.	127.235	504	0,06				
Mitsubishi Materials Corp.	6.600	181	0,02	Electric Power Development Co. Ltd.	8.800	227	0,02	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (m)</b>			
Mosaic Co.	28.903	811	0,09	Electricite de France S.A.	81.196	1.114	0,12		2	0,00	
Navigator Co. S.A.	7.472	44	0,00	Endesa S.A.	26.826	590	0,06				
Nippon Paper Industries Co. Ltd.	2.500	40	0,00	Enel SpA	277.444	1.537	0,17	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
Nutrien Ltd.	7.256	395	0,04	Engie S.A.	41.148	629	0,07	(6,771)% fällig am 14.09.2018 (e)(f)	ARS 1.080	39 0,01	
Oji Holdings Corp.	43.000	266	0,03	Entergy Corp.	11.836	956	0,10	(4,791)% fällig am 14.09.2018 (e)(f)	770	28 0,00	
OZ Minerals Ltd.	6.452	45	0,01	Exelon Corp.	31.651	1.348	0,15	(4,684)% fällig am 14.09.2018 (e)(f)	1.540	56 0,01	
Rio Tinto PLC	6.296	347	0,04	FirstEnergy Corp.	25.525	917	0,10	(3,506)% fällig am 14.09.2018 (e)(f)	330	12 0,00	
Showa Denko KK	6.900	305	0,03	Fortum Oyj	9.049	216	0,02	(3,361)% fällig am 14.09.2018 (e)(f)	300	11 0,00	
Stora Enso Oyj 'R'	17.772	346	0,04	Hokuriku Electric Power Co.	28.300	284	0,03	(3,154)% fällig am 14.09.2018 (e)(f)	150	5 0,00	
Teck Resources Ltd. 'B'	2.633	67	0,01	Innogy SE	1.400	60	0,01	(2,677)% fällig am 12.10.2018 (e)(f)	4.430	157 0,02	
Ube Industries Ltd.	4.500	117	0,01	Just Energy Group, Inc.	6.168	22	0,00	(0,500)% fällig am 14.09.2018 (e)(f)	20.100	731 0,08	
Yara International ASA	9.129	377	0,04	Osaka Gas Co. Ltd.	2.000	41	0,00	0,576 % fällig am 14.09.2018 (e)(f)	100	4 0,00	
				Pinnacle West Capital Corp.	2.150	173	0,02	1,154 % fällig am 14.09.2018 (e)(f)	100	4 0,00	
		11.244	1,22	PPL Corp.	11.276	322	0,04	1,298 % fällig am 24.08.2018 (e)(f)	\$ 100	99 0,01	
<b>IMMOBILIEN</b>				Public Service Enterprise Group, Inc.	12.330	668	0,07	1,855 % fällig am 14.09.2018 (e)(f)	70	69 0,01	
China South City Holdings Ltd.	264.000	51	0,01	RWE AG	58.359	1.326	0,14	2,830 % fällig am 13.07.2018 (e)(f)	584	583 0,06	
Kerry Properties Ltd.	56.000	268	0,03	SCANA Corp.	3.889	150	0,02	3,154 % fällig am 26.10.2018 (e)(f)	32	32 0,00	
New World Development Co. Ltd.	59.000	82	0,01	Severn Trent PLC	1.768	46	0,01	3,223 % fällig am 12.10.2018 (e)(f)	ARS 300	11 0,00	
Nomura Real Estate Holdings, Inc.	6.600	146	0,01	Tohoku Electric Power Co., Inc.	7.800	95	0,01	3,586 % fällig am 12.10.2018 (e)(f)	300	11 0,00	
Shimao Property Holdings Ltd.	140.500	366	0,04	Tokyo Gas Co. Ltd.	9.700	257	0,03	25,500 % fällig am 14.09.2018 (e)(f)	3.800	122 0,01	
Swire Pacific Ltd. 'A'	48.500	513	0,05	TransAlta Corp.	25.420	128	0,01	25,600 % fällig am 14.09.2018 (e)(f)	28.200	903 0,10	
Wheelock & Co. Ltd.	25.000	174	0,02	Vistra Energy Corp. (d)	10.972	260	0,03	25,601 % fällig am 14.09.2018 (e)(f)	4.528	145 0,02	
		1.600	0,17					8.500	270 0,03		
						15.215	1,65			3.292 0,36	
						225.681	24,53				
<b>TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				<b>RECHTE</b>				<b>GREECE TREASURY BILLS</b>			
AT&T, Inc.	42.384	1.361	0,15	ACS Actividades de				0,603 % fällig am 10.08.2018 (e)(f)	€ 430	502 0,05	
Bezeq The Israeli Telecommunication Corp. Ltd.	161.200	181	0,02	Construccion y Servicios S.A. - Exp. 11.07.2018	17.873	18	0,00	0,706 % fällig am 02.11.2018 (e)(f)	560	652 0,07	
CenturyLink, Inc.	67.204	1.253	0,14	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				1,082 % fällig am 05.10.2018 (e)(f)	625	728 0,08	
Frontier Communications Corp.	72.324	388	0,04	Volkswagen AG	9.470	1.564	0,17	1,267 % fällig am 15.03.2019 (e)(f)	1.068	1.238 0,14	
Koninklijke KPN NV	15.087	41	0,00							3.120 0,34	
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	32.000	1.453	0,16	<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>				<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
NTT DOCOMO, Inc.	3.900	99	0,01	AGNC Investment Corp.	10.028	187	0,02	(0,141)% fällig am 06.08.2018 (e)(f)	¥ 2.380.000	21.490 2,33	
Orange S.A.	64.301	1.073	0,12	Annaly Capital Management, Inc.	29.766	306	0,03	Summe kurzfristige Instrumente		32.298 3,51	
Proximus S.A.	6.902	155	0,02	Artis Real Estate Investment Trust	9.251	92	0,01				
Swisscom AG	451	201	0,02	Cominar Real Estate Investment Trust	17.754	173	0,02	<b>AKTIEN</b>			
Tele2 AB 'B'	35.010	410	0,04	CoreCivic, Inc.	11.894	284	0,03	<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
Telefonica S.A.	100.766	855	0,09	Dream Office Real Estate Investment Trust	11.523	205	0,02	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO			
Telenor ASA	11.417	234	0,03	Granite Point Mortgage Trust, Inc.	2.445	45	0,01	US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	2.359.149	23.622 2,57	
Telephone & Data Systems, Inc.	6.543	179	0,02	Hospitality Properties Trust	2.247	64	0,01	Summe Übertragbare Wertpapiere und			
Telia Co. AB	100.742	460	0,05	Iron Mountain, Inc.	3.670	129	0,01	Geldmarktinstrumente – Amtliche			
Telstra Corp. Ltd.	245.842	475	0,05	Two Harbors Investment Corp.	3.377	53	0,01	Börse/Geregelter Markt	\$ 986.352	107,22	
VEON Ltd. ADR	104.454	249	0,03	VICI Properties, Inc. (k)	114.584	2.365	0,26				
Verizon Communications, Inc.	61.324	3.085	0,33								
Vodafone Group PLC	613.512	1.487	0,16								
Windstream Holdings, Inc.	16.950	89	0,01								
						3.903	0,43				
		13.728	1,49								
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>											
American Electric Power Co., Inc.	8.142	564	0,06								
Atco Ltd. 'I'	7.134	220	0,02								
Capital Power Corp.	5.601	107	0,01								

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income 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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	52	\$ 81	0,01	
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	2	(3)	0,00	
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	1.040	880	0,09	
				\$ 958	0,10	
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>					<b>\$ 958</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.

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.12.2022	\$ 600	\$ (19)	0,00
Chesapeake Energy Corp.	5,000	20.12.2018	10	0	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2022	€ 1.400	(4)	0,00
				\$ (23)	0,00

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-30 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2023	\$ 4.700	\$ 13	0,00

## 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.EM-28 5-Year Index	1,000 %	20.12.2022	\$ 1.940	\$ 17	0,00
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000	20.06.2023	9.300	(183)	(0,02)
CDX.HY-23 5-Year Index	5,000	20.12.2019	1.880	(5)	0,00
CDX.HY-25 5-Year Index	5,000	20.12.2020	18.240	(3)	0,00
CDX.HY-30 5-Year Index	5,000	20.06.2023	12.850	(18)	0,00
				\$ (192)	(0,02)

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,000 %	04.01.2021	BRL 100	\$ 0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,030	02.01.2025	4.300	(42)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,230	04.01.2021	5.000	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,255	02.01.2025	800	(8)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,810	04.01.2021	980	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	15,590	04.01.2021	520	(2)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	16,400	04.01.2021	190	(1)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	\$ 31.700	131	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2024	10.900	(11)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	20.900	590	0,06
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	19.09.2023	ZAR 86.800	191	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	19.09.2028	78.300	(238)	(0,03)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,000	15.03.2024	5.100	(4)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,250	15.03.2024	22.800	(14)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD 4.000	(19)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	17.12.2019	400	(2)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	18.640	(75)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024	1.600	(11)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025	19.492	(163)	(0,02)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2023	410	(3)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024	650	(8)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	18.06.2024	400	(6)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	€ 6.200	(145)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	£ 7.900	(132)	(0,02)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	¥ 1.290.000	(110)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	21.03.2028	230.000	(27)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,301	13.02.2028	50.000	(5)	0,00

Zahlung/ Erhalt/ variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,351 %	08.02.2028	¥ 620.000	\$ (50)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,354	18.01.2028	210.000	(19)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,354	16.02.2028	210.000	(17)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,380	18.06.2028	160.000	(16)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,399	18.06.2028	30.000	(3)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,400	27.03.2029	160.000	(7)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,415	25.03.2029	80.000	(4)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,446	18.06.2029	140.000	(14)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	10.021.000	(517)	(0,06)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	29.03.2029	160.000	(7)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,471	18.06.2029	140.000	(14)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,095	05.02.2021	MXN 28.800	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,145	02.04.2020	900	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,270	05.02.2020	2.000	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,430	17.11.2021	2.900	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,610	07.07.2021	4.200	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,615	21.05.2021	12.600	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,680	28.05.2021	4.800	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,780	29.09.2022	12.930	(9)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,795	02.06.2023	3.600	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,798	06.09.2021	20.000	(11)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,810	02.05.2022	1.200	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,850	02.05.2022	5.300	(4)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,900	20.07.2021	24.700	(14)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,950	30.01.2026	12.300	(14)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,980	26.08.2024	500	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,990	30.01.2026	15.000	(17)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,080	10.03.2026	20.700	(24)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,350	01.09.2023	3.300	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,490	08.09.2026	13.700	(19)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,620	18.02.2030	600	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,710	20.09.2029	500	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,750	31.08.2021	7.900	(7)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,150	11.06.2027	28.100	(50)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,165	06.09.2032	3.000	(7)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,199	03.12.2021	300	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,200	11.06.2027	2.900	(5)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,350	17.11.2021	2.300	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,360	21.08.2037	3.100	(9)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,370	11.10.2027	14.800	(28)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,380	04.11.2026	400	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,380	14.08.2037	700	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,388	17.11.2021	1.800	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,480	18.06.2037	1.300	(4)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,520	18.04.2023	30.200	(20)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,530	18.04.2023	24.900	(17)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,530	21.04.2023	3.100	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,538	23.02.2022	9.800	(12)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,545	18.04.2023	19.100	(13)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,603	14.04.2025	49.000	(42)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,610	23.01.2023	18.100	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,610	15.04.2025	3.000	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,640	03.01.2023	2.200	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,645	03.01.2023	4.900	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,670	05.03.2025	52.900	(30)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,700	02.05.2023	7.100	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,710	07.03.2025	6.400	(4)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,715	07.03.2025	6.300	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,745	05.01.2023	3.400	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,800	28.12.2027	2.900	2	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,805	06.02.2023	7.800	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,818	17.02.2027	11.400	(22)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,820	06.02.2023	7.900	1	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,865	27.12.2022	5.000	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,865	02.02.2027	11.900	(24)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,875	16.12.2022	2.800	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,880	27.12.2022	79.700	(37)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,910	30.12.2027	600	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,984	10.12.2027	6.800	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,990	21.12.2027	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,005	21.12.2027	37.500	23	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,010	04.02.2027	5.200	(11)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,030	31.01.2028	4.600	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,050	31.01.2028	3.400	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,090	15.01.2027	13.000	(27)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,103	04.01.2038	5.600	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,120	15.01.2027	2.700	(6)	0,00
					\$ (1.296)	(0,14)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (1.498)	(0,16)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

- (1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

### FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettöver- mögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800 %	18.07.2018	\$ 18.200	\$ (20)	\$ (5)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.08.2018	13.800	(14)	(9)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	103,000	19.09.2018	1.800	(8)	(10)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	101,000	21.11.2018	1.600	(18)	(12)	(0,01)
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.08.2018	6.800	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	1.000	(2)	0	0,00
CBK	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	101,000	17.10.2018	1.600	(8)	(9)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	7.800	(9)	(3)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.08.2018	4.500	(5)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	900	(1)	(1)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	2.000	(3)	0	0,00
	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	102,000	19.09.2018	1.600	(16)	(7)	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	1.600	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	104,500	19.09.2018	300	(2)	(3)	0,00
						\$ (112)	\$ (67)	(0,01)

#### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettöver- mögens
UBS	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,287	20.09.2018	£ 900	\$ (8)	\$ (6)	0,00

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettöver- mögens	
FBF	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2048	\$ 101,039	05.07.2018	\$ 5.000	\$ (21)	\$ (47)	(0,01)	
SAL	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	99,781	06.08.2018	3.000	(6)	0	0,00	
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	99,859	06.08.2018	6.000	(12)	(1)	0,00	
SAL	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	101,359	06.08.2018	4.600	(14)	(28)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	101,781	06.08.2018	3.000	(6)	(10)	0,00	
SAL	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	101,859	06.08.2018	6.000	(11)	(18)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	102,289	06.08.2018	4.500	(11)	(6)	0,00	
SAL	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048	102,648	06.08.2018	2.300	(6)	(1)	0,00	
	Call - OTC Fannie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2048							
						\$ (87)	\$ (111)	(0,01)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettöver- mögens
BOA	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.12.2022	\$ 200	\$ 1	\$ (2)	\$ (1)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2022	100	(2)	2	0	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2020	50	(4)	4	0	0,00
BPS	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	200	(8)	7	(1)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2019	5	(1)	1	0	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	200	0	(1)	(1)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2019	15	(1)	1	0	0,00
CBK	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2020	50	(4)	4	0	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	5.140	(169)	(142)	(311)	(0,04)
DUB	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	100	0	0	0	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.000	(9)	(6)	(15)	0,00
GST	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2018	500	3	(1)	2	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2020	300	(23)	23	0	0,00
GST	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2022	186	0	(2)	(2)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	300	(12)	(10)	(22)	0,00
GST	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	400	(4)	(2)	(6)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2021	13	(4)	3	(1)	0,00

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
HUS	Russia Government International Bond	1,000 %	20.06.2020	\$ 900	\$ (104)	\$ 106	\$ 2	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	3.920	(86)	34	(52)	(0,01)
	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.12.2018	200	2	1	3	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	0	0	0	0	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	300	(19)	(3)	(22)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	150	1	(2)	(1)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	8.200	(72)	(51)	(123)	(0,01)
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2019	175	(16)	14	(2)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.09.2020	20	(3)	3	0	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2019	140	(6)	6	0	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2020	80	(6)	6	0	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2024	140	(14)	9	(5)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	4	(1)	1	0	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2019	250	(22)	19	(3)	0,00
JPM	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2020	600	(48)	48	0	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2019	250	(22)	19	(3)	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	100	0	0	0	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2023	2.800	(53)	1	(52)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.03.2018	4.600	(96)	(91)	(187)	(0,02)
					\$ (780)	\$ (20)	\$ (800)	(0,09)

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
BOA	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110 %	25.05.2046	\$ 840	\$ (166)	\$ 100	\$ (66)	(0,01)
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	400	(18)	20	2	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	2.200	(138)	145	7	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	887	(13)	19	6	0,00
	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17.01.2047	1.100	(31)	38	7	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(5)	5	0	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	16.000	(8)	(63)	(71)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	13.800	(71)	(57)	(128)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	4.139	22	5	27	0,01
	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17.01.2047	2.000	(68)	80	12	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	6.400	(361)	381	20	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	300	(12)	12	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	200	(11)	12	1	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	600	(47)	47	0	0,00
MYC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	1.228	(240)	144	(96)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	1.971	(45)	58	13	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	1.000	(4)	0	(4)	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	15.500	15	(21)	(6)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	6	0	0,00
					\$ (1.220)	\$ 942	\$ (278)	(0,03)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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
BOA	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR	\$ 1.000	20.09.2018	\$ (6)	\$ (2)	\$ (8)	0,00
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR	300	20.09.2018	(1)	0	(1)	0,00
FBF	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR	100	20.09.2018	(1)	0	(1)	0,00
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR	700	20.09.2018	(4)	0	(4)	0,00
GST	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	500	20.09.2018	0	6	6	0,00
JPM	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR	600	20.09.2018	(3)	1	(2)	0,00
							\$ (15)	\$ 5	\$ (10)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BOA	07/2018	\$ 12.719	AUD 17.230	\$ 11	\$ 0	\$ 11	0,00
	08/2018	AUD 17.230	\$ 12.720	0	(11)	(11)	0,00
	08/2018	€ 2.887	SEK 29.976	0	(20)	(20)	0,00
BPS	08/2018	¥ 2.380.000	\$ 21.837	302	0	302	0,03
	09/2018	\$ 1.045	RUB 65.415	0	(9)	(9)	0,00
	07/2018	ARS 7.821	\$ 334	63	0	63	0,01
BRC	07/2018	DKK 26.147	\$ 3.914	0	(184)	(184)	(0,02)
	07/2018	¥ 3.339.205	30.745	598	0	598	0,06
	07/2018	\$ 321	ARS 8.667	0	(24)	(24)	0,00
CBK	07/2018	1.609	PEN 5.266	0	(2)	(2)	0,00
	09/2018	PEN 5.266	\$ 1.605	2	0	2	0,00
	09/2018	\$ 158	AUD 205	0	(6)	(6)	0,00
DUB	07/2018	£ 96	\$ 126	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	\$ 13.526	MXN 257.943	0	(515)	(515)	(0,06)
	09/2018	AUD 230	\$ 179	9	0	9	0,00
GLM	09/2018	\$ 158	AUD 205	0	(6)	(6)	0,00
	07/2018	ARS 740	\$ 34	9	0	9	0,00
	07/2018	DKK 2.520	419	24	0	24	0,00
HUS	07/2018	£ 32.378	42.897	150	0	150	0,02
	07/2018	\$ 705	£ 525	0	(12)	(12)	0,00
	07/2018	370	RUB 23.427	3	0	3	0,00
JPM	08/2018	MXN 8.217	\$ 413	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	\$ 711	MXN 14.485	23	(3)	20	0,00
	07/2018	356	ARS 9.923	0	(12)	(12)	0,00
MSB	07/2018	AUD 21.955	\$ 16.505	283	0	283	0,03
	07/2018	CHF 1.761	1.783	9	0	9	0,00
	07/2018	€ 555	654	6	0	6	0,00
RBC	07/2018	\$ 205	RUB 12.824	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	10.765	TRY 47.965	0	(487)	(487)	(0,05)
	07/2018	€ 1.064	\$ 1.233	0	(10)	(10)	0,00
SCX	07/2018	RUB 132.282	2.099	0	(9)	(9)	0,00
	07/2018	\$ 1.502	RUB 96.031	28	0	28	0,00
	08/2018	7.111	446.162	9	(43)	(34)	0,00
SSB	09/2018	2.187	INR 150.782	0	(9)	(9)	0,00
	07/2018	ARS 1.362	\$ 63	16	0	16	0,00
	07/2018	\$ 3.519	AUD 4.725	0	(28)	(28)	0,00
TOR	07/2018	60	DKK 392	1	0	1	0,00
	08/2018	AUD 9.450	\$ 7.150	167	0	167	0,02
	07/2018	PEN 5.266	1.612	5	0	5	0,00
UAG	07/2018	\$ 524	BRL 1.973	0	(11)	(11)	0,00
	08/2018	BRL 1.973	\$ 522	11	0	11	0,00
	09/2018	AUD 227	176	9	0	9	0,00
MSB	07/2018	£ 1.024	1.348	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	BRL 1.973	538	25	0	25	0,00
	07/2018	€ 38.737	44.875	0	(352)	(352)	(0,04)
SSB	08/2018	NZD 6.756	4.711	137	0	137	0,01
	08/2018	\$ 387	ZAR 4.896	0	(31)	(31)	0,00
	07/2018	45.740	€ 39.292	136	0	136	0,01
TOR	08/2018	€ 39.292	\$ 45.842	0	(134)	(134)	(0,01)
	08/2018	\$ 1.632	¥ 177.978	0	(21)	(21)	0,00
	07/2018	30.392	3.339.205	0	(258)	(258)	(0,03)
UAG	08/2018	¥ 3.339.205	\$ 30.455	260	0	260	0,03
	07/2018	\$ 43.472	£ 32.877	0	(66)	(66)	(0,01)
	08/2018	£ 32.877	\$ 43.533	68	0	68	0,01
	09/2018	198	262	0	0	0	0,00
				\$ 2.364	\$ (2.271)	\$ 93	0,01

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
AZD	07/2018	AUD 6.447	4.852	\$ 89	\$ 0	\$ 89	0,01
	07/2018	5.518	6.395	9	(56)	(47)	(0,01)
	07/2018	\$ 1.049	€ 897	1	(3)	(2)	0,00
BOA	07/2018	4.759	AUD 6.447	4	0	4	0,00
	07/2018	254.589	€ 216.885	0	(1.365)	(1.365)	(0,15)
	08/2018	AUD 6.447	\$ 4.760	0	(4)	(4)	0,00
BPS	07/2018	€ 144	168	0	0	0	0,00
	07/2018	¥ 2.186.243	20.129	392	0	392	0,04
	08/2018	ZAR 7.884	618	45	0	45	0,01
BRC	09/2018	INR 14.360	210	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 230	€ 195	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	CAD 8.743	\$ 6.716	69	0	69	0,01
CBK	07/2018	CHF 5.603	5.673	30	0	30	0,00
	07/2018	£ 10.835	14.354	50	0	50	0,01
	07/2018	SEK 5.163	586	9	0	9	0,00
MSB	07/2018	€ 244.351	282.226	0	(3.067)	(3.067)	(0,33)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens		
NAB	08/2018	\$ 282.848	€ 244.351	\$ 3.064	\$ 0	\$ 3.064	0,33		
	07/2018	6.573	CAD 8.743	73	0	73	0,01		
	08/2018	CAD 8.743	\$ 6.577	0	(73)	(73)	(0,01)		
RBC	07/2018	DKK 1.002	167	10	0	10	0,00		
	07/2018	\$ 367	€ 310	0	(5)	(5)	0,00		
SCX	07/2018	282.121	243.533	2.216	0	2.216	0,24		
	07/2018	580	SEK 5.163	0	(3)	(3)	0,00		
	08/2018	SEK 5.163	\$ 581	3	0	3	0,00		
	09/2018	KRW 1.297.248	1.207	39	0	39	0,01		
SSB	07/2018	€ 243.089	282.980	0	(839)	(839)	(0,09)		
	07/2018	\$ 287.108	€ 246.715	960	(15)	945	0,10		
	08/2018	283.608	243.089	827	0	827	0,09		
TOR	07/2018	1.934	1.661	10	(6)	4	0,00		
	07/2018	19.898	¥ 2.186.243	0	(192)	(192)	(0,02)		
	08/2018	¥ 2.186.243	\$ 19.939	193	0	193	0,02		
UAG	07/2018	\$ 14.326	£ 10.835	0	(22)	(22)	0,00		
	08/2018	£ 10.835	\$ 14.346	22	0	22	0,00		
	09/2018	HKD 7.057	901	1	0	1	0,00		
						\$ 8.118	\$ (5.652)	\$ 2.466	0,27
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								\$ 1.287	0,14
Summe Anlagen								\$ 987.099	107,30
Sonstige Aktiva und Passiva								\$ (67.178)	(7,30)
Nettovermögen								\$ 919.921	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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(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) 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:

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettover- mögens
TIG FinCo PLC	06.04.2015 - 27.07.2017	\$ 59	\$ 68	0,01
VICI Properties, Inc.	08.01.2015 - 20.11.2017	1.556	2.365	0,26
		\$ 1.615	\$ 2.433	0,27

(l) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.234 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 8.010 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 7.434 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(m) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsge- schäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettover- mögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 2	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.01.2022	\$ (5)	\$ 2	\$ 2	0,00
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (5)	\$ 2	\$ 2	0,00

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 138.801	\$ 847.222	\$ 329	\$ 986.352
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	958	(211)	0	747
<b>Summen</b>	<b>\$ 139.759</b>	<b>\$ 847.011</b>	<b>\$ 329</b>	<b>\$ 987.099</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 99.370	\$ 709.468	\$ 607	\$ 809.445
Einlagen bei Kreditinstituten	0	4.505	0	4.505
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(74)	3.496	0	3.422
Leerverkäufe	0	(4.900)	0	(4.900)
<b>Summen</b>	<b>\$ 99.296</b>	<b>\$ 712.569</b>	<b>\$ 607</b>	<b>\$ 812.472</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 der Wertpapieranlagen.

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

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BCY	(0,250) %	14.03.2018	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (2.185)	\$ (2.183)	(0,24)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (2.183)</b>	<b>(0,24)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 40	\$ 0	\$ 40
BOA	(1.182)	3.790	2.608
BPS	860	(710)	150
BRC	(516)	800	284
DUB	2	0	2
FBF	(39)	140	101
GLM	(190)	290	100
GST	(220)	0	(220)
HUS	(184)	420	236
JPM	150	0	150
MEI	1	0	1
MSB	11	0	11
MYC	(325)	24	(301)
RBC	1	0	1
SAL	(74)	0	(74)
SCX	2.034	(150)	1.884
SSB	914	1.890	2.804
TOR	7	0	7
UAG	3	0	3
UBS	(6)	0	(6)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	67,73	59,29
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	27,36	35,34
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	12,13	8,41
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,16)	(0,08)
Freiverkehrsfinaanzderivate	0,14	0,53
Einlagenzertifikate	0,00	0,57
Leerverkaufte Wertpapiere	0,00	(0,62)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,24)	0,00

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Strategic Income Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	37.965.735	\$ 380.118	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	36.146.042	\$ 361.900
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,625 % fällig am 31.03.2025	\$ 42.700	42.412	2,625 % fällig am 31.03.2025	\$ 10.200	10.045
Japan Treasury Bills			U.S. Treasury Notes		
0,000 % fällig am 01.05.2018	¥ 4.080.000	37.496	2,750 % fällig am 28.02.2025	9.300	9.277
Japan Treasury Bills			U.S. Treasury Notes		
0,000 % fällig am 06.08.2018	2.380.000	21.647	2,250 % fällig am 31.10.2024	9.000	8.689
Japan Treasury Bills			Australia & New Zealand Banking Group Ltd.		
0,000 % fällig am 07.05.2018	1.370.000	12.530	4,165 % fällig am 19.06.2023	AUD 4.200	3.118
Japan Treasury Bills			Central Nippon Expressway Co. Ltd.		
0,000 % fällig am 21.05.2018	1.090.000	10.133	2,091 % fällig am 14.09.2021	\$ 2.800	2.691
U.S. Treasury Notes			Deutsche Bank AG		
2,750 % fällig am 28.02.2025	\$ 9.300	9.252	4,250 % fällig am 14.10.2021	2.670	2.673
Goldman Sachs Group, Inc.			U.S. Treasury Notes		
3,680 % fällig am 08.08.2018	AUD 9.450	7.164	2,500 % fällig am 31.01.2025	2.600	2.553
U.S. Capital Funding Ltd.			U.S. Treasury Notes		
2,617 % fällig am 10.07.2043	\$ 7.371	6.265	2,125 % fällig am 29.02.2024	2.100	2.024
Deutsche Bank AG			U.S. Treasury Notes		
0,375 % fällig am 18.01.2021	€ 4.100	4.888	2,375 % fällig am 15.05.2027	2.100	2.012
Aroundtown S.A.			Barclays PLC		
1,625 % fällig am 31.01.2028	3.800	4.572	3,125 % fällig am 17.01.2024	£ 1.300	1.831
QNB Finance Ltd.			U.S. Treasury Notes		
3,705 % fällig am 12.02.2020	\$ 4.400	4.400	2,125 % fällig am 31.07.2024	\$ 1.900	1.830
BNP Paribas S.A.					
3,375 % fällig am 09.01.2025	3.558	3.552	<b>AKTIEN</b>	189.070	1.806
Saudi Government International Bond					
4,000 % fällig am 17.04.2025	3.500	3.468	<b>PARI (000S)</b>		
AREIT Trust					
5,173 % fällig am 15.02.2035	3.200	3.200	Federal Home Loan Bank		
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.			1,327 % fällig am 28.02.2018	\$ 1.600	1.598
4,165 % fällig am 19.06.2023	AUD 4.200	3.191	Federal Home Loan Bank		
QNB Finance Ltd.			0,000 % fällig am 02.05.2018	1.600	1.594
3,713 % fällig am 07.02.2020	\$ 3.100	3.100			
Santander UK Group Holdings PLC			<b>AKTIEN</b>	13.248	1.469
3,373 % fällig am 05.01.2024	3.000	3.000	Banco Santander S.A.	145.475	948
Japan Treasury Bills					
0,000 % fällig am 14.05.2018	¥ 300.000	2.789	<b>PARI (000S)</b>		
U.S. Treasury Notes					
2,500 % fällig am 31.01.2025	\$ 2.800	2.749	Petrobras Global Finance BV		
			6,125 % fällig am 17.01.2022	\$ 858	907
			<b>AKTIEN</b>	24.663	885
			Pfizer, Inc.	39.732	882
			BHP Billiton Ltd.		

(a) Der Strategic Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.











## 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 Euribor December Futures	Long	12/2018	1.070	\$ 68	0,00
3-Month Euribor September Futures	Long	09/2018	4.154	304	0,01
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2019	447	119	0,00
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2020	726	(179)	0,00
90-Day Eurodollar June Futures	Short	06/2020	2.023	489	0,01
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03/2020	1.808	463	0,01
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09/2020	1.385	(59)	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	1.959	(1.962)	(0,03)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 152,000 EUR auf Euro-BTP 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	450	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 166,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	1.000	(1)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 168,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	671	(1)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	600	(1)	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	822	(1.773)	(0,03)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	434	607	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09/2018	651	(2.637)	(0,05)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	2.615	(5.950)	(0,10)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 144,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	1.000	(1)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 145,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Long	08/2018	1.981	(2)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 160,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	600	199	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 161,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2018 Futures	Short	07/2018	460	50	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	6.644	(1.797)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2018	4.811	3.682	0,06
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09/2018	5.254	(19.765)	(0,34)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09/2018	645	1.989	0,03
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	232	(354)	(0,01)
				\$ (26.512)	(0,46)

## OPTIONSKAUF

## OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	\$ 106,000	24.08.2018	124	\$ 1	\$ 0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	106,250	24.08.2018	1.518	13	1	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	106,500	24.08.2018	2.245	19	2	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	106,750	24.08.2018	1.684	14	2	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	107,000	24.08.2018	670	6	1	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	107,250	24.08.2018	826	7	1	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	106,500	24.08.2018	2.000	17	2	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	107,000	24.08.2018	3.122	27	3	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	107,500	24.08.2018	1.873	16	2	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	108,000	24.08.2018	937	8	1	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	108,500	24.08.2018	373	3	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	136,000	24.08.2018	769	6	1	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	170,000	24.08.2018	46	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	173,000	24.08.2018	345	3	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	174,000	24.08.2018	1.624	13	2	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	175,000	24.08.2018	3.121	27	3	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2018 Futures	181,000	24.08.2018	38	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2018 Futures	110,000	24.08.2018	549	5	1	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2018 Futures	112,000	24.08.2018	235	2	0	0,00
Call - MSE Canada Government 10-Year Bond September 2018 Futures	CAD 156,000	17.08.2018	150	2	1	0,00
Call - MSE Canada Government 10-Year Bond September 2018 Futures	158,000	17.08.2018	818	8	3	0,00
				\$ 197	\$ 26	0,00

## VERKAUFSoPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 119,500	27.07.2018	493	\$ (100)	\$ (92)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (26.578)	(0,46)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond 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
Carrefour	1,000 %	20.06.2023	€ 13.350	\$ (33)	0,00
Citigroup, Inc.	1,000	20.12.2020	\$ 13.100	(50)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2022	2.700	(41)	0,00
JPMorgan Chase & Co.	1,000	20.12.2020	10.000	(37)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2022	€ 6.700	191	0,00
				\$ 30	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.HY-30 5-Year Index	5,000 %	20.06.2023	\$ 24.900	\$ (33)	0,00
CDX.IG-30 5-Year Index	1,000	20.06.2023	421.800	(371)	(0,01)
				\$ (404)	(0,01)

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,500 %	02.01.2020	BRL 1.580.750	\$ (3.156)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,750	02.01.2020	373.700	(263)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,660	04.01.2021	89.400	(103)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,040	02.01.2023	94.900	(346)	(0,01)
Erhalt	3-Month CAD Bank Bill	1,750	16.12.2046	CAD 5.200	(36)	0,00
Erhalt	3-Month CAD Bank Bill	2,700	19.12.2024	28.200	464	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,958	05.12.2019	\$ 372.900	(4.009)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	74.000	280	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027	160.800	10.278	0,18
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	€ 180.800	1.784	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.12.2028	14.400	202	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.09.2048	20.800	417	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,613	04.07.2042	29.100	1.313	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,623	04.07.2042	23.300	1.108	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,624	04.07.2042	53.900	2.584	0,05
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	£ 130.700	(1.242)	(0,02)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	71.200	(1.261)	(0,02)
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.12.2048	34.200	1.352	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	24.700	265	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.03.2026	¥58.230.000	(111)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	4.250.000	31	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	3.540.000	(350)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,380	18.06.2028	400.000	(40)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,399	18.06.2028	1.580.000	(158)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	2.470.000	(58)	0,00
					\$ 8.945	0,16
					\$ 8.571	0,15

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

### OPTIONSKAUF

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Kauf	1,250 %	18.07.2018	\$ 50.000	\$ 7	\$ 2	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,930 %	20.08.2018	\$ 14.500	\$ 1.539	\$ 339	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,940	20.08.2018	12.700	1.242	281	(0,01)
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,943	12.12.2019	5.200	250	342	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,905	20.08.2018	12.500	1.250	333	0,01
							\$ 4.281	\$ 1.295	0,02

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 69,000	05.07.2018	\$ 314.000	\$ 12	\$ 0	0,00
SAL	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2048	70,000	06.09.2018	296.000	12	0	0,00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2048	78,000	06.09.2018	314.000	12	0	0,00
					\$ 36	\$ 0	0,00

## VERKAUFSOPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.07.2018	\$ 12.700	\$ (17)	\$ (4)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	8.700	(8)	(3)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	15.300	(27)	(2)	0,00
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	8.700	(8)	(3)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	12.700	(13)	(3)	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	5.700	(5)	(2)	0,00
						\$ (78)	\$ (17)	0,00

## DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens	
BPS	Call - OTC USD versus RUB	RUB 66,400	24.08.2018	\$ 13.600	\$ (114)	\$ (87)	0,00	
CBK	Call - OTC USD versus RUB	66,490	17.08.2018	15.200	(140)	(79)	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	66,550	17.08.2018	15.200	(145)	(78)	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	67,400	17.08.2018	11.700	(110)	(44)	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	66,190	24.08.2018	11.800	(98)	(81)	0,00	
DUB	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,326	13.07.2018	£ 15.030	(96)	(157)	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	RUB 66,090	27.08.2018	\$ 11.800	(104)	(89)	0,00	
GLM	Call - OTC USD versus MXN	MXN 21,940	16.08.2018	12.450	(120)	(25)	0,00	
	Call - OTC USD versus MXN	21,920	21.08.2018	12.450	(124)	(29)	0,00	
JPM	Call - OTC USD versus MXN	21,200	05.07.2018	16.576	(144)	(2)	0,00	
	Call - OTC USD versus MXN	20,500	06.07.2018	11.100	(128)	(22)	0,00	
MSB	Call - OTC USD versus MXN	19,500	21.08.2018	27.250	(449)	(868)	(0,02)	
	Call - OTC USD versus MXN	21,250	11.07.2018	5.024	(48)	(3)	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	RUB 66,383	02.07.2018	21.300	(184)	0	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	66,600	09.07.2018	23.700	(222)	(6)	0,00	
RYL	Call - OTC USD versus MXN	MXN 19,250	19.07.2018	27.250	(402)	(860)	(0,02)	
WST	Put - OTC AUD versus USD	\$ 0,722	20.08.2018	AUD 72.900	(312)	(285)	(0,01)	
						\$ (2.940)	\$ (2.715)	(0,05)

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Floor - OTC CPURNSA	\$ 215,949	Maximal [(1 + 0,000 %) <sup>10</sup> - (Index Final/Index Initial)] oder 0	12.03.2020	\$ 20.700	\$ (175)	\$ 0	0,00
	Floor - OTC CPURNSA	216,687	Maximal [(1 + 0,000 %) <sup>10</sup> - (Index Final/Index Initial)] oder 0	07.04.2020	49.700	(443)	0	0,00
	Floor - OTC CPURNSA	217,965	Maximal [(1 + 0,000 %) <sup>10</sup> - (Index Final/Index Initial)] oder 0	29.09.2020	37.100	(479)	0	0,00
DUB	Floor - OTC CPURNSA	215,949	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	10.03.2020	7.500	(56)	0	0,00
	Floor - OTC CPURNSA	218,011	Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0	13.10.2020	40.100	(393)	0	0,00
						\$ (1.546)	\$ 0	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,800 %	20.08.2018	\$ 119.700	\$ (2.788)	\$ (880)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	12.12.2019	22.800	(248)	(477)	(0,01)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,800	20.08.2018	55.000	(1.227)	(405)	(0,01)
							\$ (4.263)	\$ (1.762)	(0,03)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

## 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	Petrobras Global Finance BV	1,000 %	20.03.2020	\$ 5.600	\$ (841)	\$ 755	\$ (86)	0,00
GST	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.03.2020	4.900	(728)	652	(76)	0,00
HUS	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.03.2020	7.500	(1.126)	1.010	(116)	(0,01)
					\$ (2.695)	\$ 2.417	\$ (278)	(0,01)

## 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
CBK	MCDX-25 5-Year Index	1,000 %	20.12.2020	\$ 1.700	\$ (3)	\$ 33	\$ 30	0,00
DUB	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,000	17.01.2047	4.000	(246)	269	23	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,000	17.09.2058	13.800	(1.387)	1.382	(5)	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,000	11.05.2063	15.767	(669)	773	104	0,01
	MCDX-25 5-Year Index	1,000	20.12.2020	5.300	(10)	102	92	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	11.234	(454)	528	74	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	6.900	(280)	277	(3)	0,00
					\$ (3.049)	\$ 3.364	\$ 315	0,01

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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
SAL	Erhalt	3-Month MTGEFNL versus USSW10 Index Spread	0,640 %	12.07.2018	\$ 30.000	\$ 0	\$ 9	\$ 9	0,00

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
FBF	Erhalt	IOS.FN.350.13 Index	k. A.	1-Month USD-LIBOR	\$ 31.345	12.01.2044	\$ 0	\$ (189)	\$ (189)	0,00

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07/2018	CAD	1.503	\$ 1.156	\$ 13	\$ 0	0,00	
	07/2018	€	35.329	41.471	222	0	0,00	
	07/2018	\$	56.566	AUD 76.627	50	0	0,00	
	07/2018	€	53.344	45.417	0	(317)	(0,01)	
	08/2018	ARS	5.950	276	79	0	0,00	
	08/2018	AUD	76.627	56.571	0	(50)	(0,00)	
	08/2018	¥	28.318.500	259.926	3.601	0	3.601	0,06
	08/2018	SEK	894.699	103.226	2.896	0	2.896	0,05
	08/2018	\$	139	ILS 496	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	€	61.773	¥ 6.741.700	0	(734)	(734)	(0,01)
	09/2018	ARS	2.918	\$ 133	39	0	39	0,00
	09/2018	SGD	335	252	6	0	6	0,00
	10/2018	DKK	300.403	48.789	1.379	0	1.379	0,02
	BPS	07/2018	ARS	515.022	19.785	2.074	0	2.074
07/2018		€	79	92	0	(1)	(1)	0,00
07/2018		\$	12.630	ARS 346.698	0	(613)	(613)	(0,01)
07/2018		€	159.404	€ 137.004	555	0	555	0,01
07/2018		€	1.767	PEN 5.772	0	(5)	(5)	0,00
08/2018		ARS	3.850	\$ 179	51	0	51	0,00
08/2018		€	137.004	159.759	0	(547)	(547)	(0,01)
08/2018		¥	10.890.000	100.431	1.751	0	1.751	0,03
09/2018		\$	1.084	INR 74.054	0	(14)	(14)	0,00
10/2018		DKK	104.149	\$ 16.801	364	0	364	0,01
BRC	07/2018	ARS	143.803	5.396	480	0	480	0,01
	07/2018	£	94	123	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$	256.102	£ 195.848	2.466	0	2.466	0,04
	08/2018	£	195.848	\$ 256.458	0	(2.460)	(2.460)	(0,04)
CBK	08/2018	MXN	150.023	7.162	0	(406)	(406)	(0,01)
	07/2018	CAD	129.874	99.761	1.031	0	1.031	0,02
	07/2018	€	27.111	32.097	443	0	443	0,01
	07/2018	£	237.372	314.488	1.097	0	1.097	0,02
	07/2018	¥	25.295.500	237.963	9.495	0	9.495	0,17

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	07/2018	RUB 645.786	\$ 10.212	\$ 0	\$ (80)	\$ (80)	0,00
	07/2018	\$ 31	ARS 810	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	12.750	CAD 16.756	2	(14)	(12)	0,00
	07/2018	1.817	£ 1.367	0	(12)	(12)	0,00
	07/2018	7.203	MXN 145.665	182	0	182	0,00
	08/2018	€ 5.000	\$ 5.969	115	0	115	0,00
	08/2018	¥ 4.424.800	40.343	325	(37)	288	0,01
	08/2018	MXN 519.049	25.807	0	(374)	(374)	(0,01)
	08/2018	\$ 22.993	MXN 462.325	327	0	327	0,01
	08/2018	6.706	SEK 59.470	0	(37)	(37)	0,00
DUB	07/2018	ARS 235.492	\$ 8.443	281	0	281	0,00
	07/2018	\$ 9.821	BRL 36.447	0	(348)	(348)	(0,01)
	08/2018	MXN 65.434	\$ 3.237	0	(63)	(63)	0,00
	10/2018	DKK 14.829	2.399	59	0	59	0,00
	10/2018	€ 8.000	9.920	513	0	513	0,01
FBF	07/2018	CAD 554	417	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	MXN 346.023	17.280	0	(173)	(173)	0,00
GLM	07/2018	AUD 77.776	58.468	1.003	0	1.003	0,02
	07/2018	BRL 72.893	19.145	201	0	201	0,00
	07/2018	CAD 55.267	42.678	664	0	664	0,01
	07/2018	DKK 83.196	13.532	495	0	495	0,01
	07/2018	€ 35.973	42.102	102	0	102	0,00
	07/2018	£ 3.998	5.332	53	0	53	0,00
	07/2018	RUB 97.868	1.532	0	(27)	(27)	0,00
	07/2018	SGD 4	3	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 9.637	BRL 36.447	0	(166)	(166)	0,00
	07/2018	104.578	€ 89.669	343	(228)	115	0,00
	07/2018	5.720	£ 4.276	0	(75)	(75)	0,00
	07/2018	9.868	RUB 574.234	0	(717)	(717)	(0,01)
	08/2018	¥ 2.453.700	\$ 22.241	25	0	25	0,00
	08/2018	MXN 498.911	24.989	0	(176)	(176)	0,00
	08/2018	RUB 214.163	3.399	2	0	2	0,00
	08/2018	\$ 9.480	BRL 36.447	0	(40)	(40)	0,00
	08/2018	35.353	¥ 3.879.000	0	(233)	(233)	0,00
	08/2018	2.333	MXN 46.871	31	0	31	0,00
	08/2018	1.505	SEK 12.835	0	(66)	(66)	0,00
	09/2018	61.619	RUB 3.864.881	0	(436)	(436)	(0,01)
HUS	07/2018	ARS 5.004	\$ 236	65	0	65	0,00
	07/2018	€ 13.200	16.043	628	0	628	0,01
	07/2018	RUB 1.195.331	18.746	0	(303)	(303)	(0,01)
	07/2018	\$ 94	ARS 2.580	0	(6)	(6)	0,00
	07/2018	99.660	CAD 132.597	1.140	0	1.140	0,02
	07/2018	3.241	€ 2.796	24	0	24	0,00
	07/2018	1.524	£ 1.152	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	30	SGD 41	0	0	0	0,00
	08/2018	ARS 1.510	\$ 70	20	0	20	0,00
	08/2018	CAD 132.597	99.715	0	(1.135)	(1.135)	(0,02)
	08/2018	MXN 270.660	13.336	0	(316)	(316)	(0,01)
	08/2018	RUB 3.851.870	61.628	532	0	532	0,01
	08/2018	\$ 3.273	RUB 207.238	15	0	15	0,00
	09/2018	CNH 769	\$ 121	5	0	5	0,00
JPM	07/2018	AUD 1.773	1.335	25	0	25	0,00
	07/2018	CAD 1.199	900	0	(11)	(11)	0,00
	07/2018	£ 709	933	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	¥ 950.000	8.733	141	0	141	0,00
	07/2018	RUB 549.721	8.604	0	(156)	(156)	0,00
	07/2018	\$ 2.149	AUD 2.922	10	0	10	0,00
	07/2018	1.115	CAD 1.444	0	(18)	(18)	0,00
	07/2018	70.490	€ 60.290	178	(276)	(98)	0,00
	07/2018	7.792	MXN 157.557	196	0	196	0,00
	08/2018	¥ 29.370.000	\$ 269.516	3.551	0	3.551	0,06
	08/2018	MXN 121.873	6.540	389	0	389	0,01
	08/2018	NGN 754.500	2.000	0	(74)	(74)	0,00
	08/2018	SEK 158.845	18.177	365	0	365	0,01
	08/2018	\$ 88.977	¥ 9.767.400	0	(542)	(542)	(0,01)
	08/2018	37.007	MXN 735.928	375	(262)	113	0,00
	12/2018	NGN 629.415	\$ 1.666	0	(41)	(41)	0,00
MSB	07/2018	€ 9.089	10.498	0	(114)	(114)	0,00
	07/2018	MXN 66.352	3.503	138	0	138	0,00
	07/2018	\$ 9.512	MXN 191.648	206	0	206	0,00
	07/2018	30.015	RUB 1.914.472	495	0	495	0,01
	08/2018	¥ 830.000	\$ 7.525	8	0	8	0,00
	08/2018	\$ 10.521	€ 9.089	114	0	114	0,00
	09/2018	THB 37.293	\$ 1.174	46	0	46	0,00
NAB	07/2018	€ 13.600	16.916	1.034	0	1.034	0,02
NGF	07/2018	ARS 247	9	0	0	0	0,00
RBC	08/2018	\$ 188.067	SEK 1.632.692	0	(4.978)	(4.978)	(0,09)
RYL	07/2018	MXN 128.986	\$ 6.976	434	0	434	0,01
	08/2018	¥ 3.500.300	32.113	421	0	421	0,01
SCX	07/2018	\$ 3.928	£ 2.960	5	(25)	(20)	0,00
	08/2018	€ 8.000	\$ 3.772	262	0	262	0,00
	08/2018	\$ 6.892	SEK 59.802	0	(186)	(186)	0,00
	09/2018	NGN 1.127.250	\$ 3.000	0	(93)	(93)	0,00
	09/2018	\$ 131	KRW 140.304	0	(4)	(4)	0,00
	10/2018	DKK 271.358	\$ 44.112	1.286	0	1.286	0,02
	11/2018	NGN 46.948	123	0	(5)	(5)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
SSB	07/2018	€ 224.000	\$ 259.360	\$ 0	\$ (2.172)	\$ (2.172)	(0,04)
	07/2018	\$ 0	HKD 1	0	0	0	0,00
	08/2018	114.851	¥ 12.526.600	0	(1.435)	(1.435)	(0,02)
TOR	10/2018	DKK 231.997	\$ 37.640	1.026	0	1.026	0,02
UAG	07/2018	\$ 48.231	£ 36.477	0	(73)	(73)	0,00
	07/2018	22.864	MXN 456.408	275	0	275	0,00
	08/2018	£ 36.477	\$ 48.300	76	0	76	0,00
	08/2018	¥ 3.340.000	30.765	514	0	514	0,01
	08/2018	\$ 6.810	SEK 59.425	0	(146)	(146)	0,00
	09/2018	HKD 14.214	\$ 1.815	1	0	1	0,00
					\$ 46.815	\$ (20.839)	\$ 25.976

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional 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 Nettover- mögens
CBK	07/2018	\$ 4.022	CAD 5.236	\$ 0	\$ (41)	\$ (41)	0,00
HUS	07/2018	CAD 5.335	\$ 4.010	0	(46)	(46)	0,00
	07/2018	\$ 4.056	CAD 5.268	0	(52)	(52)	0,00
NAB	08/2018	3.936	5.233	45	0	45	0,00
	07/2018	CAD 5.233	\$ 3.935	0	(44)	(44)	0,00
	08/2018	\$ 3.937	CAD 5.233	44	0	44	0,00
RBC	07/2018	7	9	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	4.080	5.233	0	(103)	(103)	0,00
UAG	07/2018	CAD 5.224	\$ 3.932	0	(39)	(39)	0,00
	08/2018	\$ 3.934	CAD 5.224	39	0	39	0,00
				\$ 128	\$ (325)	\$ (197)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class, Investor CHF (Hedged) Class und Class E CHF (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BOA	07/2018	CHF 100	\$ 101	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
CBK	07/2018	\$ 8.296	CHF 8.170	0	(68)	(68)	0,00
	07/2018	CHF 142	\$ 142	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07/2018	\$ 8.464	CHF 8.360	0	(44)	(44)	0,00
	07/2018	CHF 8.256	\$ 8.272	0	(43)	(43)	0,00
	07/2018	\$ 8.463	CHF 8.374	0	(29)	(29)	0,00
JPM	08/2018	8.269	8.233	42	0	42	0,00
	07/2018	CHF 8.192	\$ 8.268	18	0	18	0,00
RBC	08/2018	\$ 8.289	CHF 8.192	0	(18)	(18)	0,00
	07/2018	CHF 12	\$ 12	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	\$ 12	CHF 12	0	0	0	0,00
				\$ 61	\$ (203)	\$ (142)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BOA	07/2018	\$ 741.309	€ 631.522	\$ 0	\$ (3.975)	\$ (3.975)	(0,07)
BPS	07/2018	€ 624.100	\$ 726.141	0	(2.528)	(2.528)	(0,04)
	08/2018	\$ 727.757	€ 624.100	2.493	0	2.493	0,04
BRC	07/2018	€ 5.064	\$ 5.883	14	(43)	(29)	0,00
CBK	07/2018	7.831	9.133	41	(51)	(10)	0,00
GLM	07/2018	12.992	15.280	126	(14)	112	0,00
MSB	07/2018	423.541	489.190	0	(5.315)	(5.315)	(0,09)
	07/2018	\$ 749.470	€ 642.376	537	0	537	0,01
RBC	08/2018	490.268	423.541	5.311	0	5.311	0,09
	07/2018	€ 2.464	\$ 2.862	0	(16)	(16)	0,00
RYL	07/2018	3.487	4.080	16	(7)	9	0,00
	07/2018	\$ 4.811	€ 4.119	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07/2018	€ 12.602	\$ 14.746	40	(7)	33	0,00
SSB	07/2018	626.272	725.411	0	(5.793)	(5.793)	(0,10)
	07/2018	\$ 742.268	€ 641.072	6.215	0	6.215	0,11
	08/2018	727.015	626.272	5.776	0	5.776	0,10
				\$ 20.569	\$ (17.752)	\$ 2.817	0,05

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Investor GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
AZD	07/2018	£ 543	\$ 729	\$ 13	\$ 0	\$ 13	0,00
BOA	07/2018	\$ 29.194	£ 21.864	0	(327)	(327)	(0,01)
BPS	07/2018	£ 1.261	\$ 1.676	11	0	11	0,00
	07/2018	\$ 27	£ 21	0	0	0	0,00
BRC	07/2018	£ 21.593	\$ 28.241	1	(269)	(268)	0,00
	08/2018	\$ 27.949	£ 21.343	268	0	268	0,00
CBK	07/2018	£ 29	\$ 39	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 29.219	£ 22.054	0	(102)	(102)	0,00
GLM	07/2018	£ 336	\$ 442	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 166	£ 124	0	(2)	(2)	0,00
RYL	07/2018	5	4	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	29.508	22.197	0	(203)	(203)	0,00
SSB	07/2018	£ 78	\$ 104	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 76	£ 57	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07/2018	£ 21.206	\$ 28.039	42	0	42	0,00
	08/2018	\$ 28.079	£ 21.206	0	(44)	(44)	0,00
				\$ 336	\$ (949)	\$ (613)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional ILS (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 Nettover- mögens
BOA	08/2018	ILS 195	\$ 54	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	08/2018	\$ 446	ILS 1.596	0	(8)	(8)	0,00
GLM	08/2018	ILS 502	\$ 139	1	0	1	0,00
JPM	08/2018	\$ 441	ILS 1.589	0	(6)	(6)	0,00
RYL	08/2018	ILS 148	\$ 42	1	0	1	0,00
SCX	08/2018	502	138	1	0	1	0,00
SOG	08/2018	\$ 440	ILS 1.589	0	(5)	(5)	0,00
				\$ 4	\$ (19)	\$ (15)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional EUR (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 Nettover- mögens
BPS	07/2018	\$ 5.584	¥ 606.498	\$ 0	\$ (109)	\$ (109)	0,00
CBK	07/2018	62	6.778	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07/2018	¥ 605.978	\$ 5.492	21	0	21	0,00
	07/2018	\$ 5.493	¥ 597.422	0	(100)	(100)	0,00
	08/2018	5.503	605.978	0	(21)	(21)	0,00
MSB	07/2018	¥ 605.978	\$ 5.491	21	0	21	0,00
	08/2018	\$ 5.503	¥ 605.978	0	(21)	(21)	0,00
SSB	07/2018	5.623	610.189	0	(114)	(114)	(0,01)
TOR	07/2018	¥ 605.978	\$ 5.515	44	0	44	0,00
	08/2018	\$ 5.527	¥ 605.978	0	(45)	(45)	0,00
				\$ 86	\$ (411)	\$ (325)	(0,01)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional SGD (Hedged) Class und Class E SGD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BOA	09/2018	\$ 25.949	SGD 34.458	\$ 0	\$ (635)	\$ (635)	(0,01)
CBK	09/2018	SGD 53	\$ 39	0	0	0	0,00
GLM	09/2018	386	290	7	0	7	0,00
HUS	07/2018	83	62	1	0	1	0,00
	09/2018	\$ 40	SGD 54	0	(1)	(1)	0,00
IND	09/2018	SGD 117	\$ 87	1	0	1	0,00
JPM	09/2018	52	39	1	0	1	0,00
MSB	09/2018	\$ 28.092	SGD 37.464	0	(571)	(571)	(0,01)
RYL	07/2018	SGD 51	\$ 38	1	0	1	0,00
SSB	09/2018	190	141	1	0	1	0,00
				\$ 12	\$ (1.207)	\$ (1.195)	(0,02)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 22.966 0,40

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Barclays Bank PLC 1,940 % fällig am 04.09.2018	\$ 84.300	\$ 84.253	1,47
Summe Einlagenzertifikate		\$ 84.253	1,47
Summe Anlagen		\$ 9.535.535	166,29
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (3.801.231)	(66,29)
Nettovermögen		\$ 5.734.304	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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(d) 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) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 1.189.639 als Sicherheiten verpfändet.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 18.078 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 71.520 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 19.270 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettover- mögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 5.454	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	\$ (5.566)	\$ 5.454	\$ 5.454	0,10
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (5.566)	\$ 5.454	\$ 5.454	0,10

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

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 496.261	\$ 8.900.985	\$ 49.077	\$ 9.446.323
Einlagen bei Kreditinstituten	0	84.253	0	84.253
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(26.579)	31.538	0	4.959
Summen	\$ 469.682	\$ 9.016.776	\$ 49.077	\$ 9.535.535

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 417.302	\$ 8.749.790	\$ 17.956	\$ 9.185.048
Einlagen bei Kreditinstituten	0	84.310	0	84.310
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(3.283)	(13.852)	0	(17.135)
Summen	\$ 414.019	\$ 8.820.248	\$ 17.956	\$ 9.252.223

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BCY	2,180 %	13.06.2018	12.07.2018	\$ (43.071)	\$ (43.118)	(0,75)
BOS	1,950	27.06.2018	16.07.2018	(35.697)	(35.705)	(0,62)
	1,990	09.05.2018	10.07.2018	(37.635)	(37.745)	(0,66)
BRC	2,180	13.06.2018	12.07.2018	(2.527)	(2.530)	(0,04)
GRE	1,920	17.04.2018	17.07.2018	(8.595)	(8.629)	(0,15)
	1,950	23.04.2018	23.07.2018	(279.128)	(280.171)	(4,89)
	1,980	01.05.2018	02.07.2018	(155.721)	(156.243)	(2,72)
	2,020	09.05.2018	11.07.2018	(147.072)	(147.510)	(2,57)
	2,080	24.05.2018	06.07.2018	(14.497)	(14.529)	(0,25)
IND	2,160	13.06.2018	05.07.2018	(17.727)	(17.746)	(0,31)
	1,980	03.05.2018	03.07.2018	(24.752)	(24.832)	(0,43)
	2,010	08.05.2018	09.07.2018	(184.389)	(184.945)	(3,23)
	2,010	09.05.2018	09.07.2018	(4.979)	(4.994)	(0,09)
	2,030	10.05.2018	10.07.2018	(99.057)	(99.347)	(1,73)
	2,040	11.05.2018	11.07.2018	(73.625)	(73.838)	(1,29)
	2,060	15.05.2018	17.07.2018	(13.608)	(13.645)	(0,24)
	2,060	18.05.2018	18.07.2018	(36.454)	(36.546)	(0,64)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (1.182.073)</b>	<b>(20,61)</b>

## Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkauf-geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
MSC	2,020 %	08.05.2018	09.07.2018	\$ (17.629)	\$ (17.683)	(0,31)
<b>Summe Rückkaufgeschäfte</b>					<b>\$ (17.683)</b>	<b>(0,31)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 8 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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 13	\$ 0	\$ 13
BOA	2.165	4.780	6.945
BPS	3.308	(2.800)	508
BRC	48	0	48
CBK	12.003	(14.230)	(2.227)
DUB	214	(950)	(736)
FBF	(366)	0	(366)
GLM	393	(750)	(357)
GST	120	(260)	(140)
HUS	496	(1.040)	(544)
IND	1	(70)	(69)
JPM	2.848	(1.670)	1.178
MEI	74	0	74
MSB	846	5.610	6.456
MYC	(72)	(139)	(211)
NAB	1.034	(1.160)	(126)
RBC	(4.994)	6.510	1.516
RYL	3	(10)	(7)
SAL	9	0	9
SCX	968	(1.070)	(102)
SOG	(5)	0	(5)
SSB	2.478	1.640	4.118
TOR	1.025	(1.260)	(235)
UAG	642	(420)	222
WST	(285)	320	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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse	108,63	72,76
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,80	67,80
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	8,30	3,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,46)	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,15	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate	0,40	(0,32)
Einlagenzertifikate	1,47	1,32
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(20,61)	(16,20)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,31)	(0,47)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Total Return Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>			<b>Pimco Funds Ireland plc - USD Short Term Floating Nav Fund (a)</b>		
	824.430.000	\$ 772.154		1.001.615.000	\$ 693.700
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.07.2018	¥ 32.000	227.315	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 30.09.2024	\$ 21.850	137.283
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	104.000	216.930	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.07.2018	¥ 104.000	73.144
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.06.2018	5.000	186.153	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.11.2042	\$ 45.300	65.866
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 27.08.2018	130.000	151.372	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2027	103.000	60.379
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 06.08.2018	12.000	129.657	Stadshypotek AB 2,500 % fällig am 18.09.2019	SEK 117.295	59.470
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 07.05.2018	118.250	118.730	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.11.2047	\$ 9.560	49.817
Bank Nederlandse Gemeenten NV 2,500 % fällig am 28.02.2020	\$ 9.000	79.910	Towers CQ SRL 0,620 % fällig am 28.12.2033	€ 79.500	47.353
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 28.05.2018	¥ 54.000	62.330	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2027	\$ 38.000	38.056
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.11.2047	\$ 55.480	49.820	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.08.2045	15.000	35.799
Red & Black Auto Germany 5 UG haftungsbeschränkt	€ 390	46.619	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.06.2018	¥ 84.250	31.528
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 15.01.2027	¥ 41.000	41.199	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.08.2022	\$ 14.150	30.970
QNB Finance Ltd. 3,705 % fällig am 12.02.2020	\$ 15.850	38.900	U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.02.2043	21.780	30.461
U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2027	40	38.674	Swedbank Hypotek AB 3,750 % fällig am 19.06.2019	SEK 73.000	26.014
U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 15.02.2048	12.000	34.995	Banco Santander S.A. 4,750 % fällig am 19.03.2025	€ 54.000	24.405
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.06.2018	¥ 2.600	33.007	Letras del Banco Central de la Republica Argentina 1,000 % fällig am 16.05.2018	ARS 741.424	23.972
Greece Treasury Bills 1,674 % fällig am 06.07.2018	€ 15.520	32.551	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 30.04.2020	\$ 19.150	23.138
Dexia Credit Local SA 2,500 % fällig am 25.01.2021	\$ 26.176	31.801	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.10.2021	26.000	21.199
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.08.2018	¥ 29.000	30.493	Letras del Banco Central de la Republica Argentina 1,000 % fällig am 21.06.2018	ARS 74.616	17.732
SMBC Trust Account 3,531 % fällig am 09.04.2021	\$ 5.000	30.000	Citigroup, Inc. 2,750 % fällig am 25.04.2022	\$ 77.000	17.321

(a) Der Total Return Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>BlueMountain CLO Ltd.</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>BAT Capital Corp.</b>				<b>Cent CLO Ltd.</b>			
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				<b>2,945 % fällig am 14.08.2020</b>				<b>3,249 % fällig am 29.10.2025</b>			
<b>AerCap Ireland Capital DAC</b>				\$	1.200	\$ 1.204	0,98	\$	653	\$ 653	0,53
3,750 % fällig am 15.05.2019	\$	150	0,12								
<b>Ally Financial, Inc.</b>				<b>Central Nippon Expressway Co. Ltd.</b>				<b>3,689 % fällig am 29.10.2025</b>			
3,500 % fällig am 27.01.2019		200	0,16	2,803 % fällig am 15.02.2022	2.000	1.992	1,62	<b>EFS Volunteer LLC</b>	468	469	0,38
<b>Athene Global Funding</b>				3,186 % fällig am 14.09.2021	500	505	0,41	3,210 % fällig am 25.10.2035	797	798	0,65
3,566 % fällig am 01.07.2022		500	0,42	<b>Conagra Brands, Inc.</b>				<b>Navient Student Loan Trust</b>			
<b>Banco Santander Chile</b>				3,319 % fällig am 28.05.2021	1.000	1.015	0,83	3,341 % fällig am 25.06.2065	235	242	0,20
3,160 % fällig am 25.07.2020	1.600	1.607	1,31	<b>Daimler Finance North America LLC</b>				<b>NYMT Residential</b>			
<b>Bank of America Corp.</b>				2,831 % fällig am 09.10.2020	700	697	0,57	4,000 % fällig am 25.03.2021	38	38	0,03
3,022 % fällig am 21.07.2021	1.000	1.004	0,82	<b>Dell International LLC</b>				<b>Oaktree CLO Ltd.</b>			
<b>BOC Aviation Ltd.</b>				2,753 % fällig am 04.05.2020	1.100	1.100	0,90	3,579 % fällig am 20.10.2026	1.000	1.001	0,82
3,000 % fällig am 30.03.2020		500	0,40	<b>eBay, Inc.</b>				<b>Palmer Square CLO Ltd.</b>			
<b>Citigroup, Inc.</b>				2,838 % fällig am 01.08.2019	145	145	0,12	3,573 % fällig am 17.10.2027	1.000	1.002	0,82
3,672 % fällig am 26.10.2020		600	0,50	<b>EQT Corp.</b>				<b>Progress Residential Trust</b>			
<b>Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.</b>				3,107 % fällig am 01.10.2020	1.000	1.001	0,81	3,585 % fällig am 17.09.2033	988	991	0,81
4,645 % fällig am 16.04.2021		500	0,43	<b>General Mills, Inc.</b>				<b>SLM Private Education Loan Trust</b>			
<b>Emirates NBD PJSC</b>				2,893 % fällig am 16.04.2021	200	200	0,16	3,310 % fällig am 15.10.2046	234	235	0,19
3,912 % fällig am 26.01.2020		200	0,17	<b>Kraft Heinz Foods Co.</b>				<b>Towd Point Mortgage Trust</b>			
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>				2,923 % fällig am 10.02.2021	400	401	0,33	2,691 % fällig am 25.02.2057	811	814	0,66
3,720 % fällig am 23.04.2021	820	838	0,68	3,173 % fällig am 10.08.2022	500	502	0,41	<b>Utah State Board of Regents</b>			
<b>ICICI Bank Ltd.</b>				<b>SK Broadband Co. Ltd.</b>				2,710 % fällig am 25.01.2057	749	750	0,61
4,800 % fällig am 22.05.2019		500	0,41	2,875 % fällig am 29.10.2018	800	800	0,65	<b>VOLT LLC</b>			
<b>International Lease Finance Corp.</b>				<b>Time Warner Cable LLC</b>				3,125 % fällig am 25.06.2047	312	311	0,25
5,875 % fällig am 01.04.2019	700	715	0,58	8,250 % fällig am 01.04.2019	600	623	0,51	3,125 % fällig am 25.09.2047	794	789	0,64
<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>				8,750 % fällig am 14.02.2019	500	517	0,42	3,250 % fällig am 25.05.2047	105	104	0,09
3,419 % fällig am 07.06.2021	500	510	0,42	<b>Viacom, Inc.</b>				3,250 % fällig am 25.06.2047	332	331	0,27
<b>LeasePlan Corp. NV</b>				2,750 % fällig am 15.12.2019	129	128	0,10	<b>Voya CLO Ltd.</b>			
2,875 % fällig am 22.01.2019	200	200	0,16	<b>Woodside Finance Ltd.</b>				3,080 % fällig am 25.07.2026	300	299	0,24
<b>Lloyds Banking Group PLC</b>				4,600 % fällig am 10.05.2021	400	410	0,33				
7,000 % fällig am 27.06.2019 (c)(e)	£	500	0,55			11.741	9,56			10.528	8,57
<b>Macquarie Bank Ltd.</b>				<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
2,600 % fällig am 24.06.2019	\$	900	0,73	<b>AT&amp;T, Inc.</b>				<b>Export-Import Bank of India</b>			
<b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b>				3,245 % fällig am 15.02.2023	1.100	1.112	0,91	3,331 % fällig am 21.08.2022	500	501	0,41
3,150 % fällig am 25.07.2022	1.400	1.407	1,15	<b>Dominion Energy, Inc.</b>				3,875 % fällig am 02.10.2019	556	560	0,45
<b>Mitsubishi UFJ Lease &amp; Finance Co. Ltd.</b>				2,930 % fällig am 15.05.2020	300	300	0,24	<b>Japan Bank for International Cooperation</b>			
3,137 % fällig am 23.07.2019	500	502	0,41	<b>Duke Energy Corp.</b>				2,780 % fällig am 01.06.2020	600	604	0,49
<b>Mizuho Financial Group, Inc.</b>				2,830 % fällig am 14.05.2021	500	500	0,41	<b>Japan Finance Organization for Municipalities</b>			
3,473 % fällig am 13.09.2021	1.200	1.218	0,99	<b>Electricite de France S.A.</b>				2,500 % fällig am 12.09.2018	2.600	2.601	2,12
<b>Morgan Stanley</b>				6,500 % fällig am 26.01.2019	500	510	0,42	<b>SNCF Reseau</b>			
2,903 % fällig am 10.02.2021	900	902	0,73	<b>Sempra Energy</b>				2,000 % fällig am 13.10.2020	600	588	0,48
<b>Navient Corp.</b>				2,791 % fällig am 15.03.2021	1.000	1.001	0,81			4.854	3,95
5,500 % fällig am 15.01.2019	1.000	1.009	0,82	<b>Verizon Communications, Inc.</b>				<b>AKTIEN</b>			
<b>Nissan Motor Acceptance Corp.</b>				3,335 % fällig am 16.03.2022	1.400	1.423	1,16	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
2,732 % fällig am 13.07.2020	500	501	0,41			4.846	3,95	<b>PIMCO Fixed Income Source</b>			
<b>Nissan Motor Acceptance Corp.</b>								<b>ETFs plc - PIMCO US</b>			
2,992 % fällig am 13.07.2022	500	501	0,41					<b>Dollar Short Maturity</b>			
<b>NTT Finance Corp.</b>				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		39.624	32,27	<b>Source UCITS ETF (d)</b>			
2,864 % fällig am 29.06.2020	1.200	1.205	0,98					114.103	11.577	9,43	
<b>ORIX Corp.</b>				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>							
2,650 % fällig am 13.04.2021	500	488	0,40	<b>Ginnie Mae</b>				<b>PARI (000S)</b>			
<b>Royal Bank of Scotland Group PLC</b>				2,717 % fällig am 20.05.2066	1.800	1.826	1,49	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
3,813 % fällig am 15.05.2023	1.000	1.005	0,82	2,747 % fällig am 20.08.2066	939	955	0,78	<b>COMMERCIAL PAPER</b>			
<b>Springleaf Finance Corp.</b>				4,444 % fällig am 20.09.2066	948	1.052	0,85	<b>Energy Transfer Partners</b>			
5,250 % fällig am 15.12.2019	100	102	0,08					\$	1.200	1.198	0,98
<b>State Bank of India</b>								<b>Ford Motor Credit Co.</b>			
3,275 % fällig am 06.04.2020	400	401	0,33					<b>2,780 % fällig am 19.02.2019</b>			
<b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b>				<b>US-SCHATZobligationen</b>				<b>HP, Inc.</b>			
3,095 % fällig am 18.10.2022	1.000	1.001	0,81	<b>U.S. Treasury Notes</b>				<b>2,520 % fällig am 02.07.2018</b>			
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>				2,625 % fällig am 15.05.2021	6.600	6.601	5,38	<b>Unilever</b>			
3,119 % fällig am 12.07.2022	500	502	0,41					<b>2,337 % fällig am 13.08.2018</b>			
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>AKTIEN</b>			
2,766 % fällig am 19.09.2019	500	501	0,41	<b>BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust</b>				<b>PIMCO Fixed Income Source</b>			
<b>Svenska Handelsbanken AB</b>				5,017 % fällig am 15.12.2031	959	959	0,78	<b>ETFs plc - PIMCO US</b>			
2,800 % fällig am 24.05.2021	300	300	0,24	<b>BX Trust</b>				<b>Dollar Short Maturity</b>			
<b>Toyota Motor Credit Corp.</b>				2,953 % fällig am 15.07.2034	362	362	0,30	<b>Source UCITS ETF (d)</b>			
2,721 % fällig am 17.05.2022	500	502	0,41	<b>RBSSP Resecuritization Trust</b>				<b>114.103</b>			
<b>UBS Group Funding Switzerland AG</b>				3,428 % fällig am 25.10.2035	41	41	0,03	<b>11.577</b>			
4,128 % fällig am 14.04.2021	1.200	1.239	1,01					<b>9,43</b>			
<b>Wells Fargo &amp; Co.</b>								<b>1.200</b>			
3,661 % fällig am 04.03.2021	100	102	0,08	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>1.198</b>			
		23.037	18,76	<b>Allegro CLO Ltd.</b>				<b>1.081</b>			
				3,579 % fällig am 30.01.2026	1.000	1.000	0,81	<b>300</b>			
				<b>Babson CLO Ltd.</b>				<b>4.299</b>			
				3,503 % fällig am 17.10.2026	700	701	0,57	<b>1.700</b>			
								<b>1.39</b>			
								<b>6.299</b>			
								<b>5,13</b>			

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER MÖGENS
<b>U.S. TREASURY BILLS</b>				<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
1,957 % fällig am 20.09.2018 (a)(b)	\$ 100	\$ 100	0,09	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO			
1,973 % fällig am 27.09.2018 (a)(b)	100	99	0,08	US Dollar Short-Term Floating			
1,985 % fällig am 11.10.2018 (a)(b)	100	99	0,08	NAV Fund (d)	36.835	\$ 369	0,30
1,994 % fällig am 04.10.2018 (a)(b)	100	99	0,08				
2,006 % fällig am 18.10.2018 (a)(b)	100	99	0,08				
		496	0,41	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt		\$ 114.217	93,02
Summe kurzfristige Instrumente		35.469	28,89				

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
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	123	\$ 41	0,03
BIST 30 Index August Futures	Short	08/2018	904	(22)	(0,02)
CAC 40 Index July Futures	Long	07/2018	44	(58)	(0,05)
DAX Index September Futures	Short	09/2018	12	13	0,01
E-mini NASDAQ 100 Index September Futures	Long	09/2018	38	(133)	(0,11)
E-mini Russell 2000 Index September Futures	Long	09/2018	101	(197)	(0,16)
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09/2018	39	(78)	(0,06)
Euro STOXX 50 September Futures	Long	09/2018	29	(19)	(0,02)
Euro-Bobl July Futures	Long	07/2018	73	(4)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	35	43	0,04
FTSE 100 Index September Futures	Long	09/2018	24	8	0,01
FTSE China A50 Index July Futures	Short	07/2018	156	(8)	(0,01)
FTSE/JSE Top 40 Index September Futures	Short	09/2018	60	(57)	(0,05)
FTSE/MIB Index September Futures	Short	09/2018	31	30	0,03
Hang Seng China Enterprises Index July Futures	Short	07/2018	37	0	0,00
Hang Seng Index July Futures	Short	07/2018	9	(7)	(0,01)
MSCI Singapore Active Contract July Futures	Short	07/2018	212	(16)	(0,01)
Nikkei 225 Index September Futures	Long	09/2018	3	(8)	(0,01)
S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures	Long	09/2018	124	117	0,10
SPI 200 Index September Futures	Long	09/2018	90	82	0,07
Topix Index September Futures	Short	09/2018	10	8	0,01
Volatility S&P 500 Index July Futures	Short	07/2018	32	(46)	(0,04)
VSTOXX Mini July Futures	Short	07/2018	161	(32)	(0,03)
WIG20 Index September Futures	Short	09/2018	235	135	0,11
				\$ (208)	(0,17)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (208)	(0,17)

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-Year BRL-CDI	10,730 %	02.01.2023	BRL 34.600	\$ (47)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,835	02.01.2023	25.500	(183)	(0,15)
Zahlung	3-Month CAD Bank Bill	1,900	16.06.2027	CAD 19.000	(26)	(0,02)
Erhalt	3-Month PLN-WIBOR	2,500	19.09.2023	PLN 17.900	(23)	(0,02)
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	2,500	19.12.2023	65.100	15	0,01
Zahlung	3-Month SGD-SOR	1,918	21.03.2023	SGD 200	(2)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	\$ 3.100	(113)	(0,09)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	19.09.2023	ZAR 11.500	11	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,000	19.12.2023	8.400	1	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,750	20.06.2023	CZK 3.400	1	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	20.06.2028	€ 22.900	150	0,12
Zahlung	6-Month GBP-LIBOR	1,500	20.06.2028	£ 8.300	(60)	(0,05)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	0,830	21.11.2022	HUF 399.900	56	0,05
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	3.083.600	325	0,27
Zahlung	6-Month HUF-BBR	2,250	19.12.2023	3.200.000	(81)	(0,07)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 1.020.000	30	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,540	08.12.2022	MXN 154.900	41	0,03
					\$ 95	0,08
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 95	0,08

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

## OPTIONSKAUF

## DEVIENOPTIEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettvermögens
BPS	Call - OTC EUR versus USD	\$ 1,390	10.09.2018	€ 14.000	\$ 1	\$ 0	0,00
	Call - OTC GBP versus USD	1,580	10.09.2018	£ 3.400	0	0	0,00
CBK	Put - OTC USD versus CAD	CAD 1,155	24.09.2018	\$ 7.500	1	0	0,00
GLM	Put - OTC USD versus SEK	SEK 7,000	10.09.2018	8.900	1	0	0,00
HUS	Put - OTC USD versus JPY	¥ 92,250	20.09.2018	7.500	1	1	0,00
					\$ 4	\$ 1	0,00

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
BPS	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,178 %	19.09.2023	KRW 3.427.700	\$ 0	\$ 6	\$ 6	0,01
GLM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,096	21.03.2023	ILS 37.200	0	39	39	0,03
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	1,053	20.06.2023	2.560	0	3	3	0,00
HUS	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,853	21.03.2023	36.100	0	(90)	(90)	(0,07)
						\$ 0	\$ (42)	\$ (42)	(0,03)

## DEVIENETERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AZD	07/2018	¥ 2.500	\$ 23	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2018	\$ 92	AUD 125	0	0	0	0,00
	07/2018	461	¥ 50.900	0	(2)	(2)	0,00
BOA	07/2018	CLP 422.828	\$ 700	50	0	50	0,04
	07/2018	CNY 26.211	4.100	140	0	140	0,11
	07/2018	ILS 5.049	1.400	20	0	20	0,02
	07/2018	KRW 6.763.680	6.100	24	0	24	0,02
	07/2018	RON 14.822	3.800	91	0	91	0,07
	07/2018	THB 46.284	1.400	3	0	3	0,00
	07/2018	\$ 1.600	HUF 450.321	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	1.000	ILS 3.559	0	(27)	(27)	(0,02)
	07/2018	5.685	INR 373.027	0	(243)	(243)	(0,20)
	07/2018	215	SEK 1.875	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	46	TRY 210	0	0	0	0,00
	07/2018	800	TWD 24.379	1	0	1	0,00
	08/2018	HUF 798.509	\$ 3.049	210	0	210	0,17
	08/2018	ILS 311	86	1	0	1	0,00
	08/2018	MXN 4.039	205	2	0	2	0,00
	08/2018	\$ 569	HUF 150.960	0	(32)	(32)	(0,03)
	08/2018	58	NOK 460	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	690	ZAR 9.061	0	(32)	(32)	(0,03)
	08/2018	ZAR 3.958	\$ 314	27	0	27	0,02
	09/2018	HKD 9.164	1.171	1	0	1	0,00
BPS	07/2018	€ 2.737	3.167	0	(28)	(28)	(0,02)
	07/2018	NZD 19.900	14.054	580	0	580	0,47
	07/2018	RON 3.167	800	7	0	7	0,01
	07/2018	\$ 214	¥ 23.400	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	389	TRY 1.871	17	0	17	0,01
BRC	07/2018	41	AUD 54	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	1.356	€ 1.157	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	234	£ 177	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	1.400	MYR 5.587	0	(15)	(15)	(0,01)
	07/2018	697	SEK 6.000	0	(26)	(26)	(0,02)
	07/2018	63	TRY 304	3	0	3	0,00
CBK	07/2018	COP 2.337.600	\$ 800	4	0	4	0,00
	07/2018	€ 164	190	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	£ 419	555	2	0	2	0,00
	07/2018	RUB 65.410	1.000	0	(42)	(42)	(0,03)
	07/2018	TRY 1.561	334	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	\$ 151	CAD 198	0	0	0	0,00
	07/2018	700	CZK 15.591	0	0	0	0,00
	07/2018	157	£ 118	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	800	ILS 2.913	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	719	PLN 2.600	0	(25)	(25)	(0,02)
	07/2018	691	SEK 6.000	0	(20)	(20)	(0,02)
	07/2018	45	TRY 212	1	0	1	0,00
	08/2018	CZK 6.324	\$ 296	12	0	12	0,01
	08/2018	MXN 35.351	1.738	0	(45)	(45)	(0,04)
	08/2018	\$ 234	CZK 4.977	0	(10)	(10)	(0,01)
	08/2018	67	HUF 18.219	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	1.374	MXN 27.793	28	0	28	0,02

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	08/2018	\$ 14	TRY 65	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	09/2018	1.000	HUF 278.109	0	(9)	(9)	(0,01)
DUB	09/2018	594	SGD 808	0	0	0	0,00
	07/2018	10	TRY 47	1	0	1	0,00
FBF	08/2018	19		0	0	0	0,00
	07/2018	BRL 6.914	\$ 1.800	4	0	4	0,00
	07/2018	CAD 1.749	1.316	0	(14)	(14)	(0,01)
	07/2018	CLP 1.778.004	2.800	69	0	69	0,06
	07/2018	INR 392.660	5.800	71	0	71	0,06
	07/2018	\$ 28	AUD 38	0	0	0	0,00
	07/2018	3.922	CLP 2.371.332	0	(280)	(280)	(0,23)
	07/2018	900	COP 2.463.300	0	(62)	(62)	(0,05)
GLM	08/2018	3	CZK 68	0	0	0	0,00
	07/2018	CZK 147.897	\$ 7.100	460	0	460	0,37
	07/2018	€ 2.000	2.336	1	0	1	0,00
	07/2018	£ 9.722	13.053	217	0	217	0,18
	07/2018	HUF 857.074	3.300	258	0	258	0,21
	07/2018	ILS 26.449	7.400	171	0	171	0,14
	07/2018	¥ 595.000	5.415	41	0	41	0,03
	07/2018	KRW 1.594.314	1.500	68	0	68	0,05
	07/2018	MXN 131.342	6.800	125	0	125	0,10
	07/2018	MYR 3.538	900	23	0	23	0,02
	07/2018	NOK 14.000	1.706	0	(12)	(12)	(0,01)
	07/2018	NZD 4.600	3.200	85	0	85	0,07
	07/2018	PEN 4.250	1.300	2	0	2	0,00
	07/2018	PHP 52.654	1.000	14	0	14	0,01
	07/2018	PLN 29.698	8.300	367	0	367	0,30
	07/2018	RON 20.072	5.300	277	0	277	0,23
	07/2018	SGD 5.044	3.800	100	0	100	0,08
	07/2018	THB 167.906	5.200	131	0	131	0,11
	07/2018	TWD 81.620	2.800	119	0	119	0,10
	07/2018	\$ 700	ARS 14.693	0	(195)	(195)	(0,16)
	07/2018	2.343	AUD 3.100	0	(53)	(53)	(0,04)
	07/2018	21.462	CAD 27.000	0	(934)	(934)	(0,76)
	07/2018	3.000	CLP 1.792.190	0	(247)	(247)	(0,20)
	07/2018	1.099	€ 935	1	(8)	(7)	(0,01)
	07/2018	11.547	£ 8.450	0	(391)	(391)	(0,32)
	07/2018	1.062	HUF 265.952	0	(118)	(118)	(0,10)
	07/2018	3.400	ILS 12.069	0	(102)	(102)	(0,08)
	07/2018	136	¥ 14.900	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	4.226	KRW 4.489.815	0	(193)	(193)	(0,16)
	07/2018	2.400	MXN 44.489	0	(139)	(139)	(0,11)
	07/2018	4.425	MYR 17.099	0	(188)	(188)	(0,15)
	07/2018	14.273	NOK 109.523	0	(832)	(832)	(0,68)
	07/2018	1.000	PHP 52.185	0	(23)	(23)	(0,02)
	07/2018	4.147	PLN 14.026	0	(401)	(401)	(0,33)
	07/2018	5.400	RON 20.327	0	(313)	(313)	(0,25)
	07/2018	2.728	SEK 24.110	0	(32)	(32)	(0,03)
	07/2018	ZAR 35.396	\$ 2.900	320	0	320	0,26
	08/2018	HUF 86.865	329	20	0	20	0,02
	08/2018	MXN 37.729	1.893	1	(11)	(10)	(0,01)
	08/2018	\$ 4	CZK 87	0	0	0	0,00
	08/2018	8	HUF 2.292	0	0	0	0,00
	08/2018	1.807	MXN 36.000	9	0	9	0,01
	08/2018	88	TRY 406	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	8	ZAR 110	0	0	0	0,00
	09/2018	25	SGD 33	0	0	0	0,00
HUS	07/2018	HUF 174.252	\$ 700	82	0	82	0,07
	07/2018	PLN 4.446	1.250	62	0	62	0,05
	07/2018	SEK 370	42	1	0	1	0,00
	07/2018	TRY 2.234	464	0	(20)	(20)	(0,02)
	07/2018	\$ 6.664	£ 5.036	0	(15)	(15)	(0,01)
	07/2018	742	NOK 6.000	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	178	PLN 639	0	(7)	(7)	(0,01)
	07/2018	40	TRY 185	0	0	0	0,00
	08/2018	HUF 13.269	\$ 48	1	0	1	0,00
	08/2018	\$ 2.285	HUF 601.613	0	(146)	(146)	(0,12)
	08/2018	147	MXN 2.964	2	0	2	0,00
	08/2018	579	ZAR 7.492	0	(35)	(35)	(0,03)
	08/2018	ZAR 13.220	\$ 1.009	49	0	49	0,04
	09/2018	HKD 2.271	290	0	0	0	0,00
	09/2018	SGD 1.141	846	8	0	8	0,01
	09/2018	\$ 1.690	HKD 13.235	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	17	SGD 23	0	0	0	0,00
IND	07/2018	1.112	PLN 3.960	0	(55)	(55)	(0,04)
	07/2018	200	TRY 916	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	CZK 385	\$ 17	0	0	0	0,00
	08/2018	ZAR 1.372	108	9	0	9	0,01
JPM	09/2018	\$ 310	SGD 417	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	ARS 15.707	\$ 621	81	0	81	0,07
	07/2018	AUD 732	553	12	0	12	0,01
	07/2018	BRL 3.346	900	31	0	31	0,02
	07/2018	CAD 21.500	16.591	282	(37)	245	0,20

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	07/2018	CLP 3.484.250	\$ 5.500	\$ 148	\$ 0	\$ 148	0,12
	07/2018	CZK 76.864	\$ 3.500	49	0	49	0,04
	07/2018	€ 5.250	€ 6.308	176	0	176	0,14
	07/2018	£ 21.235	£ 28.891	850	0	850	0,69
	07/2018	HUF 1.193.389	4.600	365	0	365	0,30
	07/2018	ILS 11.613	3.300	126	0	126	0,10
	07/2018	¥ 1.200.000	10.987	149	0	149	0,12
	07/2018	KRW 2.263.401	2.100	67	0	67	0,05
	07/2018	MXN 35.582	1.800	0	(8)	(8)	(0,01)
	07/2018	NOK 186.000	23.424	597	0	597	0,49
	07/2018	NZD 6.200	4.345	148	0	148	0,12
	07/2018	PLN 13.234	3.792	257	0	257	0,21
	07/2018	SEK 50.435	6.015	375	0	375	0,30
	07/2018	TWD 107.388	3.600	72	0	72	0,06
	07/2018	\$ 9.804	AUD 12.806	0	(342)	(342)	(0,28)
	07/2018	5.349	CAD 6.839	0	(149)	(149)	(0,12)
	07/2018	870	€ 747	3	(1)	2	0,00
	07/2018	7.102	£ 5.000	0	(498)	(498)	(0,41)
	07/2018	8.178	NZD 11.200	0	(596)	(596)	(0,49)
	07/2018	2.300	PEN 7.446	0	(27)	(27)	(0,02)
	07/2018	3.709	PLN 12.444	0	(385)	(385)	(0,31)
	07/2018	1.084	RON 4.065	0	(67)	(67)	(0,05)
	07/2018	820	RUB 47.512	0	(63)	(63)	(0,05)
	07/2018	7	SEK 60	0	0	0	0,00
	07/2018	1.574	SGD 2.079	0	(49)	(49)	(0,04)
	07/2018	1.700	TWD 50.813	0	(31)	(31)	(0,03)
	07/2018	2.900	ZAR 34.593	0	(378)	(378)	(0,31)
	07/2018	ZAR 13.342	\$ 1.000	27	0	27	0,02
	08/2018	\$ 13	CZK 286	0	0	0	0,00
	08/2018	124	MXN 2.450	1	(1)	0	0,00
	09/2018	SGD 86	\$ 64	1	0	1	0,00
MSB	07/2018	MYR 18.690	4.700	69	0	69	0,06
	07/2018	SEK 30.000	3.597	242	0	242	0,20
	07/2018	\$ 2.580	€ 2.235	29	0	29	0,02
	07/2018	68	¥ 7.500	0	0	0	0,00
	07/2018	1.000	TWD 29.634	0	(26)	(26)	(0,02)
NGF	07/2018	CLP 888.132	\$ 1.400	36	0	36	0,03
	07/2018	\$ 6.500	CNY 41.067	0	(296)	(296)	(0,24)
RBC	07/2018	AUD 11.343	\$ 8.557	179	(3)	176	0,14
	07/2018	CAD 27.285	21.040	363	(67)	296	0,24
	07/2018	€ 5.750	€ 6.964	248	0	248	0,20
	07/2018	£ 1.938	£ 2.558	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	¥ 64.600	587	4	0	4	0,00
	07/2018	MXN 25.547	1.400	102	0	102	0,08
	07/2018	PLN 2.392	670	31	0	31	0,03
	07/2018	SEK 220	25	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 20	AUD 26	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	5.816	CZK 118.811	0	(481)	(481)	(0,39)
	07/2018	16	SEK 140	0	0	0	0,00
	07/2018	1.000	SGD 1.334	0	(22)	(22)	(0,02)
	07/2018	40	TRY 194	2	0	2	0,00
RYL	08/2018	451	MXN 9.286	18	0	18	0,01
	07/2018	143	PLN 520	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	98	TRY 462	2	0	2	0,00
	08/2018	61	CZK 1.292	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	6	HUF 1.548	0	0	0	0,00
	09/2018	HKD 3.514	\$ 448	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 44	HKD 345	0	0	0	0,00
SCX	09/2018	168	SGD 224	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	CNY 8.198	\$ 1.300	61	0	61	0,05
	07/2018	COP 6.554.700	2.300	69	0	69	0,06
	07/2018	PEN 11.206	3.400	0	(21)	(21)	(0,02)
	07/2018	SGD 2.145	1.600	27	0	27	0,02
	07/2018	TWD 140.140	4.700	96	0	96	0,08
	07/2018	\$ 1.014	CAD 1.350	12	0	12	0,01
	07/2018	5.318	COP 14.795.104	0	(282)	(282)	(0,23)
	07/2018	320	£ 243	1	0	1	0,00
	07/2018	46	¥ 5.100	0	0	0	0,00
	07/2018	1.800	KRW 1.938.384	0	(59)	(59)	(0,05)
	07/2018	2.413	PEN 7.797	0	(33)	(33)	(0,03)
	07/2018	61	TRY 289	1	0	1	0,00
	07/2018	700	TWD 20.768	0	(18)	(18)	(0,01)
	08/2018	TRY 17	\$ 4	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 17	ZAR 211	0	(1)	(1)	0,00
SOG	09/2018	SGD 819	\$ 612	10	0	10	0,01
	07/2018	PLN 4.960	1.464	139	0	139	0,11
	07/2018	SEK 29.885	3.662	320	0	320	0,26
	07/2018	\$ 7.681	MXN 143.156	0	(406)	(406)	(0,33)
	07/2018	218	NZD 300	0	(15)	(15)	(0,01)
	07/2018	134	PLN 485	0	(4)	(4)	0,00
SSB	07/2018	AUD 13.800	\$ 10.436	240	0	240	0,19
	07/2018	CAD 5.800	4.493	83	0	83	0,07
	07/2018	CZK 46.698	2.100	4	0	4	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	07/2018	€ 4.375	\$ 5.221	\$ 110	\$ 0	\$ 110	0,09
	07/2018	SEK 50	6	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 71	CAD 91	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	1.331	€ 1.125	0	(17)	(17)	(0,01)
	07/2018	347	£ 259	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	121	¥ 13.100	0	(3)	(3)	0,00
	07/2018	1.276	ZAR 15.077	0	(177)	(177)	(0,14)
	09/2018	SGD 134	\$ 99	0	0	0	0,00
	09/2018	\$ 15	HKD 114	0	0	0	0,00
	09/2018	80	SGD 107	0	(1)	(1)	0,00
TOR	07/2018	30	CAD 39	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	64	¥ 7.000	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	44	SEK 385	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07/2018	148	AUD 194	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	212	CAD 282	3	0	3	0,00
	07/2018	54	¥ 5.900	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	705	NZD 1.000	0	(28)	(28)	(0,02)
	07/2018	24	SEK 210	0	0	0	0,00
	08/2018	12	ZAR 152	0	(1)	(1)	0,00
	09/2018	SGD 30	\$ 23	1	0	1	0,00
	09/2018	\$ 113	HKD 884	0	0	0	0,00
				\$ 10.713	\$ (10.047)	\$ 666	0,54

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CHF (Hedged) Class und Class E CHF (Hedged) 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	07/2018	\$ 5.479	CHF 5.396	\$ 0	\$ (45)	\$ (45)	(0,04)
BPS	07/2018	44	43	0	(1)	(1)	0,00
BRC	07/2018	147	144	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07/2018	5.424	5.358	0	(28)	(28)	(0,02)
GLM	07/2018	CHF 5.588	\$ 5.599	1	(29)	(28)	(0,02)
	07/2018	\$ 5.564	CHF 5.506	0	(18)	(18)	(0,02)
	08/2018	5.542	5.517	29	0	29	0,02
JPM	07/2018	CHF 5.599	\$ 5.651	12	0	12	0,01
	07/2018	\$ 138	CHF 136	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	5.555	5.490	0	(12)	(12)	(0,01)
RBC	07/2018	CHF 5	\$ 5	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	213	214	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 188	CHF 185	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 42	\$ (138)	\$ (96)	(0,08)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class R EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 27.391	€ 23.335	\$ 0	\$ (147)	\$ (147)	(0,12)
BPS	07/2018	27.374	23.601	182	0	182	0,15
BRC	07/2018	914	787	6	(2)	4	0,00
CBK	07/2018	€ 673	\$ 792	6	0	6	0,01
	07/2018	\$ 1.910	€ 1.640	9	(4)	5	0,00
GLM	07/2018	€ 993	\$ 1.154	0	(5)	(5)	0,00
MSB	07/2018	24.061	27.790	0	(302)	(302)	(0,25)
	07/2018	\$ 829	€ 706	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	27.851	24.061	302	0	302	0,25
RBC	07/2018	€ 27	\$ 32	0	0	0	0,00
RYL	07/2018	1.016	1.191	5	0	5	0,00
	07/2018	\$ 239	€ 205	1	0	1	0,00
SCX	07/2018	€ 46	\$ 54	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 255	€ 218	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	€ 23.866	\$ 27.782	0	(82)	(82)	(0,07)
	07/2018	\$ 27.520	€ 23.649	92	0	92	0,07
	08/2018	27.844	23.866	81	0	81	0,07
				\$ 684	\$ (546)	\$ 138	0,11

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged) und Class R GBP (Hedged) 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	07/2018	£ 17	\$ 23	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	07/2018	\$ 464	£ 347	0	(5)	(5)	(0,01)
BPS	07/2018	16	12	0	0	0	0,00
BRC	07/2018	£ 365	\$ 477	0	(6)	(6)	0,00
	08/2018	\$ 478	£ 365	5	0	5	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
CBK	07/2018	£ 4	\$ 5	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2018	\$ 463	£ 349	0	(2)	(2)	0,00
GLM	07/2018	11	8	0	0	0	0,00
SCX	07/2018	£ 7	\$ 9	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 462	£ 347	0	(3)	(3)	0,00
SSB	07/2018	£ 3	\$ 3	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 62	£ 47	0	0	0	0,00
UAG	07/2018	£ 362	\$ 479	1	0	1	0,00
	08/2018	\$ 480	£ 362	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 7	\$ (17)	\$ (10)	(0,01)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 657	0,53

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVERMOGENS
<b>ENLAGENZERTIFIKATE</b>			
Credit Suisse AG			
2,722 % fallig am 28.09.2018	\$ 2.000	\$ 2.002	1,63
Summe Anlagen		\$ 116.763	95,09
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 6.033	4,91
Nettovermogen		\$ 122.796	100,00

### ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf Null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.

(c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Hohem von USD 6.323 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

(f) Gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 487 und Barmittel in Hohem von USD 1.776 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

(g) Pensionsgeschafte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Falligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschafte, zum Wert	Zu erhaltende Erlose aus Pensionsgeschaft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermogens
BPG	2,220 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 23.000	U.S. Treasury Notes 2,500 % fallig am 15.05.2024	\$ (23.465)	\$ 23.000	\$ 23.003	18,73
SSB	0,085	29.06.2018	02.07.2018	1.100	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fallig am 15.11.2021	(1.123)	1.100	1.100	0,90
Summe Pensionsgeschafte						\$ (24.588)	\$ 24.100	\$ 24.103	19,63

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

#### Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 11.945	\$ 102.272	\$ 0	\$ 114.217
Einlagen bei Kreditinstituten	0	2.002	0	2.002
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(208)	752	0	544
Summen	\$ 11.737	\$ 105.026	\$ 0	\$ 116.763

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 19.341	\$ 106.194	\$ 0	\$ 125.535
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	435	755	0	1.190
Summen	\$ 19.776	\$ 106.949	\$ 0	\$ 126.725

<sup>(1)</sup> Zwecks zusatzlicher Informationen siehe Erlauterung 3 in den Erlauterungen zum Abschluss.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (2)	\$ 0	\$ (2)
BOA	31	0	31
BPS	761	(550)	211
BRC	(44)	0	(44)
CBK	(136)	0	(136)
DUB	1	0	1
FBF	(212)	275	63
GLM	(1.365)	1.452	87
HUS	(113)	0	(113)
IND	(51)	0	(51)
JPM	1.184	(1.500)	316
MSB	310	(270)	40
NGF	(260)	270	10
RBC	373	(660)	287
RYL	(2)	0	(2)
SCX	(139)	0	(139)
SOG	34	0	34
SSB	321	(260)	61
TOR	(3)	2	(1)
UAG	(31)	0	(31)

(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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse	35,68	49,00
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	33,69	33,16
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	23,65	11,50
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,17)	0,33
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,08	(0,03)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,53	0,59
Einlagenzertifikate	1,63	0,00

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.05.2021	\$	128.300	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.05.2021	\$	121.700
U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.04.2021		78.100	U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.04.2021		77.576
United Kingdom Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2018	£	14.000	Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 15.01.2018	¥	510.000
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 25.04.2018	\$	9.800			
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 27.04.2018		8.600	<b>AKTIEN</b>		
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 25.04.2018		8.300	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	379.525	3.800
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 26.04.2018		8.200	Facebook, Inc. 'A'	11.297	1.988
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 03.05.2018		6.900		<b>PARI (000S)</b>	
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 06.07.2018		6.300	Morgan Stanley 3,292 % fällig am 22.07.2022	\$	1.500
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 24.04.2018		6.200		<b>AKTIEN</b>	
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 21.06.2018		3.800	LyondellBasell Industries NV 'A'	6.655	€ 723
Macquarie Bank Ltd. 2,600 % fällig am 24.06.2019		3.000	Texas Instruments, Inc.	6.201	\$ 700
			United Technologies Corp.	5.142	689
<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>		281.054	Danaher Corp.	7.083	686
			UnitedHealth Group, Inc.	2.848	646
	<b>PARI (000S)</b>		Fidelity National Information Services, Inc.	6.579	640
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 29.06.2018	\$	2.800	3M Co.	2.596	635
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 23.04.2018	¥	290.000	Honeywell International, Inc.	4.058	626
			CVS Health Corp.	8.696	614
			American Tower Corp.	4.109	572
				<b>PARI (000S)</b>	
<b>Facebook, Inc. 'A'</b>		11.297	eBay, Inc. 3,229 % fällig am 30.01.2023	\$	200
			Synchrony Financial 3,584 % fällig am 03.02.2020		50
<b>Central Nippon Expressway Co Ltd 2,803 % fällig am 15.02.2022</b>	\$	2.000	(a) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.		
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 04.05.2018		1.700			
Daimler Finance North America LLC 2,753 % fällig am 04.05.2020		1.100	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.		
Morgan Stanley 2,903 % fällig am 10.02.2021		900	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>YORKSHIRE WATER SERVICES BRADFORD FINANCE LTD.</b> 3,625 % fällig am 01.08.2029	£	300	0,08	<b>GLOBALWORTH REAL ESTATE INVESTMENTS LTD.</b> 3,000 % fällig am 29.03.2025	€	100	0,02
				Summe Cayman Inseln		5.284	1,22	Summe Guernsey, Kanalinseln		2.276	0,52
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>DÄNEMARK</b>				<b>HONGKONG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
APT Pipelines Ltd. 3,500 % fällig am 22.03.2030	£	550	0,13	AP Moller - Maersk A/S 4,000 % fällig am 04.04.2025	£	1.700	0,41	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3,880 % fällig am 25.05.2023	\$	300	0,05
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0,625 % fällig am 21.02.2023	€	700	0,14	Danske Bank A/S 5,875 % fällig am 06.04.2022	€(g)	800	0,18	<b>IRLAND</b>			
Goodman Australia Finance Pty. Ltd. 1,375 % fällig am 27.09.2025		400	0,08	Orsted A/S 4,875 % fällig am 12.01.2032	£	250	0,07	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Scentre Group Trust 3,750 % fällig am 23.03.2027	\$	600	0,10	Summe Dänemark		2.856	0,66	AerCap Ireland Capital DAC 4,500 % fällig am 15.05.2021		600	0,10
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 1,750 % fällig am 26.04.2028	€	700	0,14	<b>FINNLAND</b>				GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 18.01.2033	£	1.850	0,56
3,375 % fällig am 30.04.2025	\$	100	0,02	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe		2.890	0,66
Westfield America Management Ltd. 2,125 % fällig am 30.03.2025	£	2.500	0,57	Ahstrom-Munksjo Oyj 1,875 % fällig am 09.06.2022	€	100	0,02	<b>AKTIEN</b>			
2,625 % fällig am 30.03.2029	£	1.400	0,32	Teollisuuden Voima OYJ 2,000 % fällig am 08.05.2024		200	0,04	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
Summe Australien		6.522	1,50	Summe Finnland		268	0,06	PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (f)		2.500	0,56
<b>BELGIEN</b>				<b>FRANKREICH</b>				PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (f)	416.680	42.449	9,78
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe		42.672	9,83
Anheuser-Busch InBev S.A. 2,250 % fällig am 24.05.2029	€	2.500	0,55	AXA S.A. 5,125 % fällig am 04.07.2043	€	100	0,02	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
KBC Group NV 4,250 % fällig am 24.10.2025	€	1.400	0,26	5,625 % fällig am 16.01.2054	£	1.700	0,42	Taurus UK DAC 1,473 % fällig am 17.11.2027	£	350	0,08
UCB S.A. 1,875 % fällig am 02.04.2022		300	0,07	BNP Paribas S.A. 5,750 % fällig am 24.01.2022		450	0,12	Summe Irland		45.913	10,57
Summe Belgien		3.813	0,88	BPCE S.A. 5,250 % fällig am 16.04.2029		1.000	0,26	<b>ITALIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				CNP Assurances 4,750 % fällig am 27.06.2028	€	400	0,08	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Belgium Government International Bond 1,125 % fällig am 21.12.2018	£	1.740	0,40	Credit Agricole S.A. 7,500 % fällig am 23.06.2026	€	300	0,07	Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027	€	850	0,19
Summe Belgien		5.556	1,28	Dexia Credit Local S.A. 1,625 % fällig am 08.12.2023		1.400	0,32	UniCredit SpA 6,625 % fällig am 03.06.2023		1.501	0,30
<b>BRASILIEN</b>				Electricite de France S.A. 5,125 % fällig am 22.09.2050		1.200	0,34	Summe Italien		2.229	0,51
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,500 % fällig am 27.03.2037		1.300	0,37	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Petrobras Global Finance BV 4,375 % fällig am 20.05.2023	\$	1.600	0,26	6,000 % fällig am 22.01.2114	\$	600	0,11	Berica ABS SRL 0,000 % fällig am 31.12.2055		110	0,02
8,750 % fällig am 23.05.2026		700	0,14	6,000 % fällig am 23.01.2114	£	300	0,09	Summe Italien		2.229	0,51
Summe Brasilien		1.714	0,40	Engie S.A. 5,000 % fällig am 01.10.2060		200	0,07	<b>JERSEY, KANALINSELN</b>			
<b>KANADA</b>				Ingenico Group S.A. 1,625 % fällig am 13.09.2024	€	700	0,14	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Orange S.A. 5,250 % fällig am 05.12.2025	£	1.000	0,28	AA Bond Co. Ltd. 2,875 % fällig am 31.07.2043	£	3.378	0,76
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	€	1.600	0,32	Teleperformance 1,875 % fällig am 02.07.2025 (a)	€	300	0,06	4,249 % fällig am 31.07.2043		1.500	0,36
Viterra, Inc. 5,950 % fällig am 01.08.2020	\$	100	0,02	Summe Frankreich		16.899	3,89	CPUK Finance Ltd. 3,588 % fällig am 28.02.2042		1.800	0,44
Summe Kanada		1.492	0,34	<b>DEUTSCHLAND</b>				Glencore Finance Europe Ltd. 6,000 % fällig am 03.04.2022		300	0,08
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Heathrow Funding Ltd. 2,750 % fällig am 09.08.2051		100	0,02
Province of Alberta 1,000 % fällig am 15.11.2021	£	1.300	0,30	ADLER Real Estate AG 1,875 % fällig am 27.04.2023		1.800	0,36	5,875 % fällig am 13.05.2043		100	0,03
Summe Kanada		2.780	0,64	Deutsche Bank AG 4,250 % fällig am 14.10.2021	£	2.000	0,45	6,450 % fällig am 10.12.2031		300	0,10
<b>CAYMAN INSELN</b>				IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	€	100	0,02	6,750 % fällig am 03.12.2028		400	0,12
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,000 % fällig am 06.12.2018	£	1.800	0,42	HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig am 05.11.2031 (e)		1.450	0,42
QNB Finance Ltd. 3,705 % fällig am 12.02.2020	\$	800	0,14	5,750 % fällig am 07.06.2032		400	0,14	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,950 % fällig am 30.06.2022		1.719	0,41
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd. 1,875 % fällig am 24.01.2024	£	100	0,02	Summe Deutschland		7.147	1,65	Kennedy Wilson Europe Real Estate PLC 3,950 % fällig am 30.06.2022		200	0,05
2,625 % fällig am 24.01.2032		500	0,11	<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>				Summe Jersey, Kanalinseln		12.116	2,79
3,500 % fällig am 25.02.2028		400	0,10	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
5,500 % fällig am 11.02.2041		100	0,03	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,750 % fällig am 26.03.2025	\$	1.050	0,17				
Trafford Centre Finance Ltd. 1,435 % fällig am 28.07.2038		2.400	0,52	3,800 % fällig am 09.06.2023		1.900	0,33				
4,750 % fällig am 28.04.2029		500	0,12								
6,500 % fällig am 28.07.2033		86	0,03								
7,030 % fällig am 28.01.2029		174	0,05								
8,280 % fällig am 28.10.2022		94	0,02								





BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS
Charter Communications Operating LLC				Morgan Stanley				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
4,500 % fällig am 01.02.2024	\$ 100	£ 76	0,02	2,625 % fällig am 09.03.2027	£ 600	£ 592	0,14	Fannie Mae	\$ 14	£ 11	0,00
(a)				Navient Corp.	\$ 100	76	0,02	2,664 % fällig am 01.07.2044	24	19	0,00
CIT Group, Inc.	100	75	0,02	Physicians Realty LP	100	73	0,02	3,704 % fällig am 01.08.2036	4.000	2.932	0,68
4,125 % fällig am 09.03.2021				Prologis LP	1.800	1.709	0,39	Fannie Mae, TBA	5.000	3.765	0,87
Citigroup, Inc.	£ 760	895	0,21	2,250 % fällig am 30.06.2029				3,000 % fällig am 01.08.2048			
5,150 % fällig am 21.05.2026				Rabobank Capital Funding Trust				3,500 % fällig am 01.08.2048			
Comcast Corp.	700	876	0,20	5,556 % fällig am 31.12.2019							
5,500 % fällig am 23.11.2029				(e)	400	417	0,10			6.727	1,55
CVS Health Corp.	\$ 900	679	0,16	SLM Student Loan Trust	1.163	1.124	0,26	Summe USA		59.059	13,60
3,700 % fällig am 09.03.2023				1,177 % fällig am 15.12.2039							
4,100 % fällig am 25.03.2025	600	453	0,10	Springleaf Finance Corp.	\$ 100	77	0,02	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
Digital Stout Holding LLC	£ 1.200	1.210	0,28	5,250 % fällig am 15.12.2019				<b>PENSIONSGESCHÄFTE (k)</b>		664	0,15
3,300 % fällig am 19.07.2029				Sprint Spectrum Co. LLC	300	226	0,05				
4,750 % fällig am 13.10.2023	600	665	0,15	4,738 % fällig am 20.03.2025				<b>U.K. TREASURY BILLS</b>			
Discovery Communications LLC	2.100	2.054	0,47	Time Warner Cable LLC	£ 1.700	1.862	0,43	0,344 % fällig am 19.11.2018	£ 3.560	3.552	0,82
2,500 % fällig am 20.09.2024				Verizon Communications, Inc.	200	192	0,04	(c)(d)(j)			
DISH DBS Corp.	\$ 100	79	0,02	3,125 % fällig am 02.11.2035	3.500	3.429	0,79	0,430 % fällig am 30.07.2018	144	144	0,03
7,875 % fällig am 01.09.2019				3,375 % fällig am 27.10.2036	\$ 157	114	0,03	0,430 % fällig am 28.08.2018	400	400	0,09
Dominion Energy Gas Holdings LLC	100	75	0,02	3,376 % fällig am 15.02.2025	1.400	992	0,23	(c)(d)(j)	190	190	0,04
2,800 % fällig am 15.11.2020				4,400 % fällig am 01.11.2034	£ 400	567	0,13	0,498 % fällig am 12.11.2018	20.620	20.577	4,74
EMC Corp.	100	74	0,02	Walmart, Inc.	1.000	964	0,22	(c)(d)	9.650	9.626	2,22
2,650 % fällig am 01.06.2020				Wells Fargo & Co.	700	695	0,16	0,500 % fällig am 03.12.2018	2.030	2.026	0,47
Equinix, Inc.	€ 1.100	956	0,22	2,000 % fällig am 28.07.2025	400	424	0,10	(c)(d)	2.270	2.265	0,52
2,875 % fällig am 15.03.2024				2,125 % fällig am 20.12.2023	500	602	0,14	0,525 % fällig am 03.12.2018	340	339	0,08
General Electric Co.	£ 1.900	2.160	0,50	3,500 % fällig am 12.09.2029	550	634	0,15	(c)(d)	410	409	0,10
4,875 % fällig am 18.09.2037				4,625 % fällig am 02.11.2035				0,550 % fällig am 12.11.2018	360	359	0,08
5,375 % fällig am 18.12.2040	700	904	0,21	4,875 % fällig am 29.11.2035				(c)(d)			
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 2.100	1.588	0,37	Welltower, Inc.	200	228	0,05				
3,150 % fällig am 15.01.2020				4,800 % fällig am 20.11.2028							
GlaxoSmithKline Capital, Inc.	1.461	1.120	0,26			50.550	11,64	Summe kurzfristige Instrumente		40.551	9,34
4,200 % fällig am 18.03.2043				<b>NON-AGENCY-MBS</b>							
Goldman Sachs Group, Inc.	£ 350	383	0,09	Deutsche ALT-A Securities, Inc.	\$ 226	166	0,04				
4,250 % fällig am 29.01.2026				2,591 % fällig am 25.04.2035	1.500	1.058	0,24	Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt	£ 460.993	106,15	
7,250 % fällig am 10.04.2028	900	1.224	0,28	HomeBanc Mortgage Trust							
HCA, Inc.	\$ 1.200	858	0,20	2,761 % fällig am 25.07.2035							
4,500 % fällig am 15.02.2027				Sequoia Mortgage Trust	18	12	0,00				
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	150	108	0,02	3,728 % fällig am 20.07.2037 ^	4	3	0,00				
4,250 % fällig am 01.09.2024				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust							
JPMorgan Chase & Co.	£ 650	700	0,16	3,756 % fällig am 25.02.2034	40	29	0,01				
3,500 % fällig am 18.12.2026				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
Kraft Heinz Foods Co.	1.300	1.404	0,32	2,758 % fällig am 25.11.2042							
4,125 % fällig am 01.07.2027						1.268	0,29				
Metropolitan Life Global Funding	1.500	1.663	0,38								
3,500 % fällig am 30.09.2026											
MGM Resorts International	\$ 100	80	0,02								
6,750 % fällig am 01.10.2020											

## 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
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 163,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	12	£ (3)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	29	18	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	192	(210)	(0,05)
Euro-Schatz September Futures	Long	09/2018	36	3	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 159,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2018 Futures	Short	08/2018	12	3	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	12	(55)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09/2018	258	418	0,10
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>£ 174</b>	<b>0,04</b>

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

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

### 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 Nettvermögens
ArcelorMittal	0,000 %	20.12.2022	€ 1.900	£ (55)	(0,02)
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.06.2023	\$ 1.000	(1)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2023	500	0	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2023	3.000	8	0,00
Lincoln National Corp.	1,000	20.12.2021	900	(3)	0,00
Schaeffler Finance BV	5,000	20.06.2022	€ 300	(10)	0,00
Shell International Finance BV	1,000	20.12.2026	800	(4)	0,00
Shell International Finance BV	1,000	20.06.2027	300	(1)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	600	0	0,00
				£ (66)	(0,02)

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250 %	21.06.2022	\$ 29.000	£ 469	0,11
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.12.2026	1.900	57	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	16.12.2020	1.600	21	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	15.06.2026	5.200	160	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	6.500	15	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	15.06.2046	200	12	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	19.09.2020	€ 10.400	(25)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	3.700	(40)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.12.2028	9.500	103	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.09.2048	900	(28)	(0,01)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.09.2020	£ 65.000	224	0,05
Zahlung	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.12.2023	4.400	16	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	31.600	206	0,05
Zahlung	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.12.2048	600	6	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	2.500	(14)	0,00
Forderung	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 1.930.000	(73)	(0,02)
					£ 1.109	0,26
					£ 1.043	0,24

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	15.08.2018	€ 4.500	£ (6)	£ (4)	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	18.600	(33)	(53)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	23.600	(32)	(45)	(0,01)
MEI	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	19.900	(30)	(38)	(0,01)
						£ (101)	£ (140)	(0,03)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
BPS	Intesa Sanpaolo	1,000 %	20.06.2023	€ 300	£ (28)	£ (1)	£ (29)	(0,01)
CBK	Heathrow Funding Ltd.	1,000	20.06.2021	1.800	4	20	24	0,01
GST	Heathrow Funding Ltd.	1,000	20.06.2021	1.900	7	18	25	0,01
	Rio Tinto Finance USA Ltd.	1,000	20.12.2021	\$ 1.300	(11)	29	18	0,00
JPM	Heathrow Funding Ltd.	1,000	20.06.2021	€ 1.000	4	9	13	0,00
					£ (24)	£ 75	£ 51	0,01

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einerreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einerreditsicherheit 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	08/2018	€ 284	£ 250	£ 0	£ (1)	£ (1)	0,00
	08/2018	£ 711	\$ 943	2	0	2	0,00
BPS	08/2018	€ 521	€ 592	3	0	3	0,00
	08/2018	1.793	\$ 2.416	34	0	34	0,01
	08/2018	\$ 851	£ 632	0	(12)	(12)	0,00
CBK	08/2018	£ 430	€ 486	1	0	1	0,00
	08/2018	¥ 23.200	£ 156	0	(3)	(3)	0,00
HUS	08/2018	£ 625	€ 708	2	0	2	0,00
	08/2018	512	\$ 684	6	0	6	0,00
JPM	08/2018	\$ 53.290	£ 39.165	0	(1.122)	(1.122)	(0,26)
MSB	08/2018	£ 1.143	\$ 1.549	28	0	28	0,01
	08/2018	\$ 788	£ 591	0	(5)	(5)	0,00
RBC	08/2018	€ 7.572	6.683	0	(22)	(22)	(0,01)
RYL	08/2018	442	390	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	£ 739	€ 840	4	0	4	0,00
	08/2018	\$ 700	£ 522	0	(7)	(7)	0,00
SCX	08/2018	€ 31.472	27.637	0	(229)	(229)	(0,06)
	08/2018	£ 6.098	\$ 8.281	162	0	162	0,04
SOG	08/2018	€ 896	€ 1.017	5	0	5	0,00
	08/2018	\$ 1.952	£ 1.466	0	(10)	(10)	0,00
TOR	08/2018	395	295	0	(4)	(4)	0,00
				£ 247	£ (1.416)	£ (1.169)	(0,27)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

£ (1.258) (0,29)

Summe Anlagen

£ 460.952 106,14

Sonstige Aktiva und Passiva

£ (26.652) (6,14)

Nettovermögen

£ 434.300 100,00

#### 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) 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

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Thames Water Utilities Finance Ltd.	5,050 %	30.06.2020	19.10.2017	£ 1.284	£ 1.280	0,29

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 28.154 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von GBP 4.857 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 1.352 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 877	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	£ (681)	£ 664	£ 664	0,15
Summe Pensionsgeschäfte						£ (681)	£ 664	£ 664	0,15

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	£ 42.449	£ 418.544	£ 0	£ 460.993
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	174	(215)	0	(41)
<b>Summen</b>	<b>£ 42.623</b>	<b>£ 418.329</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 460.952</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	£ 43.771	£ 459.482	£ 0	£ 503.253
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(247)	1.090	(1)	842
<b>Summen</b>	<b>£ 43.524</b>	<b>£ 460.572</b>	<b>£ (1)</b>	<b>£ 504.095</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 der Wertpapieranlagen.

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

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
IND	0,650 %	02.05.2018	05.07.2018	£ (27.578)	£ (27.607)	(6,36)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>£ (27.607)</b>	<b>(6,36)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	£ 1	£ 0	£ 1
BPS	(8)	0	(8)
CBK	22	0	22
CKL	(98)	0	(98)
GST	43	0	43
HUS	8	0	8
JPM	(1.109)	1.352	243
MEI	(38)	0	(38)
MSB	23	0	23
RBC	(22)	0	(22)
RYL	(4)	0	(4)
SCX	(67)	0	(67)
SOG	(5)	0	(5)
TOR	(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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse	87,98	93,76
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	17,13	10,73
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,04	0,20
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,24	0,04
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,29)	0,19
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(6,36)	(5,70)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des UK Corporate Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
United Kingdom Treasury Bills 0,000 % fällig am 12.11.2018	£ 20.980	£ 20.928	United Kingdom Treasury Bills 0,000 % fällig am 19.03.2018	£ 27.100	£ 27.083
United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 03.12.2018	9.990	9.966	United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 25.06.2018	7.160	7.157
United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 05.11.2018	8.190	8.171			
United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 25.06.2018	7.160	7.147			
			<b>AKTIEN</b>		
PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a)	43.000	4.380	PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a)	50.850	5.176
			<b>PARI (000S)</b>		
United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 19.11.2018	£ 3.560	3.551	UBS AG 7,625 % fällig am 17.08.2022	\$ 4.700	3.834
Barclays PLC 3,250 % fällig am 17.01.2033	3.200	3.195	United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 05.11.2018	£ 3.700	3.693
UniCredit SpA 6,625 % fällig am 03.06.2023	€ 3.201	3.194	Barclays PLC 3,250 % fällig am 17.01.2033	3.200	3.158
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3,250 % fällig am 15.04.2022	3.500	3.124	Amgen, Inc. 5,500 % fällig am 07.12.2026	2.350	2.880
AA Bond Co. Ltd. 4,249 % fällig am 31.07.2043	£ 2.500	2.636	Liberty Living Finance PLC 2,625 % fällig am 28.11.2024	2.300	2.317
Amgen, Inc. 4,000 % fällig am 13.09.2029	2.350	2.620	United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 30.07.2018	2.156	2.155
United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 28.08.2018	2.370	2.368	Volkswagen Financial Services NV 1,750 % fällig am 12.09.2022	2.100	2.105
United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 30.07.2018	2.300	2.296	United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 28.08.2018	1.970	1.968
Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 17.10.2041	1.700	2.266	Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 4,250 % fällig am 06.04.2024	1.500	1.576
Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027	€ 1.850	2.073	Southern Electric Power Distribution PLC 5,500 % fällig am 07.06.2032	1.200	1.548
Citigroup, Inc. 7,625 % fällig am 03.04.2018	£ 2.000	2.005	UniCredit SpA 6,625 % fällig am 03.06.2023	€ 1.700	1.520
Belgium Government International Bond 1,125 % fällig am 21.12.2018	€ 1.740	1.749	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 3,000 % fällig am 26.06.2027	\$ 2.100	1.454
TDC A/S 5,625 % fällig am 23.02.2023	£ 1.500	1.680	Royal Bank of Scotland Group PLC 2,500 % fällig am 22.03.2023	€ 1.500	1.415
Verizon Communications, Inc. 3,375 % fällig am 27.10.2036	1.600	1.625	Koninklijke KPN NV 5,000 % fällig am 18.11.2026	£ 1.200	1.400
AT&T, Inc. 3,55 % fällig am 14.09.2037	1.600	1.612	AT&T, Inc. 3,400 % fällig am 15.05.2025	\$ 2.000	1.383
Experian Finance PLC 2,125 % fällig am 27.09.2024	1.600	1.593	Enel SpA 5,750 % fällig am 22.06.2037	£ 1.050	1.307
ADLER Real Estate AG 1,875 % fällig am 27.04.2023	1.800	1.559	TDC A/S 5,625 % fällig am 23.02.2023	1.200	1.282
RMAC PLC 1,543 % fällig am 12.06.2046	1.500	1.500	Orange S.A. 5,250 % fällig am 05.12.2025	1.000	1.211
			Lloyds Bank PLC 0,914 % fällig am 27.03.2023	1.200	1.201
			Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 2,750 % fällig am 08.08.2025	1.100	1.125

(a) Der UK Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>Electricite de France S.A.</b>				<b>UniCredit SpA</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>5,125 % fällig am 22.09.2050</b>				<b>6,625 % fällig am 03.06.2023 (c)(e)</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>5,500 % fällig am 27.03.2037</b>				<b>Italy Government International Bond</b>			
<b>APT Pipelines Ltd.</b>				<b>5,500 % fällig am 17.10.2041</b>				<b>6,000 % fällig am 04.08.2028</b>			
<b>3,500 % fällig am 22.03.2030</b>				<b>6,000 % fällig am 22.01.2114</b>				<b>Summe Italien</b>			
<b>£ 700</b>				<b>£ 723</b>				<b>4,257</b>			
<b>1,107</b>				<b>0,17</b>				<b>1,987</b>			
<b>1,107</b>				<b>0,26</b>				<b>1,00</b>			
<b>Westfield America Management Ltd.</b>				<b>6,000 % fällig am 23.01.2114</b>				<b>JAPAN</b>			
<b>2,125 % fällig am 30.03.2025</b>				<b>Orange S.A.</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>£ 300</b>				<b>5,000 % fällig am 01.10.2060</b>				<b>East Japan Railway Co.</b>			
<b>2,625 % fällig am 30.03.2029</b>				<b>5,500 % fällig am 06.02.2044</b>				<b>4,500 % fällig am 25.01.2036</b>			
<b>3,650</b>				<b>5,625 % fällig am 23.01.2034</b>				<b>200</b>			
<b>5,733</b>				<b>1,35</b>				<b>256</b>			
<b>1,35</b>				<b>0,85</b>				<b>0,06</b>			
<b>Summe Australien</b>				<b>Veolia Environnement S.A.</b>				<b>GERSEY, KANALINSELN</b>			
<b>5,733</b>				<b>6,125 % fällig am 29.10.2037</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>1,155</b>				<b>0,27</b>				<b>AA Bond Co. Ltd.</b>			
<b>0,27</b>				<b>0,27</b>				<b>2,750 % fällig am 31.07.2043</b>			
<b>BERMUDAS</b>				<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				<b>4,249 % fällig am 31.07.2043</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>SNCF Reseau</b>				<b>Gatwick Funding Ltd.</b>			
<b>Anheuser-Busch InBev S.A.</b>				<b>5,000 % fällig am 11.03.2052</b>				<b>3,125 % fällig am 28.09.2041</b>			
<b>2,850 % fällig am 25.05.2037</b>				<b>Summe Frankreich</b>				<b>Heathrow Funding Ltd.</b>			
<b>1,200</b>				<b>5,07</b>				<b>2,750 % fällig am 09.08.2051</b>			
<b>1,155</b>				<b>0,19</b>				<b>4,625 % fällig am 31.10.2046</b>			
<b>0,27</b>				<b>5,07</b>				<b>5,875 % fällig am 13.05.2043</b>			
<b>BRASILIEN</b>				<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>6,450 % fällig am 10.12.2031</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>HSBC Bank Capital Funding Sterling LP</b>			
<b>Petrobras Global Finance BV</b>				<b>ADLER Real Estate AG</b>				<b>5,844 % fällig am 05.11.2031 (c)</b>			
<b>4,375 % fällig am 20.05.2023</b>				<b>1,875 % fällig am 27.04.2023</b>				<b>Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.</b>			
<b>\$ 2,100</b>				<b>€ 1,700</b>				<b>3,950 % fällig am 30.06.2022</b>			
<b>102</b>				<b>1,466</b>				<b>3,850</b>			
<b>79</b>				<b>0,35</b>				<b>12,979</b>			
<b>0,02</b>				<b>0,35</b>				<b>3,05</b>			
<b>0,02</b>				<b>0,33</b>				<b>LUXEMBURG</b>			
<b>Summe Brasilien</b>				<b>Deutsche Bank AG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>1,573</b>				<b>1,875 % fällig am 28.02.2020</b>				<b>Aroundtown S.A.</b>			
<b>0,37</b>				<b>€ 100</b>				<b>3,000 % fällig am 16.10.2029</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,02</b>				<b>2,985</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,33</b>				<b>0,70</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,33</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
<b>0,37</b>				<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>1,573</b>				<b>5,750 % fällig am 07.06.2032</b>				<b>Cooperative Rabobank UA</b>			
<b>0,37</b>				<b>€ 400</b>				<b>4,000 % fällig am 19.09.2022</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,14</b>				<b>4,625 % fällig am 23.05.2029</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,14</b>				<b>5,250 % fällig am 14.09.2027</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>6,910 % fällig am 10.06.2038 (c)</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>750</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>1,500</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>1,101</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,26</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>E.ON International Finance BV</b>			
<b>0,37</b>				<b>Summe Deutschland</b>				<b>5,875 % fällig am 30.10.2037</b>			
<b>0,37</b>				<b>3,581</b>				<b>3,000</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>4,069</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,96</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>1,415</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>1,929</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,45</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>6,650 % fällig am 30.04.2038</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>\$ 200</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>186</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,04</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>Enel Finance International NV</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>5,750 % fällig am 14.09.2040</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>£ 1,100</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>1,402</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,33</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>innogy Finance BV</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>4,750 % fällig am 31.01.2034</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>4,300</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>5,085</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>1,19</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>6,125 % fällig am 06.07.2039</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>1,750</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>2,461</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,58</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>JAB Holdings BV</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>2,500 % fällig am 25.06.2029</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>€ 400</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>356</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,08</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>Koninklijke KPN NV</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>5,750 % fällig am 17.09.2029</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>£ 800</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>989</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,23</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>LafargeHolcim Sterling Finance Netherlands BV</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>3,000 % fällig am 12.05.2032</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>500</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>474</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,11</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>Niederlande Waterschapsbank NV</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>5,375 % fällig am 07.06.2032</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>500</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>704</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,17</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>NN Group NV</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>4,500 % fällig am 15.01.2026 (c)</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>€ 1,000</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>915</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,22</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>4,625 % fällig am 13.01.2048</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>700</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>652</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,15</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>Schaeffler Finance BV</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>4,750 % fällig am 15.05.2023</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>\$ 700</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>528</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,12</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>Stichting AK Rabobank Certificaten</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>6,500 % (c)</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>€ 800</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>841</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,20</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>Summe Niederlande</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>24,296</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>5,70</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>SINGAPUR</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>Temasek Financial Ltd.</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>5,125 % fällig am 26.07.2040</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>£ 2,950</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>4,345</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>1,02</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>ITALIEN</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>Intesa Sanpaolo SpA</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>7,750 % fällig am 11.01.2027 (c)(e)</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>€ 700</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>669</b>			
<b>0,37</b>				<b>0,84</b>				<b>0,16</b>			

BESCHREIBUNG	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTOVER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTOVER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTOVER- MÖGENS
<b>SPANIEN</b>								<b>BESCHREIBUNG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>BESCHREIBUNG</b>			
Cadent Finance PLC				2,125 % fällig am 22.09.2028				Lloyds Banking Group PLC			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				2,750 % fällig am 22.09.2046				2,250 % fällig am 16.10.2024			
6,750 % fällig am 18.02.2020 (c)(e)				€ 200 € 185				7,625 % fällig am 27.06.2023 (c)(e)			
7,000 % fällig am 19.02.2019 (c)(e)				200 181				7,875 % fällig am 27.06.2029 (c)(e)			
Banco Santander S.A.				100 93				London & Quadrant Housing Trust Ltd.			
6,250 % fällig am 11.09.2021 (c)(e)				0,02				3,125 % fällig am 28.02.2053			
Telefonica Emisiones S.A.U.				€ 500 605				Manchester Airport Group Funding PLC			
5,445 % fällig am 08.10.2029				0,14				2,875 % fällig am 31.03.2039			
Summe Spanien				1.064 0,25				Marks & Spencer PLC			
								4,750 % fällig am 12.06.2025			
								1.900 2.082			
								0,49			
								Mitchells & Butlers Finance PLC			
								2.506 % fällig am 15.09.2034			
								993 822			
								0,19			
								2.791 % fällig am 15.12.2030			
								739 528			
								0,12			
								5.965 % fällig am 15.12.2025			
								242 265			
								0,06			
								6.013 % fällig am 15.12.2030			
								587 679			
								0,16			
								6.469 % fällig am 15.09.2032			
								900 1.045			
								0,25			
								Motability Operations Group PLC			
								2.375 % fällig am 14.03.2032			
								1.100 1.062			
								0,25			
								5.625 % fällig am 29.11.2030			
								200 266			
								0,06			
								Network Rail Infrastructure Finance PLC			
								4.750 % fällig am 29.11.2035			
								2.000 2.852			
								0,67			
								Next PLC			
								3.625 % fällig am 18.05.2028			
								1.500 1.509			
								0,35			
								Northern Gas Networks Finance PLC			
								4.875 % fällig am 30.03.2027			
								57 68			
								0,02			
								5.625 % fällig am 23.03.2040			
								106 150			
								0,04			
								Northern Powergrid Yorkshire PLC			
								5.125 % fällig am 04.05.2035			
								810 1.061			
								0,25			
								Notting Hill Housing Trust			
								3.250 % fällig am 12.10.2048			
								1.000 990			
								0,23			
								Places for People Homes Ltd.			
								3.625 % fällig am 22.11.2028			
								2.700 2.748			
								0,65			
								5.875 % fällig am 23.05.2031			
								1.100 1.365			
								0,32			
								Prudential PLC			
								5.000 % fällig am 20.07.2055			
								3.700 3.745			
								0,88			
								6.125 % fällig am 19.12.2031			
								100 122			
								0,03			
								RAC Bond Co. PLC			
								4.565 % fällig am 06.05.2046			
								450 470			
								0,11			
								4.870 % fällig am 06.05.2046			
								1.500 1.563			
								0,37			
								RHP Finance PLC			
								3.250 % fällig am 05.02.2048			
								800 815			
								0,19			
								Rio Tinto Finance PLC			
								4.000 % fällig am 11.12.2029			
								1.000 1.152			
								0,27			
								Riverside Finance PLC			
								3.875 % fällig am 05.12.2044			
								2.200 2.506			
								0,59			
								Royal Bank of Scotland Group PLC			
								2.875 % fällig am 19.09.2026			
								400 395			
								0,09			
								3.498 % fällig am 15.05.2023			
								500 367			
								0,09			
								4.519 % fällig am 25.06.2024			
								600 455			
								0,11			
								4.800 % fällig am 05.04.2026			
								1.300 992			
								0,23			
								8.625 % fällig am 15.08.2021 (c)(e)			
								500 403			
								0,09			
								Santander UK Group Holdings PLC			
								4.750 % fällig am 15.09.2025			
								1.700 1.260			
								0,30			
								7.375 % fällig am 24.06.2022 (c)(e)			
								€ 1.050 1.095			
								0,26			
								Santander UK PLC			
								5.750 % fällig am 02.03.2026			
								1.000 1.281			
								0,30			
								Severn Trent Utilities Finance PLC			
								2.750 % fällig am 05.12.2031			
								900 889			
								0,21			
								4.875 % fällig am 24.01.2042			
								400 515			
								0,12			
								6.250 % fällig am 07.06.2029			
								423 563			
								0,13			
								Shop Direct Funding PLC			
								7.750 % fällig am 15.11.2022			
								400 346			
								0,08			
								Sky PLC			
								4.000 % fällig am 26.11.2029			
								1.800 2.018			
								0,47			
								Society of Lloyd's			
								4.750 % fällig am 30.10.2024			
								1.000 1.077			
								0,25			
								South Eastern Power Networks PLC			
								5.625 % fällig am 30.09.2030			
								932 1.196			
								0,28			
								Southern Electric Power Distribution PLC			
								5.500 % fällig am 07.06.2032			
								800 1.039			
								0,24			
								Southern Gas Networks PLC			
								3.100 % fällig am 15.09.2036			
								1.200 1.206			
								0,28			
								4.875 % fällig am 21.03.2029			
								1.569 1.892			
								0,44			
								Spirit Issuer PLC			
								3.368 % fällig am 28.12.2031			
								1.140 1.126			
								0,26			
								5.472 % fällig am 28.12.2034			
								1.147 1.201			
								0,28			
								6.582 % fällig am 28.12.2027			
								414 424			
								0,10			



BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS
<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (d)	51.596	£ 391	0,09
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt	£ 521.801	122,47	

**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
Euro-Bobl September Futures	Long	09/2018	33	£ 18	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2018	42	27	0,01
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	186	(203)	(0,05)
Euro-Schatz September Futures	Long	09/2018	50	4	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	8	(36)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09/2018	466	251	0,06
				£ 61	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				£ 61	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-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
ArcelorMittal	0,000 %	20.12.2022	€ 1.600	£ (46)	(0,01)
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2023	\$ 1.500	32	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2023	3.000	8	0,00
Lincoln National Corp.	1,000	20.12.2021	1.400	19	0,00
Schaeffler Finance BV	5,000	20.06.2022	€ 400	(14)	0,00
Shell International Finance BV	1,000	20.12.2026	600	26	0,01
Shell International Finance BV	1,000	20.06.2027	500	15	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	600	0	0,00
				£ 40	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
Rolls-Royce PLC	1,000 %	20.12.2022	€ 900	£ (1)	0,00

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250 %	21.06.2022	\$ 28.400	£ 537	0,13
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.06.2047	2.200	56	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	16.12.2020	4.700	58	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	7.100	27	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	2.400	453	0,11
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	15.06.2046	5.400	758	0,18
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	1.500	59	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	19.09.2020	€ 23.100	(54)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	4.600	(50)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.12.2028	13.700	148	0,03
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	£ 35.400	(231)	(0,06)
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,500	21.03.2068	2.500	56	0,01
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 1.710.000	(56)	(0,01)
					£ 1.761	0,41
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					£ 1.800	0,42

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds 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.

### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	15.08.2018	€ 4.100	£ (6)	£ (4)	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	18.100	(32)	(52)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	27.400	(37)	(52)	(0,02)
MEI	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	25.300	(38)	(48)	(0,01)
						£ (113)	£ (156)	(0,04)

##### 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	Intesa Sanpaolo	1,000 %	20.06.2023	€ 900	£ (83)	£ (6)	£ (89)	(0,02)
CBK	Heathrow Funding Ltd.	1,000	20.06.2021	2.900	7	31	38	0,01
GST	Heathrow Funding Ltd.	1,000	20.06.2021	2.200	8	21	29	0,01
	Rio Tinto Finance USA Ltd.	1,000	20.12.2021	\$ 2.700	(24)	63	39	0,01
	SSE PLC	1,000	20.06.2019	€ 600	3	2	5	0,00
JPM	Heathrow Funding Ltd.	1,000	20.06.2021	1.300	5	12	17	0,00
					£ (84)	£ 123	£ 39	0,01

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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 (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08/2018	€ 267	£ 235	£ 0	£ (1)	£ (1)	0,00
	08/2018	£ 531	\$ 704	2	0	2	0,00
BPS	08/2018	1.528	€ 1.737	10	0	10	0,01
	08/2018	2.277	\$ 3.076	48	0	48	0,01
CBK	08/2018	549	€ 621	1	0	1	0,00
	08/2018	¥ 18.900	£ 127	0	(2)	(2)	0,00
	08/2018	\$ 1.802	1.321	0	(41)	(41)	(0,01)
GLM	08/2018	£ 352	€ 402	4	0	4	0,00
HUS	08/2018	€ 315	£ 276	0	(3)	(3)	0,00
	08/2018	£ 624	€ 707	2	0	2	0,00
	08/2018	1.230	\$ 1.645	13	0	13	0,01
JPM	08/2018	\$ 60.415	£ 44.401	0	(1.272)	(1.272)	(0,30)
RBC	08/2018	€ 7.562	6.674	0	(22)	(22)	(0,01)
	08/2018	£ 1.082	€ 1.230	8	0	8	0,00
	08/2018	525	\$ 700	4	0	4	0,00
RYL	08/2018	558	740	1	0	1	0,00
	08/2018	\$ 1.046	£ 780	0	(10)	(10)	0,00
SCX	08/2018	€ 17.437	15.312	0	(127)	(127)	(0,03)
	08/2018	£ 6.922	\$ 9.382	171	0	171	0,04
	08/2018	\$ 916	£ 685	0	(8)	(8)	0,00
SOG	08/2018	€ 140	123	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	£ 717	€ 814	3	0	3	0,00
	08/2018	574	\$ 770	8	0	8	0,00
	08/2018	\$ 715	£ 537	0	(4)	(4)	0,00
TOR	08/2018	2.429	1.806	0	(30)	(30)	(0,01)
				£ 275	£ (1.521)	£ (1.246)	(0,29)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						£ (1.363)	(0,32)
Summe Anlagen						£ 522.299	122,58
Sonstige Aktiva und Passiva						£ (96.223)	(22,58)
Nettovermögen						£ 426.076	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) Nullkuponwertpapier.

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

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

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 106.032 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von GBP 5.135 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 1.352 und Barmittel in Höhe von GBP 1.746 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(h) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 1.038	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	£ (804)	£ 786	£ 786	0,18
Summe Pensionsgeschäfte						£ (804)	£ 786	£ 786	0,18

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

**Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	£ 38.747	£ 483.054	£ 0	£ 521.801
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	61	437	0	498
<b>Summen</b>	<b>£ 38.808</b>	<b>£ 483.491</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 522.299</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	£ 1.595	£ 502.119	£ 0	£ 503.714
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(12)	2.231	(1)	2.218
<b>Summen</b>	<b>£ 1.583</b>	<b>£ 504.350</b>	<b>£ (1)</b>	<b>£ 505.932</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 der Wertpapieranlagen.

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:**

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
IND	0,650 %	02.05.2018	05.07.2018	£ (6.418)	£ (6.425)	(1,51)
					(14.874)	(3,49)
SCX	0,600	02.05.2018	05.07.2018	(83.861)	(83.944)	(19,70)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					£ (105.243)	(24,70)

**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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	£ 1	£ 0	£ 1
BPS	(35)	0	(35)
CBK	(4)	0	(4)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
CKL	£ (104)	£ 0	£ (104)
GLM	4	0	4
GST	73	0	73
HUS	12	0	12
JPM	(1.255)	1.746	491
MEI	(48)	0	(48)
RBC	(10)	0	(10)
RYL	(9)	0	(9)
SCX	36	0	36
SOG	6	0	6
TOR	(30)	0	(30)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse	113,19	110,63
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	8,09	4,87
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,19	0,39
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,42	0,27
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,32)	0,24
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(24,70)	(19,07)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des UK Long Term Corporate Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a)	761.000	£ 77.482	PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a)	384.500	£ 39.143
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 18.06.2018	£ 6.210	6.199	United Kingdom Treasury Bills 0,000 % fällig am 18.06.2018	£ 6.210	6.199
Clarion Funding PLC 3,125 % fällig am 19.04.2048	3.400	3.367	United Kingdom Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.04.2018	6.000	5.997
Barclays PLC 3,250 % fällig am 17.01.2033	3.000	2.995	United Kingdom Treasury Bills 0,000 % fällig am 26.03.2018	5.850	5.845
United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 05.11.2018	2.950	2.943	Koninklijke KPN NV 5,750 % fällig am 17.09.2029	2.400	2.991
UniCredit SpA 6,625 % fällig am 03.06.2023	€ 2.900	2.893	Enel SpA 5,750 % fällig am 22.06.2037	2.400	2.989
British Telecommunications PLC 3,125 % fällig am 21.11.2031	£ 2.400	2.454	United Kingdom Treasury Bill 0,000 % fällig am 05.11.2018	2.640	2.634
Citigroup, Inc. 7,625 % fällig am 03.04.2018	2.220	2.226	UBS AG 7,625 % fällig am 17.08.2022	\$ 3.100	2.546
Lloyds Banking Group PLC 2,250 % fällig am 16.10.2024	1.950	1.908	Lloyds Bank PLC 7,625 % fällig am 22.04.2025	£ 1.950	2.518
Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027	€ 1.700	1.907	Cadent Finance PLC 2,750 % fällig am 22.09.2046	2.300	2.149
Verizon Communications, Inc. 3,375 % fällig am 27.10.2036	£ 1.800	1.828	El Group PLC 6,875 % fällig am 09.05.2025	1.710	1.913
United Kingdom Treasury Bills 0,000 % fällig am 12.11.2018	1.650	1.646	British Telecommunications PLC 3,125 % fällig am 21.11.2031	1.800	1.780
Telereal Securitisation PLC 5,948 % fällig am 10.12.2031	1.231	1.534	GlaxoSmithKline Capital PLC 5,250 % fällig am 19.12.2033	1.300	1.722
ADLER Real Estate AG 1,875 % fällig am 27.04.2023	€ 1.700	1.472	Barclays PLC 3,250 % fällig am 17.01.2033	1.500	1.434
Citigroup Inc 3,878 % fällig am 24.01.2039	\$ 2.000	1.446	RAC Bond Co. PLC 4,870 % fällig am 06.05.2046	1.300	1.353
Places for People Homes Ltd. 3,625 % fällig am 22.11.2028	£ 1.400	1.427	TDC A/S 5,625 % fällig am 23.02.2023	1.250	1.336
RMAC PLC 1,543 % fällig am 12.06.2046	1.400	1.400	Northern Powergrid Yorkshire PLC 4,375 % fällig am 05.07.2032	1.100	1.299
Unique Pub Finance Co. PLC 5,659 % fällig am 30.06.2027	1.163	1.292	Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 4,250 % fällig am 06.04.2024	1.200	1.261
Southern Gas Networks PLC 3,100 % fällig am 15.09.2036	1.200	1.197	UniCredit SpA 6,625 % fällig am 03.06.2023	€ 1.400	1.236
Prudential PLC 5,000 % fällig am 20.07.2055	1.000	1.148	Apple, Inc. 3,600 % fällig am 31.07.2042	£ 1.000	1.179
			Electricite de France S.A. 6,000 % fällig am 22.01.2114	\$ 1.500	1.160
			AT&T, Inc. 4,250 % fällig am 01.06.2043	£ 1.000	1.069
			Assicurazioni Generali SpA 5,500 % fällig am 27.10.2047	€ 1.100	1.053
			UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024	\$ 1.400	1.047

(a) Der UK Long Term Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.











BESCHREIBUNG	MARKT-			% DES	BESCHREIBUNG	MARKT-			% DES	BESCHREIBUNG	MARKT-			% DES	
	PARI	WERT	NETTOVER-			PARI	WERT	NETTOVER-			PARI	WERT	NETTOVER-		
	(000S)	(000S)	MÖGENS		(000S)	(000S)	MÖGENS		(000S)	(000S)	MÖGENS				
<b>Qatar Government International Bond</b>					<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>					<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>					
3,875 % fällig am 23.04.2023	\$	4.900	4.906	0,21	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (k)</b>					11,659 % fällig am 09.10.2018 (d)(e) EGP	84.800	\$	4.524	0,19	
4,500 % fällig am 23.04.2028		2.400	2.427	0,10		\$	7.136	0,30		11,767 % fällig am 25.09.2018 (d)(e)	19.500		1.045	0,05	
<b>Republic of Greece Government International Bond</b>					<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>								5.569	0,24	
3,500 % fällig am 30.01.2023	€	154	183	0,01	<b>Letras del Banco Central de la Republica Argentina</b>					<b>GREECE TREASURY BILLS</b>					
3,750 % fällig am 30.01.2028		360	414	0,02	25,600 % fällig am 18.07.2018	ARS	3.178	108	0,01	0,706 % fällig am 02.11.2018 (d)(e)	€	10.400	12.106	0,52	
3,900 % fällig am 30.01.2033		2.035	2.223	0,10	33,500 % fällig am 18.07.2018		1.250	42	0,00	1,082 % fällig am 05.10.2018 (d)(e)		2.000	2.330	0,10	
4,000 % fällig am 30.01.2037		1.120	1.198	0,05	37,800 % fällig am 21.11.2018		2.900	87	0,00				14.436	0,62	
4,200 % fällig am 30.01.2042		1.732	1.852	0,08	40,700 % fällig am 18.07.2018		7.150	243	0,01				33.333	1,42	
4,750 % fällig am 17.04.2019		700	842	0,04				545	0,02	<b>Summe kurzfristige Instrumente</b>					
<b>Saudi Government International Bond</b>					<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>										
2,375 % fällig am 26.10.2021	\$	550	529	0,02	(14,311)% fällig am 14.09.2018 (d)(e)		2.040	74	0,00	<b>AKTIEN</b>					
3,250 % fällig am 26.10.2026		1.800	1.690	0,07	(12,971)% fällig am 14.09.2018 (d)(e)		2.617	95	0,00	<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>					
3,250 % fällig am 26.10.2026		4.000	3.812	0,16	(5,317)% fällig am 14.09.2018 (d)(e)		660	24	0,00	<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. -</b>					
4,500 % fällig am 17.04.2030		11.000	11.008	0,47	(4,791)% fällig am 14.09.2018 (d)(e)		2.820	103	0,01	<b>PIMCO US Dollar</b>					
4,500 % fällig am 26.10.2046		2.700	2.499	0,11	(4,684)% fällig am 14.09.2018 (d)(e)		5.600	204	0,01	<b>Short-Term Floating</b>					
4,625 % fällig am 04.10.2047		4.400	4.112	0,18	(3,506)% fällig am 14.09.2018 (d)(e)		1.350	49	0,00	<b>NAV Fund (h)</b>	723.364		7.243	0,31	
			76.099	3,25	(3,361)% fällig am 14.09.2018 (d)(e)		3.280	119	0,01	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>					
					(3,247)% fällig am 12.10.2018 (d)(e)		4.080	144	0,01	<b>und Geldmarktinstrumente –</b>					
					(3,154)% fällig am 14.09.2018 (d)(e)		1.580	58	0,00	<b>Amliche Börse/Geregelter Markt</b>			\$	2.692.302	114,82
					(2,723)% fällig am 12.10.2018 (d)(e)		790	28	0,00						
					(0,978)% fällig am 12.10.2018 (d)(e)		11.290	399	0,02						
					0,946 % fällig am 12.10.2018 (d)(e)		3.310	117	0,01						
					0,980 % fällig am 10.08.2018 (d)(e)	\$	1.800	1.792	0,08						
					1,138 % fällig am 24.08.2018 (d)(e)		1.700	1.691	0,07						
					1,457 % fällig am 12.10.2018 (d)(e)	ARS	2.650	94	0,00						
					25,750 % fällig am 19.09.2018 (d)(e)		3.250	103	0,00						
					25,800 % fällig am 19.09.2018 (d)(e)		8.060	256	0,01						
					39,900 % fällig am 19.09.2018 (d)(e)		9.350	297	0,01						
								5.647	0,24						

## 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
90-Day Eurodollar June Futures	Short	06/2019	3.559	\$ 8.121	0,35
Euro-Bobl September Futures	Short	09/2018	18	(14)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09/2018	632	(1.974)	(0,08)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	61	(49)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2018	3	15	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	1.654	(460)	(0,02)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09/2018	25	(114)	(0,01)
				\$ 5.525	0,24

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 118,000	27.07.2018	391	\$ (97)	\$ (12)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	119,500	27.07.2018	335	(143)	(63)	(0,01)
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	121,500	27.07.2018	335	(128)	(37)	0,00
				\$ (368)	\$ (112)	(0,01)
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>					\$ 5.413	0,23

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Unconstrained Bond 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>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000 %	20.09.2018	\$ 16.900	\$ (112)	(0,01)
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.09.2020	16.300	(51)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.03.2023	1.600	4	0,00
Citigroup, Inc.	1,000	20.03.2019	6.400	(34)	0,00
Daimler AG	1,000	20.12.2020	€ 1.100	(1)	0,00
DISH DBS Corp.	5,000	20.09.2021	\$ 2.500	(199)	(0,01)
Ford Motor Co.	5,000	20.03.2019	13.600	(516)	(0,02)
MetLife, Inc.	1,000	20.03.2019	8.900	(55)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2021	14.300	19	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2022	5.600	19	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2022	7.200	(10)	0,00
Morgan Stanley	1,000	20.03.2019	2.000	(10)	0,00
				\$ (946)	(0,04)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-29 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2022	\$ 13.900	\$ 114	0,00
iTraxx Europe Main 26 5-Year Index	(1,000)	20.12.2021	€ 6.900	22	0,00
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000)	20.12.2022	26.800	209	0,01
iTraxx Europe Senior 27 5-Year Index	(1,000)	20.06.2022	21.300	181	0,01
				\$ 526	0,02

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,500 %	02.01.2020	BRL 672.900	\$ (1.490)	(0,06)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	16.12.2018	\$ 97.500	1.369	0,06
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.12.2026	68.790	7.483	0,32
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	16.12.2019	323.350	12.154	0,52
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.06.2023	301.600	1.132	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	15.06.2026	4.400	198	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	154.070	(523)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	41.400	(674)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.09.2023	€ 107.100	1.778	0,07
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	19.12.2023	4.200	42	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.09.2048	22.400	(795)	(0,03)
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	1,250	19.12.2023	£ 5.800	(29)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2023	122.300	(1.162)	(0,05)
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	2,000	18.03.2022	13.200	(105)	(0,01)
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	2,050	23.09.2019	29.200	649	0,03
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.03.2026	¥ 6.050.000	723	0,03
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	21.03.2028	970.000	(112)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	7.790.000	(965)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,350	30.09.2027	MXN 360.800	(619)	(0,03)
					\$ 19.054	0,81
					\$ 18.634	0,79

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

### FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* 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	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,000 %	04.12.2018	\$ 214.200	\$ 451	\$ 22	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,970	24.09.2018	29.400	1.496	727	0,03
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,970	24.09.2018	58.600	3.032	1.447	0,06
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,650	15.11.2018	234.400	1.330	5	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,050	12.12.2018	27.550	1.325	753	0,04
							\$ 7.634	\$ 2.954	0,13

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,600 %	24.09.2018	\$ 146.700	\$ (1.526)	\$ (2.396)	(0,10)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,173	04.12.2018	45.100	(451)	(30)	0,00
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,600	24.09.2018	292.800	(3.118)	(4.782)	(0,21)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,700	12.12.2018	137.700	(1.457)	(2.091)	(0,09)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,000	15.11.2018	50.400	(1.330)	(11)	0,00
							\$ (7.882)	\$ (9.310)	(0,40)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
SAL	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 98,195	05.07.2018	\$ 32.200	\$ (77)	\$ 0	0,00

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	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.06.2021	\$ 400	\$ (13)	\$ 16	\$ 3	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2018	24.500	106	(34)	72	0,00
	Russia Government International Bond	0,000	20.06.2023	12.300	(190)	(38)	(228)	(0,01)
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	600	(19)	24	5	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2021	100	(4)	4	0	0,00
BRC	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.06.2022	3.900	317	(197)	120	0,01
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	2.600	(84)	103	19	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2018	8.200	51	(21)	30	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	0,000	20.12.2022	1.800	(23)	14	(9)	0,00
DUB	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2018	2.600	(125)	126	1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	100	(3)	4	1	0,00
FBF	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2018	5.500	17	(1)	16	0,00
GST	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.06.2022	3.900	320	(200)	120	0,01
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2018	3.000	(140)	141	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.03.2019	300	(13)	13	0	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	1.900	(61)	75	14	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	1.900	(19)	10	(9)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.03.2019	1.300	1	(2)	(1)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	300	(9)	11	2	0,00
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	400	(13)	16	3	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.06.2019	26.800	549	(375)	174	0,01
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.09.2019	6.800	(136)	109	(27)	0,00
	California State General Obligation Bonds, Series 2003	1,000	20.09.2024	2.900	23	72	95	0,00
	Ohio State General Obligation Bonds, Series 2007	1,000	20.09.2019	1.600	47	(31)	16	0,00
					\$ 579	\$ (161)	\$ 418	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
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,000 %	17.11.2059	\$ 800	\$ (24)	\$ 20	\$ (4)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	11.000	(379)	330	(49)	(0,01)
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	10.900	(378)	330	(48)	0,00
					\$ (781)	\$ 680	\$ (101)	(0,01)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Unconstrained Bond Fund (Forts.)

## 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	07/2018	\$ 7.110	ARS 184.603	\$ 0	\$ (711)	\$ (711)	(0,03)	
	07/2018	11.590	AUD 15.700	10	0	10	0,00	
	07/2018	7.366	€ 6.275	0	(40)	(40)	0,00	
	08/2018	ARS 16.430	\$ 763	217	0	217	0,01	
	08/2018	AUD 15.700	11.591	0	(10)	(10)	0,00	
	08/2018	ILS 486	135	2	0	2	0,00	
	09/2018	ARS 8.060	366	106	0	106	0,00	
	09/2018	SGD 24.794	18.672	457	0	457	0,02	
	10/2018	\$ 2.247	EGP 41.463	0	(2)	(2)	0,00	
	BPS	07/2018	ARS 251.970	\$ 9.179	446	0	446	0,02
07/2018		¥ 1.552.960	14.299	278	0	278	0,01	
07/2018		\$ 9.100	ARS 251.970	0	(449)	(449)	(0,02)	
07/2018		104.299	€ 89.642	363	0	363	0,02	
08/2018		ARS 3.480	\$ 162	46	0	46	0,00	
08/2018		€ 89.642	104.531	0	(358)	(358)	(0,02)	
08/2018		MXN 128.321	6.745	273	0	273	0,01	
07/2018		CAD 13.733	10.549	109	0	109	0,00	
07/2018		DKK 2.195	365	21	0	21	0,00	
07/2018		£ 39.727	52.633	184	0	184	0,01	
CBK	07/2018	\$ 45	ARS 1.180	0	(5)	(5)	0,00	
	07/2018	1.838	£ 1.368	0	(31)	(31)	0,00	
	07/2018	112	MXN 2.257	3	0	3	0,00	
	08/2018	MXN 19.781	\$ 971	0	(27)	(27)	0,00	
	08/2018	\$ 233	MXN 4.554	0	(4)	(4)	0,00	
	08/2018	11.540	RUB 717.957	0	(152)	(152)	(0,01)	
	07/2018	ARS 4.661	\$ 165	6	0	6	0,00	
	07/2018	BRL 45.997	11.699	0	(257)	(257)	(0,01)	
	07/2018	\$ 2.415	ARS 67.367	0	(80)	(80)	0,00	
	01/2021	1.081	BRL 4.740	16	0	16	0,00	
GLM	07/2018	AUD 15.700	\$ 11.802	202	0	202	0,01	
	07/2018	BRL 26.533	7.083	187	0	187	0,01	
	07/2018	€ 3.993	4.676	23	(9)	14	0,00	
	07/2018	£ 834	1.112	11	0	11	0,00	
	07/2018	\$ 5.754	€ 4.885	4	(54)	(50)	0,00	
	07/2018	1.091	£ 810	0	(21)	(21)	0,00	
	08/2018	10.649	TRY 47.449	0	(482)	(482)	(0,02)	
	07/2018	ARS 7.288	\$ 343	95	0	95	0,00	
	07/2018	\$ 39	ARS 1.024	0	(4)	(4)	0,00	
	07/2018	10.322	CAD 13.733	118	0	118	0,01	
HUS	07/2018	1.639	€ 1.407	3	0	3	0,00	
	08/2018	ARS 4.170	\$ 193	55	0	55	0,00	
	08/2018	CAD 13.733	10.327	0	(118)	(118)	(0,01)	
	08/2018	\$ 18.118	RUB 1.132.391	0	(156)	(156)	(0,01)	
	09/2018	TWD 543.556	\$ 18.303	381	0	381	0,02	
	01/2021	BRL 4.740	731	0	(366)	(366)	(0,02)	
	07/2018	8.398	2.249	66	0	66	0,00	
	07/2018	€ 2.426	2.847	14	0	14	0,00	
	07/2018	£ 123	162	0	0	0	0,00	
	07/2018	\$ 121	MXN 2.441	3	0	3	0,00	
MSB	08/2018	ZAR 7.190	\$ 563	41	0	41	0,00	
	07/2018	\$ 21.642	BRL 80.928	0	(608)	(608)	(0,03)	
	07/2018	1.100	€ 953	12	0	12	0,00	
	08/2018	BRL 56.503	\$ 14.954	320	0	320	0,01	
	10/2018	\$ 1.150	EGP 21.122	0	(6)	(6)	0,00	
	11/2018	€ 4.300	\$ 5.228	160	0	160	0,01	
	07/2018	ARS 2.489	88	3	0	3	0,00	
	07/2018	\$ 2.057	EGP 39.274	119	0	119	0,01	
	09/2018	KRW 360.142	\$ 335	11	0	11	0,00	
	09/2018	\$ 1.314	INR 89.266	0	(25)	(25)	0,00	
SSB	07/2018	€ 95.348	\$ 110.399	0	(924)	(924)	(0,04)	
	10/2018	2.000	2.485	133	0	133	0,01	
	07/2018	\$ 14.135	¥ 1.552.960	0	(114)	(114)	0,00	
	08/2018	¥ 1.552.960	\$ 14.164	115	0	115	0,01	
	11/2018	€ 6.100	7.406	217	0	217	0,01	
	07/2018	\$ 50.914	£ 38.506	0	(77)	(77)	0,00	
	08/2018	£ 38.506	\$ 50.986	80	0	80	0,00	
	09/2018	HKD 7.300	932	0	0	0	0,00	
					\$ 4.910	\$ (5.090)	\$ (180)	(0,01)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Class Z AUD (Hedged) 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	07/2018	\$ 13.300	AUD 17.672	\$ 0	\$ (244)	\$ (244)	(0,01)
BOA	07/2018	AUD 17.216	\$ 12.709	0	(11)	(11)	0,00
	08/2018	\$ 12.710	AUD 17.216	12	0	12	0,00
BRC	07/2018	87	115	0	(2)	(2)	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
GLM	07/2018	AUD 17.885	\$ 13.140	\$ 1	\$ (75)	\$ (74)	0,00
	07/2018	\$ 13.166	AUD 17.514	0	(226)	(226)	(0,01)
	08/2018	12.664	17.239	75	0	75	0,00
HUS	07/2018	AUD 1.350	\$ 997	3	(3)	0	0,00
	07/2018	\$ 81	AUD 109	1	(1)	0	0,00
JPM	07/2018	13.240	17.462	0	(339)	(339)	(0,01)
RYL	07/2018	330	433	0	(10)	(10)	0,00
SSB	07/2018	161	216	0	(1)	(1)	0,00
TOR	07/2018	AUD 33	\$ 25	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 123	AUD 166	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 92	\$ (913)	\$ (821)	(0,03)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CHF (Hedged) Class und Class E CHF (Hedged) 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	07/2018	CHF 39	\$ 39	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2018	\$ 24.415	CHF 24.044	0	(200)	(200)	(0,01)
BPS	07/2018	CHF 41	\$ 41	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 1.166	CHF 1.160	3	0	3	0,00
BRC	07/2018	CHF 1.085	\$ 1.103	10	0	10	0,00
CBK	07/2018	992	995	0	(4)	(4)	0,00
	07/2018	\$ 24.805	CHF 24.500	0	(131)	(131)	(0,01)
GLM	07/2018	CHF 25.384	\$ 25.438	1	(127)	(126)	(0,01)
	07/2018	\$ 24.671	CHF 24.414	0	(84)	(84)	0,00
JPM	07/2018	23.676	23.572	123	0	123	0,01
	07/2018	CHF 23.457	\$ 23.674	50	0	50	0,00
SSB	08/2018	\$ 23.734	CHF 23.457	0	(51)	(51)	0,00
	07/2018	CHF 132	\$ 134	0	0	0	0,00
07/2018	\$ 407	CHF 400	0	(4)	(4)	0,00	
				\$ 187	\$ (601)	\$ (414)	(0,02)

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged) und Class G Retail EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 281.799	€ 240.065	\$ 0	\$ (1.511)	\$ (1.511)	(0,06)
BRC	07/2018	€ 185	\$ 218	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 5.689	€ 4.918	53	0	53	0,00
CBK	07/2018	€ 749	\$ 878	4	(1)	3	0,00
	07/2018	\$ 5.956	€ 5.140	59	(14)	45	0,00
GLM	07/2018	€ 1.470	\$ 1.716	2	(2)	0	0,00
	07/2018	243.374	281.097	0	(3.055)	(3.055)	(0,13)
RBC	08/2018	\$ 281.717	€ 243.374	3.052	0	3.052	0,13
	07/2018	€ 1.213	\$ 1.413	0	(3)	(3)	0,00
RYL	07/2018	2.927	3.428	11	0	11	0,00
	07/2018	\$ 1.072	€ 915	1	(5)	(4)	0,00
SCX	07/2018	€ 12.230	\$ 14.252	0	(28)	(28)	0,00
	07/2018	\$ 286.975	€ 247.708	2.246	(10)	2.236	0,10
SSB	07/2018	€ 242.237	\$ 281.988	0	(836)	(836)	(0,04)
	07/2018	\$ 287.859	€ 247.375	964	0	964	0,04
UAG	08/2018	282.614	242.237	824	0	824	0,04
	07/2018	7.020	6.058	53	0	53	0,00
				\$ 7.271	\$ (5.465)	\$ 1.806	0,08

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Hedged) Class und Class E GBP (Hedged) 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	07/2018	£ 31	\$ 41	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	07/2018	\$ 157.912	£ 118.266	0	(1.771)	(1.771)	(0,08)
	07/2018	£ 119.373	\$ 156.099	0	(1.503)	(1.503)	(0,06)
BRC	07/2018	\$ 6.617	£ 5.000	0	(16)	(16)	0,00
	08/2018	156.317	119.373	1.499	0	1.499	0,06
CBK	07/2018	159.359	120.282	0	(556)	(556)	(0,02)
	07/2018	£ 10.606	\$ 14.143	141	0	141	0,01
SCX	07/2018	\$ 164.146	£ 123.461	0	(1.147)	(1.147)	(0,05)
SSB	07/2018	£ 26	\$ 35	1	0	1	0,00
	07/2018	\$ 1.309	£ 1.000	11	0	11	0,00
UAG	07/2018	£ 118.602	\$ 156.822	237	0	237	0,01
	08/2018	\$ 157.044	£ 118.602	0	(247)	(247)	(0,01)
				\$ 1.889	\$ (5.240)	\$ (3.351)	(0,14)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Unconstrained Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional NOK (Hedged) Class 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	07/2018	NOK	89.628	\$	10.921	\$	0	(76)	(0,01)	
	07/2018	\$	11.800	NOK	96.183		1	0	0,00	
	08/2018		10.934		89.628		75	0	0,00	
GLM	07/2018	NOK	25.005	\$	3.083		16	0	0,00	
	07/2018	\$	11.780	NOK	97.660		202	0	0,01	
SCX	07/2018	NOK	89.389	\$	10.962		0	(5)	0,00	
	07/2018	\$	11.911	NOK	98.061		120	0	0,01	
SSB	08/2018		10.969		89.331		5	0	0,00	
	07/2018	NOK	445	\$	55		0	0	0,00	
UAG	07/2018	\$	252	NOK	2.055		0	0	0,00	
	07/2018	NOK	143	\$	18		0	0	0,00	
				\$	419	\$	(81)	\$	338	0,01

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional SEK (Hedged) Class und Administrative SEK (Hedged) Class 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	07/2018	SEK	602	\$	67	\$	0	0	0,00	
BRC	07/2018		234		27		1	0	0,00	
GLM	07/2018		1.197		136		2	0	0,00	
	07/2018	\$	18.440	SEK	161.468		0	(390)	(0,02)	
HUS	07/2018	SEK	643	\$	73		1	0	0,00	
IND	07/2018		164.211		18.210		2	(147)	(0,01)	
	08/2018	\$	18.182	SEK	163.613		147	0	0,01	
JPM	07/2018		18.539		164.267		0	(177)	(0,01)	
RBC	07/2018	SEK	307	\$	35		1	0	0,00	
	07/2018	\$	298	SEK	2.604		0	(7)	0,00	
RYL	07/2018	SEK	101	\$	12		0	0	0,00	
SCX	07/2018		162.290		18.225		85	0	0,00	
	08/2018	\$	18.267	SEK	162.290		0	(86)	0,00	
SOG	07/2018		18.353		163.517		0	(74)	0,00	
UAG	07/2018	SEK	531	\$	60		0	0	0,00	
				\$	239	\$	(881)	\$	(642)	(0,03)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (9.303) (0,40)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVERMÖGENS
<b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>			
Barclays Bank PLC 1,940 % fällig am 04.09.2018	\$ 6.600	\$ 6.596	0,28
Credit Suisse AG 2,722 % fällig am 28.09.2018	7.400	7.408	0,32
Summe Einlagenzertifikate		\$ 14.004	0,60
Summe Anlagen		\$ 2.721.050	116,04
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (376.157)	(16,04)
Nettovermögen		\$ 2.344.893	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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(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.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 73.909 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 52.331 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 22.050 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
NOM	1,950 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 6.400	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044	\$ (6.517)	\$ 6.400	\$ 6.400	0,27
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	736	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2019	(752)	736	736	0,03
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (7.269)</b>	<b>\$ 7.136</b>	<b>\$ 7.136</b>	<b>0,30</b>

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

#### Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 228.422	\$ 2.458.450	\$ 5.430	\$ 2.692.302
Einlagen bei Kreditinstituten	0	14.004	0	14.004
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	5.413	9.331	0	14.744
<b>Summen</b>	<b>\$ 233.835</b>	<b>\$ 2.481.785</b>	<b>\$ 5.430</b>	<b>\$ 2.721.050</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 233.027	\$ 2.608.318	\$ 6.218	\$ 2.847.563
Einlagen bei Kreditinstituten	0	6.601	0	6.601
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	3.388	50.836	(2)	54.222
<b>Summen</b>	<b>\$ 236.415</b>	<b>\$ 2.665.755</b>	<b>\$ 6.216</b>	<b>\$ 2.908.386</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 der Wertpapieranlagen.

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	2,100 %	08.06.2018	09.07.2018	\$ (44.012)	\$ (44.071)	(1,88)
GRE	1,920	17.04.2018	17.07.2018	(13.421)	(13.474)	(0,57)
	1,930	24.05.2018	18.07.2018	(4.153)	(4.161)	(0,18)
	2,060	21.05.2018	23.07.2018	(12.266)	(12.268)	(0,52)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (73.974)</b>	<b>(3,15)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (244)	\$ 280	\$ 36
BOA	(3.605)	8.080	4.475
BPS	607	(560)	47
BRC	213	(400)	(187)
CBK	(2.231)	3.230	999
DUB	(313)	20	(293)
FBF	16	0	16
GLM	(4.017)	4.120	103
GST	122	(370)	(248)
HUS	10	190	200
IND	2	0	2
JPM	(14)	280	266
MSB	(125)	50	(75)
MYC	(1.309)	1.131	(178)
NGF	3	0	3

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Unconstrained Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
RBC	\$ (9)	\$ 0	\$ (9)
RYL	(3)	(60)	(63)
SCX	1.285	2.350	3.635
SOG	(74)	0	(74)
SSB	168	1560	1.728
TOR	217	(280)	(63)
UAG	(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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse	61,32	63,57
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,22	43,02
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	6,28	6,14
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,23	0,13
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,79	1,60
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,04)	0,42
Einlagenzertifikate	0,60	0,26
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(3,15)	(13,73)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Unconstrained Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	24.194.379	\$ 242.231	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.05.2024	\$ 322.260	\$ 307.916
	<b>PARI (000S)</b>			<b>AKTIEN</b>	
U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.05.2024	\$ 142.800	136.240	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	24.730.238	247.600
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 07.05.2018	¥ 5.670.000	51.856		<b>PARI (000S)</b>	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2018	5.160.100	48.644	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.05.2021	\$ 45.200	44.919
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	5.140.000	48.394	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2024	39.672	39.474
Sierra Madre Funding Ltd. 2,425 % fällig am 07.09.2039	\$ 21.028	18.768	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.04.2024	35.200	33.568
QNB Finance Ltd. 3,713 % fällig am 07.02.2020	18.000	18.000	U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.08.2024	34.000	33.380
Banc of America Funding Trust 2,274 % fällig am 20.07.2036	12.656	12.427	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 30.06.2023	27.700	25.872
Saudi Government International Bond 4,500 % fällig am 17.04.2030	11.000	10.938	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.12.2023	24.700	23.992
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	8.073	9.373	U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 31.07.2023	25.750	23.866
Argentina Government International Bond 5,875 % fällig am 11.01.2028	7.700	7.628	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.07.2022	19.900	19.322
Intesa Sanpaolo SpA 3,875 % fällig am 12.01.2028	7.500	7.441	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.10.2024	18.520	17.845
Argentina Government International Bond 40,000 % fällig am 21.06.2020	ARS 135.504	7.320	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b)	13.479	15.219
Hellenic Republic Treasury Bill 0,000 % fällig am 02.11.2018	€ 6.100	7.268	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.11.2022	9.600	9.298
Royal Bank of Scotland Group PLC 4,519 % fällig am 25.06.2024	\$ 7.000	7.000	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2024	7.700	7.415
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 20.06.2018	6.400	6.400	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.01.2024	7.600	7.377
Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 21.06.2018	6.100	6.100	Letras del Banco Central de Argentina 27,700 % fällig am 18.04.2018	ARS 55.200	2.720
Citigroup, Inc. 4,044 % fällig am 01.06.2024	5.900	5.908	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.07.2022	\$ 2.600	2.512
AT&T, Inc. 2,975 % fällig am 01.06.2021	5.800	5.800	Letras del Banco Central de la Republica Argentina 27,700 % fällig am 16.05.2018	ARS 39.890	1.816
Egypt Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.10.2018	EGP 106.800	5.556	Lebac International 1,000 % fällig am 21.03.2018	33.700	1.653
			Altice France S.A. 5,625 % fällig am 15.05.2024	€ 1.00	1.571

(a) Der Unconstrained Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.











## 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.

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 119,000	27.07.2018	368	\$ (103)	\$ (34)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	120,500	27.07.2018	368	(114)	(121)	(0,01)
				\$ (217)	\$ (155)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (155)	(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 KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
CDX.HY-29 5-Year Index	5,000 %	20.12.2022	\$ 20.000	\$ (120)	0,00	
CDX.HY-30 5-Year Index	5,000	20.06.2023	65.000	(349)	(0,01)	
				\$ (469)	(0,01)	
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (469)	(0,01)

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

## VERKAUFSOPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	\$ 30.500	\$ (40)	\$ (10)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	2.200	(4)	0	0,00
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	3.400	(3)	(1)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	3.000	(5)	0	0,00
JPM	Put - OTC CDX.HY-30 5-Year Index	Verkauf	103,000	18.07.2018	14.600	(84)	(20)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	1.300	(1)	(1)	0,00
						\$ (137)	\$ (32)	0,00

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezählte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	10.000	20.03.2019	\$ (52)	\$ (58)	\$ (110)	0,00
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.000	20.03.2019	(18)	21	3	0,00
CBK	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR	10.000	20.09.2018	(49)	3	(46)	0,00
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.000	20.09.2018	(11)	37	26	0,00
GST	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	20.000	20.12.2018	(48)	(64)	(112)	(0,01)
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR	15.000	20.03.2019	(7)	(97)	(104)	0,00
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.000	20.03.2019	(9)	(21)	(30)	0,00
							\$ (194)	\$ (179)	\$ (373)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

### 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	07/2018	€ 1.400	\$ 1.649	\$ 15	\$ 0	\$ 15	0,00
BPS	07/2018	13.922	16.148	0	(107)	(107)	0,00
GLM	07/2018	2.951	3.483	37	0	37	0,00
	07/2018	£ 3.378	4.505	46	0	46	0,00
	07/2018	\$ 2.425	€ 2.089	14	0	14	0,00
HUS	07/2018	£ 167	\$ 219	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	\$ 1.545	€ 1.332	10	0	10	0,00
JPM	08/2018	3.051	¥ 333.000	0	(36)	(36)	0,00
SSB	07/2018	18.840	€ 16.184	56	0	56	0,00
	08/2018	€ 16.184	\$ 18.882	0	(55)	(55)	0,00
UAG	07/2018	\$ 4.467	£ 3.378	0	(7)	(7)	0,00
	08/2018	£ 3.378	\$ 4.473	7	0	7	0,00
				\$ 185	\$ (207)	\$ (22)	0,00

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class und Class E EUR (Hedged) 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	07/2018	\$ 212.822	€ 181.303	\$ 0	\$ (1.141)	\$ (1.141)	(0,04)
BRC	07/2018	€ 2.642	\$ 3.057	0	(28)	(28)	0,00
CBK	07/2018	928	1.097	14	(1)	13	0,00
GLM	07/2018	1.027	1.204	5	0	5	0,00
MSB	07/2018	195.272	225.540	0	(2.451)	(2.451)	(0,09)
	08/2018	\$ 226.037	€ 195.272	2.449	0	2.449	0,09
RBC	07/2018	€ 1.230	\$ 1.425	0	(11)	(11)	0,00
RYL	07/2018	13.884	16.254	45	0	45	0,00
SCX	07/2018	1.877	2.199	9	(2)	7	0,00
	07/2018	\$ 241.713	€ 208.650	1.897	0	1.897	0,07
SSB	07/2018	€ 194.616	\$ 226.552	0	(672)	(672)	(0,02)
	07/2018	\$ 243.069	€ 208.884	814	0	814	0,03
	08/2018	227.055	194.616	662	0	662	0,02
				\$ 5.895	\$ (4.306)	\$ 1.589	0,06

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) 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	07/2018	\$ 202	£ 150	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
BOA	07/2018	36.998	27.709	0	(415)	(415)	(0,02)
BRC	07/2018	£ 28.177	\$ 36.845	0	(355)	(355)	(0,01)
	08/2018	\$ 36.897	£ 28.177	354	0	354	0,01
CBK	07/2018	36.856	27.819	0	(129)	(129)	0,00
SCX	07/2018	36.877	27.740	0	(253)	(253)	(0,01)
SSB	07/2018	128	97	1	(1)	0	0,00
UAG	07/2018	£ 27.995	\$ 37.016	56	0	56	0,00
	08/2018	\$ 37.068	£ 27.995	0	(59)	(59)	0,00
				\$ 411	\$ (1.216)	\$ (805)	(0,03)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 357 0,02

Summe Anlagen

\$ 2.794.395 100,42

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (11.522) (0,42)

Nettovermogen

\$ 2.782.873 100,00

### ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (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) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

## (h) Eingeschränkte Wertpapiere

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
CHC Group LLC	0,000 %	01.10.2020	27.03.2017	\$ 426	\$ 552	0,02
Pinnacle Agriculture Holdings LLC	3,000		10.03.2017	380	178	0,01
				\$ 806	\$ 730	0,03

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 49.592 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 4.536 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 6.780 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

## (j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
JPS	2,210	29.06.2018	02.07.2018	\$ 82.300	U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.05.2022	\$ (84.055)	\$ 82.300	\$ 82.310	2,96
MFK	2,270	29.06.2018	02.07.2018	50.000	U.S. Treasury Bonds 3,750 % fällig am 15.11.2043	(50.855)	50.000	50.006	1,80
NOM	2,220	29.06.2018	02.07.2018	27.400	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044	(27.902)	27.400	27.403	0,98
SSB	0,8500	29.06.2018	02.07.2018	5.426	U.S. Treasury Bonds 8,000 % fällig am 15.11.2021	(5.537)	5.426	5.426	0,19
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (168.349)</b>	<b>\$ 165.126</b>	<b>\$ 165.145</b>	<b>5,93</b>

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

Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 100.916	\$ 2.691.233	\$ 2.513	\$ 2.794.662
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(155)	(112)	0	(267)
<b>Summen</b>	<b>\$ 100.761</b>	<b>\$ 2.691.121</b>	<b>\$ 2.513</b>	<b>\$ 2.794.395</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 3.145.828	\$ 2.506	\$ 3.148.334
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	10.818	0	10.818
<b>Summen</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 3.156.646</b>	<b>\$ 2.506</b>	<b>\$ 3.159.152</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 der Wertpapieranlagen.

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BCY	(2,750) %	03.05.2018	02.05.2020	\$ (2.537)	\$ (2.526)	(0,09)
	(1,000)	12.03.2018	09.03.2020	(813)	(810)	(0,03)
	(0,500)	27.09.2017	26.09.2019	(1.415)	(1.410)	(0,05)
	(0,250)	01.02.2018	31.01.2020	(4.249)	(4.245)	(0,15)
	(0,250)	23.03.2018	22.03.2020	(299)	(299)	(0,01)
	0,000	03.05.2018	02.05.2020	(926)	(926)	(0,04)
	0,000	18.06.2018	15.06.2020	(2.383)	(2.384)	(0,09)
	0,000	21.06.2018	20.06.2020	(1.171)	(1.171)	(0,04)
	0,250	03.05.2018	02.05.2020	(5.556)	(5.558)	(0,20)
	0,700	18.06.2018	15.06.2020	(2.808)	(2.809)	(0,10)
	0,750	28.06.2018	27.06.2020	(2.301)	(2.301)	(0,08)
	0,950	18.06.2018	15.06.2020	(3.367)	(3.368)	(0,12)
	1,450	18.06.2018	15.06.2020	(2.206)	(2.207)	(0,08)
	1,550	18.06.2018	15.06.2020	(2.154)	(2.155)	(0,08)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
NOM	2,000 %	12.06.2018	11.06.2020	\$ (2.034)	\$ (2.032)	(0,07)
UBS	0,000	22.06.2018	21.06.2020	(5.748)	(5.748)	(0,21)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (43.381)</b>	<b>(1,56)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (4)	\$ 0	\$ (4)
BOA	(1.658)	4.160	2.502
BPS	(107)	0	(107)
BRC	(29)	0	(29)
CBK	(137)	420	283
GLM	102	0	102
GST	(246)	0	(246)
HUS	8	0	8
JPM	(57)	30	(27)
MSB	(2)	0	(2)
RBC	(11)	0	(11)
RYL	45	0	45
SCX	1.651	590	2.241
SSB	805	1.580	2.385
UAG	(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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse	33,63	35,50
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	56,49	53,56
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	10,30	15,39
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,01)	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate	0,02	0,30
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,56)	(1,13)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US High Yield Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (a)	9.942.506	\$ 101.014	ZF North America Capital, Inc. 4,750 % fällig am 29.04.2025	\$ 8.000	\$ 8.106
	<b>PARI (000S)</b>		Ortho-Clinical Diagnostics, Inc. 6,625 % fällig am 15.05.2022	6.000	5.932
Pisces Midco Inc. 8,000 % fällig am 15.04.2026	\$ 10.750	10.750	Greatbatch Ltd. 9,125 % fällig am 01.11.2023	5.000	5.438
Matterhorn Merger Sub LLC 8,500 % fällig am 01.06.2026	10.000	9.978	SIG Combibloc Holdings S.C.A. 7,750 % fällig am 15.02.2023	€ 4.000	5.119
Aleris International Inc. 10,750 % fällig am 15.07.2023	8.000	8.036	Continental Resources, Inc. 3,800 % fällig am 01.06.2024	\$ 5.000	4.882
Radiate Holdco LLC 6,875 % fällig am 15.02.2023	7.250	7.250	Platform Specialty Products Corp. 6,500 % fällig am 01.02.2022	4.500	4.602
Sigma Holdco BV 7,875 % fällig am 15.05.2026	6.500	6.500	Genesys Telecommunications Laboratories, Inc. 10,000 % fällig am 30.11.2024	3.750	4.116
NVA Holdings Inc/United States 6,875 % fällig am 01.04.2026	6.000	5.996	Continental Resources, Inc. 4,500 % fällig am 15.04.2023	4.000	4.054
Nabors Industries, Inc. 5,750 % fällig am 01.02.2025	6.000	5.991	LSB Industries Inc. 9,625 % fällig am 01.05.2023	4.000	4.009
Diamond Resorts International, Inc. 10,750 % fällig am 01.09.2024	5.000	5.549	Conduent Finance, Inc. 10,500 % fällig am 15.12.2024	3.000	3.559
HUB International Ltd. 7,000 % fällig am 01.05.2026	5.500	5.500	Zekelman Industries, Inc. 9,875 % fällig am 15.06.2023	3.000	3.313
Diamond BC BV 5,625 % fällig am 15.08.2025	€ 5.000	5.353	AES Corp. 6,000 % fällig am 15.05.2026	3.000	3.173
Coty, Inc. 6,500 % fällig am 15.04.2026	\$ 5.500	5.335	Mallinckrodt International Finance S.A. 4,750 % fällig am 15.04.2023	4.000	3.168
Covey Park Energy LLC 7,500 % fällig am 15.05.2025	5.000	5.050	RSP Permian, Inc. 6,625 % fällig am 01.10.2022	3.000	3.143
Scientific Games International, Inc. 5,000 % fällig am 15.10.2025	5.000	5.000	HUB International Ltd. 7,875 % fällig am 01.10.2021	3.000	3.128
Extraction Oil & Gas, Inc. 5,625 % fällig am 01.02.2026	5.000	5.000	NRG Energy, Inc. 6,250 % fällig am 15.07.2022	3.000	3.094
GCP Applied Technologies Inc. 5,500 % fällig am 15.04.2026	5.000	4.988	Match Group, Inc. 5,000 % fällig am 15.12.2027	3.000	3.083
Jeld-Wen, Inc. 4,625 % fällig am 15.12.2025	5.000	4.781	Springs Industries, Inc. 6,250 % fällig am 01.06.2021	3.000	3.060
Jeld-Wen, Inc. 4,875 % fällig am 15.12.2027	5.000	4.755	Sprint Communications, Inc. 6,000 % fällig am 15.11.2022	3.000	3.053
Alpha 2 BV 8,750 % fällig am 01.06.2023	4.750	4.703	Digicel Group Ltd. 8,250 % fällig am 30.09.2020	3.000	3.004
Shelf Drilling Holdings Ltd. 8,250 % fällig am 15.02.2025	4.500	4.500	Cequel Communications Holdings LLC 5,125 % fällig am 15.12.2021	3.000	3.001
Flex Acquisition Co Inc. 7,875 % fällig am 15.07.2026	4.250	4.250	Barclays PLC 5,875 % fällig am 15.09.2024	£ 2.000	2.981
American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 5,875 % fällig am 15.05.2026	4.000	4.000	Intelsat Jackson Holdings S.A. 9,750 % fällig am 15.07.2025	\$ 3.000	2.971
GLP Capital LP 5,750 % fällig am 01.06.2028	4.000	4.000	Continental Resources, Inc. 4,900 % fällig am 01.06.2044	3.000	2.927
LSB Industries, Inc. 9,625 % fällig am 01.05.2023	4.000	3.980	Endo Dac 6,000 % fällig am 01.02.2025	4.000	2.873
			Community Health Systems, Inc. 6,875 % fällig am 01.02.2022	4.000	2.740
			INEOS Group Holdings S.A. 5,375 % fällig am 01.08.2024	€ 2.000	2.627
			Weatherford International Ltd. 4,500 % fällig am 15.04.2022	\$ 3.000	2.622
			Dollar Tree, Inc. 5,750 % fällig am 01.03.2023	2.500	2.613
			CPG Merger Sub LLC 8,000 % fällig am 01.10.2021	2.500	2.563
			Oasis Petroleum, Inc. 6,875 % fällig am 15.03.2022	2.500	2.553
			Hexion, Inc. 6,625 % fällig am 15.04.2020	2.500	2.330
			NXP BV 4,625 % fällig am 01.06.2023	2.125	2.183
			Valeant Pharmaceuticals International, Inc. 5,375 % fällig am 15.03.2020	2.123	2.118
			Sprint Corp. 7,250 % fällig am 15.09.2021	2.000	2.115

(a) Der US High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
Avolon Holdings Ltd. 4,088 % fällig am 15.01.2025	\$	298	0,17	Banco Santander Rio S.A. 25,500 % fällig am 17.07.2019	ARS	18.200	0,31	EPR Properties 4,750 % fällig am 15.12.2026	\$	100	0,06	
Brand Energy & Infrastructure Services, Inc. 6,584 % - 6,612 % fällig am 21.06.2024	\$	99	0,05	Banco Santander S.A. 4,379 % fällig am 12.04.2028	\$	200	0,11	4,950 % fällig am 15.04.2028	\$	100	0,06	
Las Vegas Sands, LLC 3,844 % fällig am 27.03.2025	1.986	1.975	1,11	Bank of America Corp. 2,816 % fällig am 21.07.2023	700	677	0,38	Equinix, Inc. 5,875 % fällig am 15.01.2026	100	102	0,06	
Level 3 Financing, Inc. 4,334 % fällig am 22.02.2024	1.100	1.099	0,62	2,816 % fällig am 21.07.2023	200	197	0,11	ERP Operating LP 3,250 % fällig am 01.08.2027	100	95	0,05	
Lightstone Generation LLC 5,844 % fällig am 30.01.2024	104	104	0,06	3,300 % fällig am 11.01.2023	700	690	0,39	Essex Portfolio LP 3,500 % fällig am 15.04.2025	525	508	0,29	
MH Sub LLC 5,835 % fällig am 13.09.2024	199	199	0,11	3,970 % fällig am 05.03.2029	1.950	1.983	1,12	Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	€	200	0,13	
Sequa Mezzanine Holdings LLC 7,046 % fällig am 28.11.2021	99	99	0,06	4,100 % fällig am 24.07.2023	100	96	0,05	First American Financial Corp. 4,300 % fällig am 01.02.2023	\$	100	0,06	
SS&C Technologies Holdings Europe SARL 4,594 % fällig am 16.04.2025	26	26	0,01	Bank of New York Mellon Corp. 3,250 % fällig am 16.05.2027	100	99	0,06	Flagstar Bancorp, Inc. 6,125 % fällig am 15.07.2021	200	210	0,12	
SS&C Technologies, Inc. 4,594 % fällig am 16.04.2025	68	69	0,04	Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 2,000 % fällig am 12.04.2019	100	99	0,06	Ford Motor Credit Co. LLC 2,943 % fällig am 08.01.2019	200	200	0,11	
		3.965	2,23	Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h)	900	971	0,55	3,434 % fällig am 03.08.2022	600	603	0,34	
				Barclays PLC 2,875 % fällig am 08.06.2020	300	297	0,17	3,589 % fällig am 15.02.2023	300	302	0,17	
				2,875 % fällig am 08.06.2020	200	196	0,11	Freedom Mortgage Corp. 8,125 % fällig am 15.11.2024	200	195	0,11	
				3,200 % fällig am 10.08.2021	200	196	0,11	GAIF Bond Issuer Pty. Ltd. 3,400 % fällig am 30.09.2026	500	469	0,26	
				3,250 % fällig am 12.02.2027	€	300	0,22	GE Capital International Funding Co. Unlimited Co. 4,418 % fällig am 15.11.2035	300	291	0,16	
				7,875 % fällig am 15.09.2022 (f)(h)	300	421	0,24	Global Bank Corp. 4,500 % fällig am 20.10.2021	200	195	0,11	
				BBVA Bancomer S.A. 6,500 % fällig am 10.03.2021	\$	400	0,24	Goldman Sachs Group, Inc. 3,472 % fällig am 26.04.2022	200	202	0,11	
				BNP Paribas S.A. 3,500 % fällig am 01.03.2023	200	195	0,11	3,500 % fällig am 23.01.2025	1.650	1.595	0,90	
				BOC Aviation Ltd. 3,413 % fällig am 02.05.2021	200	202	0,11	3,513 % fällig am 15.11.2021	900	911	0,51	
				BCE S.A. 2,750 % fällig am 11.01.2023	800	765	0,43	4,223 % fällig am 01.05.2029	900	888	0,50	
				Brookfield Finance LLC 4,000 % fällig am 01.04.2024	400	396	0,22	Horse Gallop Finance Ltd. 3,516 % fällig am 28.06.2021	600	600	0,34	
				Capital One Financial Corp. 3,115 % fällig am 12.05.2020	200	201	0,11	Host Hotels & Resorts LP 3,875 % fällig am 01.04.2024	100	98	0,06	
				CBL & Associates LP 5,950 % fällig am 15.12.2026	700	590	0,33	4,000 % fällig am 15.06.2025	100	97	0,05	
				CIT Group, Inc. 5,000 % fällig am 15.08.2022	100	101	0,06	HSBC Capital Funding LP 10,176 % fällig am 30.06.2030 (f)	400	608	0,34	
				Citigroup, Inc. 2,700 % fällig am 27.10.2022	1.300	1.250	0,70	HSBC Holdings PLC 3,950 % fällig am 18.05.2024	800	798	0,45	
				2,900 % fällig am 08.12.2021	100	98	0,06	4,300 % fällig am 08.03.2026	600	602	0,34	
				3,200 % fällig am 21.10.2026	100	93	0,05	6,000 % fällig am 29.03.2040	€	200	0,19	
				3,352 % fällig am 01.06.2024	900	902	0,51	6,250 % fällig am 23.03.2023 (f)(h)	\$	400	0,22	
				3,576 % fällig am 01.07.2026	200	200	0,11	ING Bank NV 5,800 % fällig am 25.09.2023	500	530	0,30	
				4,075 % fällig am 23.04.2029	400	393	0,22	ING Groep NV 4,700 % fällig am 22.03.2028	1.200	1.190	0,67	
				Citizens Bank N.A. 3,129 % fällig am 26.05.2022	400	400	0,23	Intercontinental Exchange, Inc. 3,750 % fällig am 01.12.2025	600	596	0,34	
				CME Group, Inc. 3,750 % fällig am 15.06.2028	200	202	0,11	Intesa Sanpaolo SpA 6,500 % fällig am 24.02.2021	700	726	0,41	
				Cooperatieve Rabobank UA 2,750 % fällig am 10.01.2022	250	244	0,14	7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h)	€	200	0,14	
				5,500 % fällig am 29.06.2020 (f)(h)	€	800	1,000	0,56	Itau Unibanco Holding S.A. 6,125 % fällig am 12.12.2022 (f)(h)	\$	400	0,21
				CPI Property Group S.A. 2,125 % fällig am 04.10.2024	600	689	0,39	6,500 % fällig am 19.03.2023 (f)(h)	800	760	0,43	
				Credit Agricole S.A. 3,750 % fällig am 24.04.2023	\$	250	0,14	Jackson National Life Global Funding 2,500 % fällig am 27.06.2022	100	96	0,05	
				Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	900	959	0,54	Jefferies Finance LLC 7,375 % fällig am 01.04.2020	700	707	0,40	
				Credit Suisse Group AG 2,997 % fällig am 14.12.2023	250	239	0,13	JPMorgan Chase & Co. 3,220 % fällig am 01.03.2025	200	193	0,11	
				3,566 % fällig am 12.06.2024	700	700	0,39	4,250 % fällig am 15.10.2020	1.400	1.328	0,75	
				3,574 % fällig am 09.01.2023	600	588	0,33	4,005 % fällig am 23.04.2029	500	494	0,28	
				Crown Castle International Corp. 3,150 % fällig am 15.07.2023	400	383	0,22	4,250 % fällig am 15.10.2020	1.900	1.943	1,09	
				4,450 % fällig am 15.02.2026	100	99	0,06	KBC Group NV 4,250 % fällig am 24.10.2025 (f)(h)	€	600	0,36	
				DBS Group Holdings Ltd. 2,811 % fällig am 08.06.2020	200	200	0,11	2,894 % fällig am 20.04.2022	\$	300	0,16	
				Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 28.02.2020	€	100	0,07	Lazard Group LLC 3,625 % fällig am 01.03.2027	100	94	0,05	
				3,150 % fällig am 22.01.2021	\$	600	0,33	3,750 % fällig am 13.02.2025	300	291	0,16	
				3,300 % fällig am 16.11.2022	200	188	0,11	Lloyds Banking Group PLC 4,375 % fällig am 22.03.2028	800	791	0,44	
				3,520 % fällig am 16.11.2022	500	484	0,27	4,450 % fällig am 08.05.2025	1.100	1.108	0,62	
				3,950 % fällig am 27.02.2023	300	288	0,16	7,875 % fällig am 27.06.2029 (f)(h)	€	300	0,26	
				Digital Realty Trust LP 4,450 % fällig am 15.07.2028	300	302	0,17					
				E*TRADE Financial Corp. 4,500 % fällig am 20.06.2028	200	201	0,11					

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS
Macquarie Bank Ltd. 2,662 % fällig am 04.04.2019	\$	300	0,17	UBS AG 2,780 % fällig am 01.12.2020	\$	300	0,17	Arrow Electronics, Inc. 3,250 % fällig am 08.09.2024	\$	100	0,05
Marsh & McLennan Cos., Inc. 3,500 % fällig am 10.03.2025		300	0,17	2,901 % fällig am 08.06.2020		600	0,34	Asciiano Finance Ltd. 4,750 % fällig am 22.03.2028		500	0,27
MGM Growth Properties Operating Partnership LP 4,500 % fällig am 15.01.2028		100	0,05	7,625 % fällig am 17.08.2022 (h)		350	0,22	Autodesk, Inc. 3,125 % fällig am 15.06.2020		25	0,01
Mid-America Apartments LP 4,200 % fällig am 15.06.2028		400	0,22	UBS Group Funding Switzerland AG 4,253 % fällig am 23.03.2028		300	0,17	Bacardi Ltd. 4,450 % fällig am 15.05.2025		500	0,28
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,190 % fällig am 13.09.2021	1.000	961	0,54	UDR, Inc. 3,500 % fällig am 15.01.2028		300	0,16	Baidu, Inc. 3,875 % fällig am 29.09.2023		200	0,11
3,150 % fällig am 25.07.2022	100	100	0,06	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 4,150 % fällig am 18.04.2023		400	0,22	BAT Capital Corp. 1,125 % fällig am 16.11.2023	€	100	0,07
3,455 % fällig am 02.03.2023	100	99	0,06	Ventas Realty LP 3,250 % fällig am 15.10.2026		400	0,21	3,557 % fällig am 15.08.2027	\$	700	0,37
Mizuho Financial Group, Inc. 3,207 % fällig am 11.09.2022	200	201	0,11	VEREIT Operating Partnership LP 4,125 % fällig am 01.06.2021		100	0,06	Bayer U.S. Finance LLC 2,965 % fällig am 25.06.2021		700	0,39
3,473 % fällig am 13.09.2021	300	305	0,17	4,875 % fällig am 31.10.2026		200	0,11	3,345 % fällig am 15.12.2023		500	0,28
Morgan Stanley 3,155 % fällig am 14.02.2020	1.300	1.304	0,73	Wand Merger Corp. 8,125 % fällig am 15.07.2023 (a)		300	0,17	3,500 % fällig am 25.06.2021		300	0,17
MUFG Bank Ltd 2,850 % fällig am 08.09.2021	500	491	0,28	Washington Prime Group LP 5,950 % fällig am 15.08.2024		200	0,11	3,875 % fällig am 15.12.2023		500	0,28
Nasdaq, Inc. 2,722 % fällig am 22.03.2019	200	200	0,11	WEA Finance LLC 3,250 % fällig am 05.10.2020		300	0,17	BC Unlimited Liability Co. 4,250 % fällig am 15.05.2024		100	0,05
Nationwide Building Society 4,000 % fällig am 14.09.2026	300	281	0,16	Wells Fargo & Co. 3,286 % fällig am 11.02.2022		100	0,06	BMC East LLC 5,500 % fällig am 01.10.2024		100	0,06
Navient Corp. 8,000 % fällig am 25.03.2020	200	212	0,12	3,469 % fällig am 24.01.2023		400	0,23	Braskem Finance Ltd. 6,450 % fällig am 03.02.2024		200	0,12
Omega Healthcare Investors, Inc. 4,375 % fällig am 01.08.2023	400	398	0,22	3,550 % fällig am 29.09.2025	1.500	1.455	0,82	Braskem Netherlands Finance BV 4,500 % fällig am 10.01.2028		200	0,10
Physicians Realty LP 3,950 % fällig am 15.01.2028	100	94	0,05	3,584 % fällig am 22.05.2028	100	96	0,05	Broadcom Corp. 3,625 % fällig am 15.01.2024		500	0,27
Prologis LP 3,875 % fällig am 15.09.2028	100	100	0,06	3,589 % fällig am 31.10.2023	200	204	0,11	3,875 % fällig am 15.01.2027	1.000	948	0,53
Protective Life Global Funding 2,762 % fällig am 29.03.2019	300	300	0,17	Wells Fargo Bank N.A. 2,964 % fällig am 06.12.2019	600	604	0,34	Builders FirstSource, Inc. 5,625 % fällig am 01.09.2024		100	0,06
Quicken Loans, Inc. 5,250 % fällig am 15.01.2028	200	185	0,10	Weyertower, Inc. 4,250 % fällig am 15.04.2028	300	295	0,17	Celgene Corp. 3,875 % fällig am 15.08.2025		300	0,16
5,750 % fällig am 01.05.2025	100	98	0,06	Weyerhaeuser Co. 4,625 % fällig am 15.09.2023	200	209	0,12	Cenovus Energy, Inc. 4,250 % fällig am 15.04.2027		300	0,16
Regency Centers LP 3,600 % fällig am 01.02.2027	200	190	0,11	7,375 % fällig am 15.03.2032	435	554	0,31	CenterPoint Energy Resources Corp. 3,550 % fällig am 01.04.2023		300	0,17
4,400 % fällig am 01.02.2047	100	96	0,05	WP Carey, Inc. 4,250 % fällig am 01.10.2026	300	294	0,17	CH Robinson Worldwide, Inc. 4,200 % fällig am 15.04.2028		200	0,11
Rio Oil Finance Trust 9,250 % fällig am 06.07.2024	170	183	0,10	XLIT Ltd. 6,375 % fällig am 15.11.2024	100	112	0,06	Charter Communications Operating LLC 4,043 % fällig am 01.02.2024 (a)		100	0,06
Royal Bank of Scotland Group PLC 2,000 % fällig am 08.03.2023	€	100	0,07					4,200 % fällig am 15.03.2028		700	0,37
4,892 % fällig am 18.05.2029	\$	1.000	0,56	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				4,464 % fällig am 23.07.2022		600	0,34
Santander Holdings USA, Inc. 2,700 % fällig am 24.05.2019		217	0,12	Activision Blizzard, Inc. 3,400 % fällig am 15.09.2026	800	761	0,43	5,750 % fällig am 01.04.2048		400	0,22
3,400 % fällig am 18.01.2023		300	0,16	Alliegon U.S. Holding Co., Inc. 3,550 % fällig am 01.10.2027	100	93	0,05	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5,875 % fällig am 31.03.2025		200	0,12
Santander UK Group Holdings PLC 3,373 % fällig am 05.01.2024		200	0,11	Alliegon Funding SCS 3,850 % fällig am 15.06.2024	500	492	0,28	Cheniere Energy Partners LP 5,250 % fällig am 01.10.2025		600	0,33
3,823 % fällig am 03.11.2028		200	0,10	Alliegon Sales LLC 5,000 % fällig am 15.12.2021	200	207	0,12	Comcast Corp. 2,350 % fällig am 15.01.2027		100	0,05
7,375 % fällig am 24.06.2022 (f)(h)	£	300	0,23	Alliance Data Systems Corp. 5,375 % fällig am 01.08.2022	100	101	0,06	3,150 % fällig am 01.03.2026		100	0,05
Santander UK PLC 3,400 % fällig am 01.06.2021	\$	300	0,17	5,375 % fällig am 01.11.2021	100	102	0,06	3,300 % fällig am 01.02.2027		200	0,11
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,500 % fällig am 26.02.2024 (h)		200	0,11	Altice France S.A. 5,375 % fällig am 15.05.2022	€	200	0,14	3,900 % fällig am 01.03.2038		100	0,05
SL Green Operating Partnership LP 3,250 % fällig am 15.10.2022		200	0,11	Amazon.com, Inc. 3,150 % fällig am 22.08.2027	\$	300	0,16	3,999 % fällig am 01.11.2049		100	0,05
SLM Corp. 5,125 % fällig am 05.04.2022		100	0,06	American Airlines Pass-Through Trust 3,350 % fällig am 15.04.2031		200	0,11	4,600 % fällig am 15.08.2045		300	0,16
Springleaf Finance Corp. 5,250 % fällig am 15.12.2019		100	0,06	5,250 % fällig am 31.07.2022	141	146	0,08	Community Health Systems, Inc. 8,625 % fällig am 15.01.2024 (a)		300	0,17
8,250 % fällig am 15.12.2020		300	0,18	American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 5,875 % fällig am 15.05.2026	200	198	0,11	Concho Resources, Inc. 4,300 % fällig am 15.08.2028 (a)		200	0,11
Stearns Holdings LLC 9,375 % fällig am 15.08.2020		200	0,11	Amgen, Inc. 4,663 % fällig am 15.06.2051	500	496	0,28	Continental Resources, Inc. 3,800 % fällig am 01.06.2024		100	0,06
STORE Capital Corp. 4,500 % fällig am 15.03.2028		200	0,11	Andeavor Logistics LP 5,250 % fällig am 15.01.2025	200	205	0,12	CRH America Finance, Inc. 3,400 % fällig am 09.05.2027		200	0,11
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,934 % fällig am 09.03.2021		500	0,28	Anthem, Inc. 2,950 % fällig am 01.12.2022	600	583	0,33	Crown Castle Towers LLC 3,720 % fällig am 15.07.2043 (a)		100	0,06
3,102 % fällig am 17.01.2023		200	0,11	4,101 % fällig am 01.03.2028	200	196	0,11	CVS Health Corp. 4,300 % fällig am 25.03.2028		500	0,28
3,495 % fällig am 19.10.2021		300	0,17	AP Moller - Maersk A/S 2,550 % fällig am 22.09.2019	400	396	0,22	CVS Pass-Through Trust 5,789 % fällig am 10.01.2026		96	0,06
4,007 % fällig am 09.03.2021		300	0,17	Apple, Inc. 2,850 % fällig am 11.05.2027	500	484	0,27	6,036 % fällig am 10.12.2028		63	0,04
Tesco Property Finance PLC 5,661 % fällig am 13.10.2041	£	295	0,25	APT Pipelines Ltd. 4,250 % fällig am 15.07.2027	250	245	0,14	D.R. Horton, Inc. 4,375 % fällig am 15.09.2022		200	0,12
Toyota Motor Credit Corp. 2,721 % fällig am 17.05.2022	\$	100	0,06					5,750 % fällig am 15.08.2023		100	0,06
								DAE Funding LLC 5,000 % fällig am 01.08.2024		100	0,05



BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS
<b>ENERGY</b>				<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Qatar Government International Bond</b>			
Energy Corp.				Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2017				3,875 % fällig am 23.04.2023	500	501	0,28
2,950 % fällig am 01.09.2026	\$ 400	\$ 366	0,21	7,045 % fällig am 01.01.2029	\$ 200	\$ 217	0,12	<b>Saudi Government International Bond</b>			
IPALCO Enterprises, Inc.								3,625 % fällig am 04.03.2028	300	286	0,16
3,700 % fällig am 01.09.2024	200	194	0,11					4,500 % fällig am 17.04.2030	700	701	0,39
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>South Africa Government International Bond</b>			
2,636 % fällig am 03.09.2019	300	301	0,17	Fannie Mae, TBA				10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 3.100	248	0,14
ONEOK, Inc.				3,000 % fällig am 01.08.2048	500	484	0,27				
4,550 % fällig am 15.07.2028 (a)	300	303	0,17	3,500 % fällig am 01.07.2048	7.500	7.460	4,20				
Pacific Gas & Electric Co.											
3,300 % fällig am 15.03.2027	100	91	0,05								
3,300 % fällig am 01.12.2027	200	180	0,10								
Petrobras Global Finance BV				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				<b>AKTIEN</b>			
5,750 % fällig am 01.02.2029	200	176	0,10	U.S. Treasury Bonds				<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>			
5,999 % fällig am 27.01.2028	817	741	0,42	2,500 % fällig am 15.05.2046	4.447	4.041	2,27	SCE Trust			
7,375 % fällig am 17.01.2027	300	300	0,17	2,750 % fällig am 15.11.2042	1.450	1.395	0,79	5,000 % fällig am 26.06.2022 (f)	4.000	94	0,05
Plains All American Pipeline LP				2,750 % fällig am 15.11.2047 (i)	1.900	1.814	1,02				
3,600 % fällig am 01.11.2024	550	522	0,29	2,875 % fällig am 15.05.2043	800	786	0,44				
4,700 % fällig am 15.06.2044	100	88	0,05	3,000 % fällig am 15.02.2048 (j)	4.311	4.327	2,44	<b>PARI (000S)</b>			
Sinopec Group Overseas Development Ltd.				U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
3,250 % fällig am 13.09.2027	500	463	0,26	0,375 % fällig am 15.01.2027	1.348	1.310	0,74	<b>PENSIONSGESCHÄFTE (k)</b>			
Southern Co. Gas Capital Corp.				U.S. Treasury Notes							
3,250 % fällig am 15.06.2026	1.000	951	0,53	1,500 % fällig am 15.08.2026	624	564	0,32	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
Sprint Capital Corp.				1,875 % fällig am 31.07.2022	645	624	0,35	Harris Corp.			
6,900 % fällig am 01.05.2019	500	511	0,29	2,000 % fällig am 30.11.2022	6.400	6.212	3,49	2,794 % fällig am 27.02.2019	\$ 200	200	0,11
Sprint Communications, Inc.				2,000 % fällig am 30.06.2024	4.400	4.209	2,37				
9,000 % fällig am 15.11.2018	37	38	0,02	2,125 % fällig am 31.12.2022	5.000	4.875	2,74	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
Sprint Corp.				2,500 % fällig am 31.03.2023				25,500 % fällig am 14.09.2018			
7,250 % fällig am 15.09.2021	300	313	0,18	(i)(j)	13.561	13.427	7,55	(c)(d)	ARS 7.000	224	0,13
Transcanada Trust				2,750 % fällig am 30.04.2023 (i)	2.400	2.403	1,35				
5,300 % fällig am 15.03.2077	150	142	0,08	2,750 % fällig am 31.05.2023 (i)	3.100	3.104	1,75	Summe kurzfristige Instrumente		857	0,48
Verizon Communications, Inc.				2,875 % fällig am 15.05.2028 (i)	14.021	14.051	7,91				
3,443 % fällig am 15.05.2025	300	300	0,17					<b>AKTIEN</b>			
3,850 % fällig am 01.11.2042	750	629	0,35					<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
4,329 % fällig am 21.09.2028	400	397	0,22					PIMCO Funds Ireland p.l.c. -			
4,672 % fällig am 15.03.2055	500	446	0,25	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				PIMCO US Dollar Short-Term			
Vodafone Group PLC				Argentina Government International Bond				Floating NAV Fund (g)	17.861	179	0,10
4,375 % fällig am 30.05.2028	100	99	0,06	2,500 % fällig am 31.12.2038	400	228	0,13				
				5,875 % fällig am 11.01.2028	200	163	0,09	Summe Übertragbare Wertpapiere			
				6,250 % fällig am 09.11.2047	€ 400	365	0,21	und Geldmarktinstrumente -			
				40,000 % fällig am 21.06.2020	ARS 6.200	224	0,13	Amtliche Börse/Geregelter Markt		\$ 214.928	120,94
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		135.326	76,15	Kuwait International Government Bond							
				2,750 % fällig am 20.03.2022	\$ 500	488	0,28				

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
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09/2018	7	\$ (7)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09/2018	14	(6)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2018	75	16	0,01
				\$ 3	0,00

## OPTIONSKAUF

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	\$ 104,500	24.08.2018	4	\$ 0	\$ 0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	104,750	24.08.2018	31	0	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2018 Futures	105,500	24.08.2018	14	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2018 Futures	134,500	24.08.2018	4	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	0,00

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	\$ 117,500	27.07.2018	10	\$ (2)	\$ 0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2018 Futures	120,500	27.07.2018	10	(2)	(3)	0,00
				\$ (4)	\$ (3)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 0	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond 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>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Anadarko Petroleum Corp.	1,000 %	20.06.2022	\$ 500	\$ 18	0,01
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2022	1.700	(1)	0,00
BT Group	1,000	20.06.2023	€ 300	0	0,00
Canadian Natural Resources Ltd.	1,000	20.06.2022	\$ 100	4	0,00
Daimler AG	1,000	20.12.2020	€ 100	0	0,00
Deutsche Bank AG	1,000	20.06.2019	100	0	0,00
DISH DBS Corp.	5,000	20.06.2023	\$ 200	(11)	(0,01)
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2021	300	10	0,01
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2021	300	(7)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2023	400	1	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2021	400	2	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2022	200	2	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2022	300	0	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2023	200	4	0,00
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.12.2022	300	(1)	0,00
Simon Property Group LP	1,000	20.06.2022	200	3	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	€ 100	0	0,00
				\$ 24	0,01

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 28 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2022	€ 3.500	\$ 42	0,03

### 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-30 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 47.100	\$ (83)	(0,05)

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,035 %	02.01.2020	BRL 15.500	\$ (60)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,500	02.01.2020	25.200	(54)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,033	04.01.2021	5.000	(28)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.06.2048	\$ 1.650	24	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,860	08.05.2023	500	0	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	19.09.2023	ZAR 11.100	(19)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	19.09.2028	17.900	(54)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.09.2028	€ 1.300	(31)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,250	19.12.2028	1.800	(25)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,500	19.09.2028	£ 3.200	(56)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	1,750	19.09.2048	300	4	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month HUF-BBR	1,000	19.09.2023	HUF 115.000	(18)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	352.100	(57)	(0,03)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	¥ 239.600	(10)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,415	25.03.2029	10.000	(1)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	150.000	(11)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,080	10.03.2026	MXN 31.500	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,380	04.11.2026	3.300	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,570	18.03.2025	1.900	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,670	05.03.2025	23.700	(16)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,710	26.02.2025	7.100	(5)	0,00
					\$ (423)	(0,24)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (440)</b>	<b>(0,25)</b>

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

#### FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* 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	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens	
BOA	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,450 %	29.01.2019	\$ 2.500	\$ 6	\$ 2	0,00	
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,940	18.02.2020	3.150	23	19	0,01	
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,258	18.09.2019	400	12	14	0,01	
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,945	09.12.2019	400	19	26	0,02	
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,945	11.12.2019	200	9	13	0,01	
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,000	27.11.2018	7.800	19	1	0,00	
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,000	04.12.2018	1.900	4	0	0,00	
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,258	18.09.2019	300	9	10	0,01	
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,100	08.03.2019	200	13	6	0,00	
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,258	18.09.2019	200	6	7	0,00	
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,930	09.12.2019	600	28	40	0,02	
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,943	12.12.2019	200	10	13	0,01	
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,630	16.12.2019	200	12	4	0,00	
								\$ 170	\$ 155	0,09

#### VERKAUFSoPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,700 %	18.07.2018	\$ 800	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	1.400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,700	15.08.2018	200	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.08.2018	600	(1)	0	0,00
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	800	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.08.2018	700	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	1.200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	1,000	15.08.2018	€ 1.000	(2)	(1)	0,00
BRC	Call - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Kauf	0,500	19.09.2018	4.800	(5)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	4.800	(14)	(18)	(0,01)
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	\$ 200	0	0	0,00
CBK	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	€ 1.000	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.07.2018	\$ 700	(1)	0	0,00
CKL	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	200	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.08.2018	1.400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.09.2018	€ 1.100	(3)	(4)	(0,01)
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	1.000	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	\$ 500	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,950	18.07.2018	400	(1)	0	0,00
GST	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	€ 400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.07.2018	\$ 700	(1)	0	0,00
JPM	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.09.2018	€ 400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	\$ 200	0	0	0,00
						\$ (42)	\$ (36)	(0,02)

#### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus BRL	BRL 3,700	12.07.2018	\$ 1.661	\$ (15)	\$ (68)	(0,04)
CBK	Call - OTC USD versus MXN	MXN 20,500	09.07.2018	801	(8)	(2)	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	20,650	09.08.2018	826	(10)	(7)	0,00
					\$ (33)	\$ (77)	(0,04)

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,940 %	18.09.2019	\$ 1.700	\$ (12)	\$ (25)	(0,02)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	09.12.2019	1.800	(20)	(38)	(0,02)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	11.12.2019	900	(10)	(19)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,553	29.01.2019	500	(6)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,086	18.02.2020	300	(23)	(22)	(0,01)
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180	27.11.2018	500	(5)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,200	27.11.2018	500	(6)	0	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettvermögens
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,210 %	27.11.2018	\$ 500	\$ (6)	\$ 0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,173	04.12.2018	400	(4)	0	0,00
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,940	18.09.2019	1.300	(9)	(19)	(0,01)
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,970	08.03.2019	900	(14)	(9)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,940	18.09.2019	900	(7)	(13)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	09.12.2019	2.600	(27)	(54)	(0,03)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750	12.12.2019	900	(10)	(19)	(0,01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	16.12.2019	1.100	(14)	(5)	0,00
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,835	11.07.2018	800	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,085	11.07.2018	800	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,770	02.07.2018	800	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,010	02.07.2018	800	(1)	0	0,00
							\$ (177)	\$ (226)	(0,13)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ Abschlussprämien (erhaltene)	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
BPS	Intesa Sanpaolo	1,000 %	20.06.2023	€ 450	\$ (58)	\$ (1)	\$ (59)	(0,03)
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	\$ 600	(36)	14	(22)	(0,01)
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2021	1.500	(44)	38	(6)	(0,01)
DUB	Petroleos Mexicanos	1,000	20.12.2021	100	(9)	7	(2)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	0	0	0	0	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	500	(32)	(5)	(37)	(0,02)
					\$ (179)	\$ 53	\$ (126)	(0,07)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ Abschlussprämien (erhaltene)	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
BRC	SFR Group S.A.	1,000 %	20.06.2023	0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	\$ 1.300	127	57	184	0,11
FBF	CMBX.NA.BBB-6 Index	3,000	11.05.2063	100	(6)	(4)	(10)	(0,01)
GST	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	100	9	5	14	0,01
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,000	17.09.2058	5.700	(212)	210	(2)	0,00
	CMBX.NA.BB.6 Index	5,000	11.05.2063	200	(29)	(9)	(38)	(0,02)
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	100	(3)	2	(1)	0,00
	CMBX.NA.BBB-6 Index	3,000	11.05.2063	100	(5)	(5)	(10)	(0,01)
					\$ (119)	\$ 256	\$ 137	0,08

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Teilfonds 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/ Abschlussprämien (erhaltene)	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettvermögens
GLM	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,270 %	14.11.2021	CLP 879.700	\$ 0	\$ (14)	\$ (14)	(0,01)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,520	16.11.2022	203.500	0	(3)	(3)	0,00
						\$ 0	\$ (17)	\$ (17)	(0,01)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AZD	08/2018	\$ 374	NZD 543	\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	0,00
BOA	09/2018	SGD 798	\$ 601	15	0	15	0,01
	01/2019	\$ 307	EGP 5.750	0	(5)	(5)	0,00
BPS	07/2018	ARS 13.875	\$ 501	25	0	25	0,01
	07/2018	BRL 4.891	1.294	23	0	23	0,01
	07/2018	€ 4.931	5.719	0	(38)	(38)	(0,02)
	07/2018	\$ 505	ARS 13.875	0	(25)	(25)	(0,01)
	08/2018	HUF 10.389	\$ 40	3	0	3	0,00
	08/2018	MXN 2.176	109	0	(1)	(1)	0,00
	08/2018	\$ 434	ZAR 5.517	0	(33)	(33)	(0,02)
	09/2018	373	INR 25.493	0	(4)	(4)	0,00
BRC	07/2018	ARS 12.885	\$ 481	41	0	41	0,02
	07/2018	£ 197	263	3	0	3	0,00
	07/2018	RUB 27.988	445	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 2.840	£ 2.172	27	0	27	0,02

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	08/2018	£ 2.172	\$ 2.844	\$ 0	\$ (27)	\$ (27)	(0,01)
	08/2018	\$ 443	RUB 27.988	1	0	1	0,00
CBK	07/2018	£ 2.040	\$ 2.703	9	0	9	0,01
	07/2018	\$ 393	€ 332	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	103	PLN 355	0	(8)	(8)	0,00
	07/2018	443	RUB 27.988	3	0	3	0,00
	08/2018	MXN 17.033	\$ 840	1	(20)	(19)	(0,01)
	08/2018	\$ 1.729	MXN 33.334	1	(49)	(48)	(0,03)
	08/2018	1.667	TRY 7.378	0	(86)	(86)	(0,05)
DUB	07/2018	ARS 13.875	\$ 497	17	0	17	0,01
	07/2018	\$ 317	BRL 1.180	0	(10)	(10)	(0,01)
FBF	07/2018	977	3.712	0	(13)	(13)	(0,01)
	08/2018	BRL 3.712	\$ 975	13	0	13	0,01
	09/2018	INR 25.413	366	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07/2018	COP 1.203.422	431	22	0	22	0,01
	07/2018	€ 43	50	0	0	0	0,00
	07/2018	£ 56	75	1	0	1	0,00
	07/2018	¥ 4.200	38	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 501	£ 372	0	(10)	(10)	(0,01)
	08/2018	NZD 545	\$ 379	10	0	10	0,01
	08/2018	ZAR 5.057	365	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07/2018	€ 2.059	2.419	15	0	15	0,01
	07/2018	£ 160	214	2	0	2	0,00
	07/2018	TRY 5.105	1.035	0	(71)	(71)	(0,04)
	07/2018	\$ 420	COP 1.202.837	0	(11)	(11)	(0,01)
	07/2018	2.436	€ 2.078	0	(10)	(10)	(0,01)
	07/2018	147	PLN 502	0	(13)	(13)	(0,01)
	08/2018	RUB 12.165	\$ 189	0	(4)	(4)	0,00
	08/2018	ZAR 3.787	297	22	0	22	0,01
	09/2018	ARS 1.116	38	2	0	2	0,00
MSB	07/2018	PLN 777	229	21	0	21	0,01
	07/2018	\$ 148	€ 128	2	0	2	0,00
SCX	08/2018	653	RUB 40.927	0	(4)	(4)	0,00
	01/2019	193	EGP 3.607	0	(3)	(3)	0,00
SSB	07/2018	£ 91	\$ 122	2	0	2	0,00
	07/2018	\$ 5.233	€ 4.495	16	0	16	0,01
	08/2018	€ 4.495	\$ 5.244	0	(15)	(15)	(0,01)
	08/2018	ZAR 576	43	1	0	1	0,00
				\$ 298	\$ (477)	\$ (179)	(0,10)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutional CHF (Hedged) Class 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	07/2018	\$ 86	CHF 84	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
BPS	07/2018	CHF 2	\$ 2	0	0	0	0,00
CBK	07/2018	7	7	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 86	CHF 85	0	0	0	0,00
GLM	07/2018	CHF 80	\$ 80	0	(1)	(1)	0,00
	07/2018	\$ 87	CHF 86	0	0	0	0,00
	08/2018	81	80	1	0	1	0,00
JPM	07/2018	CHF 82	\$ 83	0	0	0	0,00
	08/2018	\$ 81	CHF 80	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	CHF 2	\$ 2	0	0	0	0,00
				\$ 1	\$ (2)	\$ (1)	0,00

Zum 30. Juni 2018 standen fur die Institutionell EUR (Hegend) Class und Class E EUR (Hegend) 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	07/2018	\$ 985	€ 839	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
BPS	07/2018	997	860	7	0	7	0,01
CBK	07/2018	6	5	0	0	0	0,00
GLM	07/2018	1.224	1.041	0	(9)	(9)	(0,01)
JPM	07/2018	1.210	1.029	0	(9)	(9)	(0,01)
MSB	07/2018	€ 1.544	\$ 1.784	0	(19)	(19)	(0,01)
	08/2018	\$ 1.788	€ 1.544	19	0	19	0,01
SCX	07/2018	€ 8	\$ 10	0	0	0	0,00
SSB	07/2018	1.537	1.790	0	(5)	(5)	0,00
	07/2018	\$ 1.003	€ 862	3	0	3	0,00
	08/2018	1.794	1.537	5	0	5	0,00
				\$ 34	\$ (47)	\$ (13)	(0,01)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class 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	07/2018	£ 451	\$ 606	\$ 11	\$ 0	\$ 11	0,01
BOA	07/2018	\$ 27.153	£ 20.336	0	(305)	(305)	(0,17)
BPS	07/2018	£ 786	\$ 1.042	4	(1)	3	0,00
BRC	07/2018	19.432	25.416	1	(240)	(239)	(0,13)
	07/2018	\$ 25	£ 19	0	0	0	0,00
CBK	08/2018	24.982	19.077	240	0	240	0,13
	07/2018	£ 529	\$ 706	7	0	7	0,00
GLM	07/2018	\$ 26.846	£ 20.263	0	(94)	(94)	(0,05)
	07/2018	£ 134	\$ 176	0	(1)	(1)	0,00
RYL	07/2018	\$ 217	£ 162	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07/2018	£ 131	\$ 173	0	0	0	0,00
	07/2018	19.650	25.844	11	(110)	(99)	(0,06)
	07/2018	\$ 27.041	£ 20.341	0	(186)	(186)	(0,11)
	08/2018	24.949	18.954	109	0	109	0,06
SSB	07/2018	£ 949	\$ 1.266	14	(1)	13	0,01
				\$ 397	\$ (940)	\$ (543)	(0,31)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (926)	(0,52)
Summe Anlagen						\$ 13.562	120,17
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (35.844)	(20,17)
Nettovermögen						\$ 177.718	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) Wertpapier per Emissionstermin.

(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.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 26.044 als Sicherheiten verpfändet.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 7.437 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 3.222 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Höhe von USD 1.340 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,850 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ 433	U.S. Treasury Notes 0,800 % fällig am 15.11.2021	\$ (443)	\$ 433	\$ 433	0,24
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (443)	\$ 433	\$ 433	0,24

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 273	\$ 214.655	\$ 0	\$ 214.928
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1)	(1.365)	0	(1.366)
Summen	\$ 272	\$ 213.290	\$ 0	\$ 213.562

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 174	\$ 171.681	\$ 0	\$ 171.855
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	23	593	0	616
<b>Summen</b>	<b>\$ 197</b>	<b>\$ 172.274</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 172.471</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 der Wertpapieranlagen.

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	2,100 %	21.06.2018	05.07.2018	\$ (14.003)	\$ (14.011)	(7,88)
	2,180	20.06.2018	05.07.2018	(2.313)	(2.314)	(1,30)
	2,550	28.06.2018	02.07.2018	(1.910)	(1.910)	(1,07)
RCY	2,350	29.06.2018	05.07.2018	(2.092)	(2.092)	(1,18)
SCX	2,120	05.06.2018	06.08.2018	(1.786)	(1.789)	(1,01)
	2,160	13.06.2018	13.08.2018	(991)	(992)	(0,56)
	2,170	14.06.2018	14.08.2018	(1.700)	(1.702)	(0,96)
	2,250	22.06.2018	20.07.2018	(1.200)	(1.201)	(0,68)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (26.011)</b>	<b>(14,64)</b>

#### Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkaufgeschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	2,100 %	15.06.2018	16.07.2018	\$ (4.437)	\$ (4.441)	(2,50)
	2,500	28.06.2018	05.07.2018	(2.993)	(2.994)	(1,68)
<b>Summe Rückkaufgeschäfte</b>					<b>\$ (7.435)</b>	<b>(4,18)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 5 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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 4	\$ 0	\$ 4
BOA	(403)	680	277
BPS	(141)	0	(141)
BRC	42	0	42
CBK	(73)	260	187
CKL	(7)	0	(7)
DUB	(5)	0	(5)
FBF	(11)	0	(11)
GLM	(39)	30	(9)
GST	(64)	0	(64)
JPM	(78)	80	2
MSB	23	0	23
MYC	(11)	0	(11)
SCX	(183)	290	107
SSB	20	(10)	10

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse	94,42	72,22
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,57	31,21
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,95	4,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,25)	0,09
Freiverkehrsfinaanzderivate	(0,52)	0,29
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(14,64)	(6,58)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(4,18)	(4,08)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US Investment Grade Corporate Bond Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	\$ 24.551	\$ 24.269	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2027	\$ 31.156	\$ 29.497
U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 31.03.2023	20.361	20.269	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	24.551	24.070
U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 28.02.2023	19.600	19.606	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 28.02.2023	19.600	19.631
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2028	16.731	16.564			
	<b>AKTIEN</b>		<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	1.538.205	15.400
<b>PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)</b>	1.538.620	15.404		<b>PARI (000S)</b>	
	<b>PARI (000S)</b>		U.S. Treasury Bonds 2,750 % fällig am 15.08.2047	\$ 7.398	7.003
U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2027	\$ 12.663	12.047	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 31.03.2023	6.800	6.696
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.11.2047	8.764	8.183	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.11.2047	6.864	6.371
U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 15.02.2048	6.101	5.948	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 15.12.2020	5.400	5.326
U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.06.2024	4.400	4.208	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.08.2027	3.750	3.562
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 31.05.2023	3.100	3.102	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2028	2.710	2.731
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 30.04.2023	2.400	2.395	U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 15.02.2048	1.790	1.761
U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.05.2046	2.122	1.956	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2047	1.596	1.556
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 21.05.2018	¥ 170.000	1.601	U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2045	1.500	1.319
JPMorgan Chase & Co 3,509 % fällig am 23.01.2029	\$ 1.400	1.400	U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 15.05.2026	1.400	1.255
U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 15.05.2026	1.400	1.275	U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 31.01.2023	1.200	1.186
ING Groep NV 4,700 % fällig am 22.03.2028	1.200	1.200	<b>Charter Communications Operating LLC</b> 4,908 % fällig am 23.07.2025	1.000	1.047
U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 31.01.2023	1.200	1.185	U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 30.04.2023	1.000	945
Lloyds Banking Group PLC 4,450 % fällig am 08.05.2025	1.100	1.104	<b>Morgan Stanley</b> 3,737 % fällig am 24.04.2024	900	898
Cooperatieve Rabobank UA 5,500 % fällig am 29.06.2020	800	1.035	<b>Post Holdings, Inc.</b> 5,750 % fällig am 01.03.2027	700	712
Royal Bank of Scotland Group PLC 4,892 % fällig am 18.05.2029	1.000	1.000	<b>Santander UK Group Holdings PLC</b> 2,875 % fällig am 05.08.2021	700	684

(a) Der US Investment Grade Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVERMÖGENS
<b>HONGKONG</b>				<b>ISRAEL</b>				<b>JAPAN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AIA Group Ltd. 2,250 % fällig am 11.03.2019	\$ 3.000	\$ 2.981	0,16	Israel Electric Corp. Ltd. 7,250 % fällig am 15.01.2019	\$ 4.000	\$ 1.328	0,07	Japan Bank for International Cooperation 1,750 % fällig am 13.11.2018	\$ 10.900	\$ 10.872	0,59
CNOOC Finance Australia Pty. Ltd. 2,625 % fällig am 05.05.2020	1.000	988	0,05	9,375 % fällig am 28.01.2020		4.359	0,24	2,250 % fällig am 24.02.2020	4.200	4.160	0,23
HKCG Finance Ltd. 6,250 % fällig am 07.08.2018	2.550	2.558	0,14	Summe Israel		5.687	0,31	2,752 % fällig am 21.07.2020	3.000	3.013	0,16
Sinochem Overseas Capital Co. Ltd. 4,500 % fällig am 12.11.2020	1.600	1.628	0,09	<b>ITALIEN</b>				2,780 % fällig am 01.06.2020	5.000	5.029	0,27
Summe Hongkong		8.155	0,44	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,900 % fällig am 24.02.2020	11.060	11.137	0,60
<b>INDIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Japan Finance Organization for Municipalities</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Axis Bank Ltd. 3,125 % fällig am 21.05.2020	4.000	3.947	0,22	Aozora Bank Ltd. 2,750 % fällig am 09.03.2020	1.100	1.088	0,06	2,000 % fällig am 08.09.2020	5.000	4.888	0,27
ICICI Bank Ltd. 3,125 % fällig am 12.08.2020	3.000	2.954	0,16	Central Nippon Expressway Co. Ltd. 2,079 % fällig am 05.11.2019	1.200	1.184	0,06	2,125 % fällig am 06.03.2019	2.000	1.992	0,11
3,500 % fällig am 18.03.2020	2.270	2.259	0,12	2,091 % fällig am 14.09.2021	8.500	8.149	0,44	2,125 % fällig am 13.04.2021	4.600	4.470	0,24
4,800 % fällig am 22.05.2019	4.970	5.037	0,27	2,241 % fällig am 16.02.2021	800	780	0,04	<b>Tokyo Metropolitan Government</b>			
State Bank of India 3,275 % fällig am 06.04.2020	7.100	7.124	0,39	2,567 % fällig am 02.11.2021	3.000	2.914	0,16	2,125 % fällig am 20.05.2019	5.000	4.968	0,27
3,622 % fällig am 17.04.2019	1.800	1.803	0,10	2,803 % fällig am 15.02.2022	28.000	27.893	1,52	<b>Summe Japan</b>			
		23.124	1,26	3,131 % fällig am 03.03.2022	500	503	0,03			56.942	3,09
				3,186 % fällig am 14.09.2021	500	505	0,03			229.764	12,49
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Chugoku Electric Power Co., Inc.</b>				<b>JERSEY, KANALINSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Export-Import Bank of India 2,750 % fällig am 01.04.2020	2.000	1.966	0,11	2,701 % fällig am 16.03.2020	2.500	2.487	0,14	<b>Lincoln Finance Ltd.</b>			
2,750 % fällig am 12.08.2020	900	881	0,05	Japan Tobacco, Inc. 2,100 % fällig am 23.07.2018	5.000	5.000	0,27	6,875 % fällig am 15.04.2021	€ 1.000	1.209	0,07
3,331 % fällig am 21.08.2022	10.700	10.730	0,58	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3,061 % fällig am 02.03.2023	4.100	4.111	0,22	3,400 % fällig am 10.10.2018	\$ 200	199	0,01
		13.577	0,74	3,150 % fällig am 25.07.2022	14.200	14.269	0,78	<b>Summe Jersey, Kanalinseln</b>			
		36.701	2,00	3,249 % fällig am 22.02.2022	1.500	1.515	0,08			1.408	0,08
<b>IRLAND</b>				<b>Mitsubishi UFJ Lease &amp; Finance Co. Ltd.</b>				<b>KASACHSTAN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Black Diamond CLO Designated Activity Co. 3,358 % fällig am 03.10.2029	3.300	3.307	0,18	2,500 % fällig am 09.03.2020	2.780	2.745	0,15	<b>KazMunayGas National Co. JSC</b>			
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,730 % fällig am 21.09.2029	€ 2.100	2.452	0,13	2,652 % fällig am 19.09.2022	7.500	7.203	0,39	9,125 % fällig am 02.07.2018	1.000	1.000	0,05
Cork Street CLO Designated Activity Co. 0,590 % fällig am 27.11.2028	1.400	1.635	0,09	2,750 % fällig am 21.10.2020	600	592	0,03	<b>LUXEMBURG</b>			
Dartry Park CLO DAC 0,830 % fällig am 28.04.2029	1.500	1.754	0,10	3,137 % fällig am 23.07.2019	2.000	2.008	0,11	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Dorchester Park CLO Ltd. 2,984 % fällig am 20.04.2028	\$ 2.000	2.001	0,11	3,256 % fällig am 20.02.2019	600	603	0,03	<b>Allergan Funding SCS</b>			
Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029	€ 600	702	0,04	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 2,450 % fällig am 16.10.2019	2.000	1.984	0,11	2,450 % fällig am 15.06.2019	4.000	3.981	0,22
		11.851	0,65	Mizuho Bank Ltd. 2,650 % fällig am 25.09.2019	2.500	2.487	0,14	3,581 % fällig am 12.03.2020	800	809	0,04
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Mizuho Financial Group, Inc.</b>				<b>Holcim U.S. Finance SARL &amp; Cie SCS</b>			
AerCap Ireland Capital DAC 3,750 % fällig am 15.05.2019	\$ 6.700	6.741	0,36	3,207 % fällig am 11.09.2022	14.400	14.485	0,79	6.000 % fällig am 30.12.2019	1.600	1.659	0,09
4,250 % fällig am 01.07.2020	300	304	0,02	3,259 % fällig am 28.02.2022	1.000	1.008	0,05	<b>Summe Luxemburg</b>			
4,625 % fällig am 30.10.2020	500	510	0,03	3,473 % fällig am 13.09.2021	3.500	3.554	0,19			6.750	0,37
5,000 % fällig am 01.10.2021	800	825	0,04	NUMG Bank Ltd. 2,350 % fällig am 08.09.2019	2.350	2.332	0,13	<b>MALAYSIA</b>			
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 1,900 % fällig am 23.09.2019	3.500	3.446	0,19	Nomura Holdings, Inc. 2,750 % fällig am 19.03.2019	6.233	6.232	0,34	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
SMBC Aviation Capital Finance DAC 2,650 % fällig am 15.07.2021	1.500	1.455	0,08	NTT Finance Corp. 2,864 % fällig am 29.06.2020	5.000	5.020	0,27	<b>EXIM Sukuk Malaysia Bhd.</b>			
3,000 % fällig am 15.07.2022	2.700	2.606	0,14	ORIX Corp. 2,650 % fällig am 13.04.2021	14.100	13.753	0,75	2,874 % fällig am 19.02.2019	3.665	3.660	0,20
		15.887	0,86	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2,665 % fällig am 18.10.2019	2.600	2.603	0,14	Petronas Capital Ltd. 5,250 % fällig am 12.08.2019	3.400	3.482	0,19
<b>AKTIEN</b>				<b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b>				<b>Petronas Global Sukuk Ltd.</b>			
<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</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>			
PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (f)	393.850	39.960	2,17	3,095 % fällig am 18.10.2022	4.500	4.506	0,25	2,707 % fällig am 18.03.2020	1.500	1.485	0,08
				3,119 % fällig am 12.07.2022	6.400	6.429	0,35	<b>Summe Malaysia</b>			
				3,458 % fällig am 14.07.2021	900	914	0,05			8.627	0,47
				Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 2,050 % fällig am 06.03.2019	3.000	2.984	0,16	<b>MEXIKO</b>			
				2,050 % fällig am 18.10.2019	7.000	6.904	0,38	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				2,766 % fällig am 19.09.2019	5.300	5.308	0,29	<b>Petroleos Mexicanos</b>			
				2,824 % fällig am 06.03.2019	3.000	3.006	0,16	5.500 % fällig am 04.02.2019	1.650	1.675	0,09
				3,265 % fällig am 18.10.2019	250	252	0,01	6.000 % fällig am 05.03.2020	2.000	2.067	0,11
				Suntory Holdings Ltd. 2,550 % fällig am 29.09.2019	2.000	1.985	0,11	8.000 % fällig am 03.05.2019	200	208	0,01
						172.822	9,40	<b>Summe Mexiko</b>			
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Taurus UK DAC 1,473 % fällig am 17.11.2027	£ 2.500	3.312	0,18	Development Bank of Japan, Inc. 2,125 % fällig am 30.01.2019	400	399	0,02	Cairn CLO BV 0,572 % fällig am 30.01.2028	€ 800	937	0,05
Summe Irland		71.010	3,86	2,606 % fällig am 28.01.2020	6.000	6.014	0,33	Contego CLO BV 0,583 % fällig am 15.11.2026	2.400	2.804	0,15
								Tikehau CLO BV 0,600 % fällig am 04.08.2028	2.000	2.338	0,13
								<b>Summe Niederlande</b>			
										6.079	0,33
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								<b>Cooperative Rabobank UA</b>			
								2,817 % fällig am 10.01.2023	\$ 5.000	5.000	0,27

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS
<b>DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV</b> 1,500 % fällig am 19.09.2019	\$ 3.100	\$ 3.043	0,17	<b>SPANIEN</b>				<b>Standard Chartered PLC</b> 2,100 % fällig am 19.08.2019	\$ 5.115	\$ 5.047	0,27
<b>ING Bank NV</b> 2,450 % fällig am 16.03.2020	1.000	987	0,05	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,400 % fällig am 08.09.2019	1.600	1.585	0,09
4,125 % fällig am 21.11.2023	2.000	2.006	0,11	<b>Telefonica Emisiones S.A.U.</b> 5,877 % fällig am 15.07.2019	\$ 3.000	\$ 3.087	0,17	3,461 % fällig am 19.08.2019	4.000	4.037	0,22
<b>LeasePlan Corp. NV</b> 2,875 % fällig am 22.01.2019	4.600	4.592	0,25	<b>SCHWEDEN</b>				<b>Vodafone Group PLC</b> 3,290 % fällig am 16.01.2024	2.900	2.889	0,16
<b>Mondelez International Holdings Netherlands BV</b> 1,625 % fällig am 28.10.2019	4.000	3.932	0,21	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						102.455	5,57
<b>Mylan NV</b> 2,500 % fällig am 07.06.2019	550	548	0,03	<b>Nordea Bank AB</b> 2,375 % fällig am 04.04.2019	257	256	0,01				
3,150 % fällig am 15.06.2021	500	495	0,03	3,309 % fällig am 27.05.2021	2.000	2.032	0,11	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
3,750 % fällig am 15.12.2020	2.500	2.517	0,14	<b>Svenska Handelsbanken AB</b> 2,800 % fällig am 24.05.2021	2.000	2.001	0,11	<b>Ripon Mortgages PLC</b> 1,423 % fällig am 20.08.2056	£ 3.122	4.142	0,23
<b>Schaeffler Finance BV</b> 4,750 % fällig am 15.05.2023	1.300	1.294	0,07	Summe Schweden		4.289	0,23	Summe Großbritannien		106.597	5,80
<b>Syngenta Finance NV</b> 3,698 % fällig am 24.04.2020	1.700	1.695	0,09	<b>SCHWEIZ</b>				<b>USA</b>			
<b>Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV</b> 1,700 % fällig am 19.07.2019	5.600	5.468	0,30	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>BORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Summe Niederlande		31.577	1,72	<b>UBS AG</b> 2,901 % fällig am 08.06.2020	1.000	1.004	0,05	<b>Ally Auto Receivables Trust</b> 2,640 % fällig am 16.02.2021	\$ 6.000	5.998	0,33
<b>NEUSEELAND</b>				<b>UBS Group Funding Switzerland AG</b> 3,293 % fällig am 15.08.2023	2.400	2.404	0,13	<b>Ameritrust Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>			
<b>BNZ International Funding Ltd.</b> 2,350 % fällig am 04.03.2019	1.400	1.395	0,07	3,775 % fällig am 24.09.2020	2.000	2.043	0,11	2,811 % fällig am 25.04.2035	165	166	0,01
3,316 % fällig am 14.09.2021	2.500	2.530	0,14	4,128 % fällig am 14.04.2021	3.000	3.098	0,17	<b>Bayview Koitere Fund Trust</b> 3,623 % fällig am 28.03.2033	2.326	2.327	0,13
Summe Neuseeland		3.925	0,21	Summe Schweiz		8.549	0,46	<b>Bayview Opportunity Master Fund Trust</b> 3,105 % fällig am 28.07.2032	223	222	0,01
<b>NORWEGEN</b>				<b>THAILAND</b>				3,721 % fällig am 28.02.2033	861	860	0,05
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,844 % fällig am 28.04.2033	941	944	0,05
<b>DNB Bank ASA</b> 3,391 % fällig am 02.06.2021	2.000	2.038	0,11	<b>Bangkok Bank PCL</b> 3,300 % fällig am 03.10.2018	800	801	0,04	<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>			
<b>Eksporthfinans ASA</b> 3,153 % fällig am 10.11.2020	1.800	1.802	0,10	4,800 % fällig am 18.10.2020	1.000	1.027	0,06	2,841 % fällig am 25.03.2035	2.000	1.958	0,11
Summe Norwegen		3.840	0,21	<b>Kasikornbank PCL</b> 3,500 % fällig am 25.10.2019	2.000	2.003	0,11	4,716 % fällig am 25.03.2034	119	119	0,01
<b>KATAR</b>				<b>Siam Commercial Bank PCL</b> 3,500 % fällig am 07.04.2019	1.100	1.102	0,06	<b>BMW Vehicle Lease Trust</b> 1,980 % fällig am 20.05.2020	443	440	0,02
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Thailand		4.933	0,27	<b>CarMax Auto Owner Trust</b> 1,800 % fällig am 15.03.2021	1.970	1.956	0,11
<b>Qatari Diar Finance Co.</b> 5,000 % fällig am 21.07.2020	4.400	4.523	0,25	<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				<b>Colony Starwood Homes Trust</b> 3,585 % fällig am 17.07.2033	1.261	1.267	0,07
<b>Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.</b> 5,298 % fällig am 30.09.2020	821	840	0,04	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Countrywide Asset-Backed Certificates</b> 2,461 % fällig am 25.06.2036	700	682	0,04
6,750 % fällig am 30.09.2019	2.000	2.078	0,11	<b>Emirates NBD PJSC</b> 3,912 % fällig am 26.01.2020	750	760	0,04	<b>Credit Suisse Mortgage Capital Trust</b> 4,500 % fällig am 25.03.2021	232	234	0,01
Summe Katar		7.441	0,40	<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>EFS Volunteer LLC</b> 3,210 % fällig am 25.10.2035	797	798	0,04
<b>SINGAPUR</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>EquiFirst Mortgage Loan Trust</b> 5,091 % fällig am 25.10.2034	582	588	0,03
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Barclays PLC</b> 2,750 % fällig am 08.11.2019	4.500	4.468	0,24	<b>First NLC Trust</b> 2,161 % fällig am 25.08.2037	324	203	0,01
<b>BOC Aviation Ltd.</b> 2,375 % fällig am 15.09.2021	2.600	2.490	0,13	3,710 % fällig am 16.05.2024	2.900	2.878	0,16	<b>GM Financial Consumer Automobile Receivables Trust</b> 2,080 % fällig am 19.01.2021	5.000	4.980	0,27
2,750 % fällig am 18.09.2022	3.200	3.044	0,17	4,463 % fällig am 10.08.2021	3.000	3.115	0,17	<b>Hertz Fleet Lease Funding LP</b> 3,230 % fällig am 10.05.2032	2.000	2.002	0,11
3,000 % fällig am 30.03.2020	1.200	1.193	0,06	(e)(g)	4.400	4.478	0,24	<b>Home Equity Asset Trust</b> 3,036 % fällig am 25.06.2034	2.091	2.089	0,11
3,000 % fällig am 23.05.2022	500	483	0,03	<b>BP Capital Markets PLC</b> 3,205 % fällig am 16.09.2021	4.000	4.077	0,22	<b>Invitation Homes Trust</b> 3,373 % fällig am 17.08.2032	3.554	3.561	0,19
3,413 % fällig am 02.05.2021	5.900	5.947	0,32	<b>British Telecommunications PLC</b> 2,350 % fällig am 14.02.2019	2.120	2.114	0,12	<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b> 3,066 % fällig am 25.04.2035	3.000	3.010	0,16
3,875 % fällig am 09.05.2019	2.000	2.011	0,11	<b>Hitachi Capital UK PLC</b> 3,021 % fällig am 20.11.2020	7.000	7.002	0,38	<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b> 3,141 % fällig am 25.09.2033	1.588	1.579	0,09
<b>DBS Group Holdings Ltd.</b> 2,980 % fällig am 25.07.2022	5.300	5.316	0,29	<b>HSBC Holdings PLC</b> 3,326 % fällig am 16.05.2024	1.900	1.896	0,10	<b>Navient Private Education Loan Trust</b> 2,650 % fällig am 15.12.2028	391	385	0,02
Summe Singapur		20.484	1,11	3,990 % fällig am 25.05.2021	6.000	6.191	0,34	<b>Navient Student Loan Trust</b> 3,241 % fällig am 25.03.2066	4.769	4.864	0,26
<b>SÜDKOREA</b>				<b>Imperial Brands Finance PLC</b> 2,050 % fällig am 20.07.2018	2.500	2.499	0,14	3,341 % fällig am 25.06.2065	1.175	1.208	0,07
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,950 % fällig am 21.07.2020	4.500	4.456	0,24	<b>Nelnet Student Loan Trust</b> 2,560 % fällig am 27.02.2051	3.060	3.071	0,17
<b>Hyundai Capital Services, Inc.</b> 2,625 % fällig am 29.09.2020	500	489	0,03	<b>Lloyds Bank PLC</b> 2,853 % fällig am 07.05.2021	7.000	7.013	0,38	2,660 % fällig am 27.09.2038	5.133	5.173	0,28
2,625 % fällig am 27.11.2018	5.000	4.994	0,27	<b>Lloyds Banking Group PLC</b> 7,000 % fällig am 27.06.2019	7.000	7.000	0,38	3,980 % fällig am 25.11.2024	1.487	1.511	0,08
<b>Korea East-West Power Co. Ltd.</b> 2,875 % fällig am 10.10.2018	1.200	1.199	0,06	(e)(g)	£ 3.450	4.651	0,25	<b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b> 2,620 % fällig am 25.01.2036	2.000	1.991	0,11
2,875 % fällig am 07.05.2019	1.500	1.496	0,08	<b>BP Capital Markets PLC</b> 2,895 % fällig am 24.06.2022	\$ 5.400	5.391	0,29	<b>OneMain Financial Issuance Trust</b> 2,370 % fällig am 14.09.2032	1.300	1.275	0,07
<b>SK Broadband Co. Ltd.</b> 2,875 % fällig am 29.10.2018	2.000	1.999	0,11	<b>Royal Bank of Scotland Group PLC</b> 3,813 % fällig am 15.05.2023	18.000	18.098	0,98	<b>Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust</b> 2,771 % fällig am 25.09.2034	63	63	0,00
Summe Südkorea		10.177	0,55	6,400 % fällig am 21.10.2019	1.500	1.557	0,08	<b>Progress Residential Trust</b> 3,485 % fällig am 17.01.2034	1.399	1.405	0,08
				<b>Santander UK Group Holdings PLC</b> 2,875 % fällig am 16.10.2020	500	494	0,03	3,585 % fällig am 17.09.2033	2.470	2.476	0,14
				<b>Santander UK PLC</b> 2,350 % fällig am 10.09.2019	1.050	1.042	0,06				
				2,654 % fällig am 03.11.2020	7.500	7.477	0,41				

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS
RAAC Trust				Arrow Electronics, Inc.				Dow Chemical Co.			
3,491 % fällig am 25.05.2044	\$ 1.836	\$ 1.802	0,10	3,500 % fällig am 01.04.2022	\$ 2.000	\$ 1.974	0,11	8,550 % fällig am 15.05.2019	\$ 2.966	\$ 3.109	0,17
RMAT LP				AT&T, Inc.				DXC Technology Co.			
4,090 % fällig am 25.05.2048	1.901	1.904	0,10	2,975 % fällig am 01.06.2021	7.500	7.534	0,41	3,250 % fällig am 01.03.2021	2.900	2.901	0,16
SBA Tower Trust				3,245 % fällig am 15.02.2023	4.400	4.446	0,24	Energy Transfer Partners LP			
2,898 % fällig am 15.10.2044	1.500	1.491	0,08	3,298 % fällig am 15.07.2021	4.500	4.545	0,25	4,150 % fällig am 01.10.2020	600	607	0,03
SLC Student Loan Trust				Athene Global Funding				6,700 % fällig am 01.07.2018	3.880	3.880	0,21
2,403 % fällig am 15.05.2029	3.404	3.368	0,18	3,000 % fällig am 01.07.2022	1.300	1.260	0,07	9,000 % fällig am 15.04.2019	1.000	1.046	0,06
2,451 % fällig am 15.03.2027	2.140	2.134	0,12	3,566 % fällig am 01.07.2022	13.100	13.377	0,73	Enterprise Texas, Inc.			
SLM Private Credit Student Loan Trust				4,000 % fällig am 25.01.2022	1.000	1.008	0,06	7,125 % fällig am 01.02.2019	2.300	2.353	0,13
2,511 % fällig am 15.12.2026	1.370	1.369	0,07	AvalonBay Communities, Inc.				Enterprise Products Operating LLC			
SLM Student Loan Trust				2,778 % fällig am 15.01.2021	1.100	1.100	0,06	6,500 % fällig am 31.01.2019	1.304	1.331	0,07
2,410 % fällig am 25.09.2043	9.410	9.449	0,51	Aviation Capital Group LLC				EQT Corp.			
2,610 % fällig am 27.12.2038	2.044	2.057	0,11	2,875 % fällig am 17.09.2018	6.355	6.356	0,35	3,107 % fällig am 01.10.2020	4.100	4.103	0,22
2,811 % fällig am 15.12.2027	1.649	1.656	0,09	6,750 % fällig am 06.04.2021	1.300	1.405	0,08	Equifax, Inc.			
2,910 % fällig am 25.01.2028	1.805	1.811	0,10	Bank of America Corp.				3,200 % fällig am 15.08.2021	1.600	1.606	0,09
2,910 % fällig am 25.10.2064	6.000	5.988	0,33	2,987 % fällig am 01.10.2021	2.000	2.008	0,11	ERAC USA Finance LLC			
2,960 % fällig am 25.10.2029	4.000	4.019	0,22	3,022 % fällig am 21.07.2021	5.300	5.322	0,29	2,800 % fällig am 01.11.2018	2.000	2.000	0,11
2,960 % fällig am 25.01.2041	3.000	3.011	0,16	3,499 % fällig am 17.05.2022	2.000	2.000	0,11	Ford Motor Credit Co. LLC			
3,260 % fällig am 25.07.2023	1.484	1.492	0,08	BAT Capital Corp.				1,897 % fällig am 12.08.2019	1.800	1.775	0,10
3,860 % fällig am 25.04.2023	2.765	2.824	0,15	2,945 % fällig am 14.08.2020	4.700	4.717	0,26	2,021 % fällig am 03.05.2019	1.500	1.488	0,08
4,060 % fällig am 25.07.2023	678	697	0,04	3,223 % fällig am 15.08.2022	12.910	13.009	0,71	2,597 % fällig am 04.11.2019	1.500	1.488	0,08
SMB Private Education Loan Trust				Bayer U.S. Finance LLC				2,875 % fällig am 01.10.2018	2.000	2.001	0,11
3,523 % fällig am 17.02.2032	470	480	0,03	2,375 % fällig am 08.10.2019	3.000	2.975	0,16	2,943 % fällig am 08.01.2019	2.575	2.576	0,14
SoFi Consumer Loan Program LLC				2,965 % fällig am 25.06.2021	2.700	2.705	0,15	3,185 % fällig am 12.08.2019	1.535	1.542	0,08
2,770 % fällig am 25.05.2026	887	880	0,05	3,345 % fällig am 15.12.2023	4.500	4.503	0,25	3,293 % fällig am 04.11.2019	2.500	2.518	0,14
SoFi Professional Loan Program LLC				BellSouth Corp.				Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc.			
2,720 % fällig am 27.10.2036	688	680	0,04	4,333 % fällig am 26.04.2021	5.200	5.255	0,29	5,625 % fällig am 31.07.2019	5.311	5.442	0,30
3,691 % fällig am 25.06.2025	311	314	0,02	BGC Partners, Inc.				GATX Corp.			
Springleaf Funding Trust				5,125 % fällig am 27.05.2021	300	306	0,02	2,500 % fällig am 15.03.2019	1.500	1.497	0,08
2,680 % fällig am 15.07.2030	2.300	2.264	0,12	Broadcom Corp.				3,083 % fällig am 05.11.2021	2.000	2.010	0,11
Stanwich Mortgage Loan Co.				2,200 % fällig am 15.01.2021	1.000	969	0,05	General Dynamics Corp.			
3,844 % fällig am 16.10.2046	325	325	0,02	Cantor Fitzgerald LP				2,736 % fällig am 11.05.2021	4.200	4.216	0,23
Structured Asset Investment Loan Trust				7,875 % fällig am 15.10.2019	1.000	1.046	0,06	General Electric Capital Corp.			
2,641 % fällig am 25.09.2034	2.071	2.042	0,11	Cardinal Health, Inc.				3,800 % fällig am 18.06.2019	4.866	4.889	0,27
2,931 % fällig am 25.08.2034	377	379	0,02	3,111 % fällig am 15.06.2022	8.885	8.881	0,48	General Mills, Inc.			
Sunset Mortgage Loan Co. LLC				Caterpillar Financial Services Corp.				2,893 % fällig am 16.04.2021	1.900	1.904	0,10
4,459 % fällig am 18.09.2045	61	62	0,00	3,715 % fällig am 15.05.2023	2.100	2.097	0,11	3,363 % fällig am 17.10.2023	1.000	1.009	0,06
Utah State Board of Regents				Charter Communications Operating LLC				General Motors Co.			
2,710 % fällig am 25.01.2057	4.492	4.503	0,25	3,579 % fällig am 23.07.2020	1.250	1.249	0,07	3,163 % fällig am 07.08.2020	1.000	1.004	0,05
VOLT LLC				CIT Group, Inc.				General Motors Financial Co., Inc.			
3,125 % fällig am 25.06.2047	2.082	2.072	0,11	3,875 % fällig am 19.02.2019	300	301	0,02	2,350 % fällig am 04.10.2019	2.100	2.083	0,11
3,125 % fällig am 25.09.2047	3.175	3.157	0,17	Citigroup, Inc.				2,400 % fällig am 09.05.2019	6.420	6.391	0,35
3,250 % fällig am 25.05.2047	1.363	1.357	0,07	3,352 % fällig am 01.06.2024	5.000	5.009	0,27	3,100 % fällig am 15.01.2019	1.000	1.001	0,05
3,250 % fällig am 25.06.2047	1.162	1.158	0,06	3,672 % fällig am 26.10.2020	5.000	5.103	0,28	3,187 % fällig am 09.04.2021	1.500	1.508	0,08
3,375 % fällig am 25.04.2047	836	836	0,05	3,714 % fällig am 30.03.2021	2.000	2.045	0,11	3,582 % fällig am 04.10.2019	3.300	3.334	0,18
3,375 % fällig am 28.05.2047	733	734	0,04	CNH Industrial Capital LLC				3,908 % fällig am 15.01.2020	500	508	0,03
				4,375 % fällig am 06.11.2020	1.300	1.324	0,07	4,408 % fällig am 15.01.2019	3.670	3.706	0,20
				Conagra Brands, Inc.				Georgia-Pacific LLC			
		125.720	6,84	2,831 % fällig am 09.10.2020	1.500	1.493	0,08	2,539 % fällig am 15.11.2019	1.000	994	0,05
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Continental Airlines Pass-Through Trust				Goldman Sachs Group, Inc.			
AIG Global Funding				6,545 % fällig am 02.08.2020	131	132	0,01	3,359 % fällig am 24.07.2023	2.000	2.008	0,11
2,817 % fällig am 02.07.2020	2.000	2.002	0,11	D.R. Horton, Inc.				3,513 % fällig am 15.11.2021	500	506	0,03
Air Lease Corp.				3,750 % fällig am 01.03.2019	4.300	4.314	0,23	Goodman U.S. Finance Two LLC			
2,125 % fällig am 15.01.2020	700	687	0,04	DAE Funding LLC				6,000 % fällig am 22.03.2022	1.200	1.291	0,07
2,625 % fällig am 04.09.2018	1.500	1.499	0,08	4,000 % fällig am 01.08.2020	600	595	0,03	Harley-Davidson Financial Services, Inc.			
2,750 % fällig am 15.01.2023	1.500	1.430	0,08	Daimler Finance North America LLC				2,831 % fällig am 21.05.2020	1.800	1.804	0,10
3,375 % fällig am 15.01.2019	10.300	10.321	0,56	2,785 % fällig am 12.02.2021	1.500	1.501	0,08	Harris Corp.			
Allergan Sales LLC				2,893 % fällig am 05.05.2020	1.000	1.004	0,05	2,839 % fällig am 30.04.2020	2.000	2.002	0,11
5,000 % fällig am 15.12.2021	700	725	0,04	2,913 % fällig am 04.05.2021	8.500	8.525	0,46	HCA, Inc.			
Allstate Corp.				2,979 % fällig am 30.10.2019	6.850	6.890	0,37	3,750 % fällig am 15.03.2019	1.200	1.208	0,07
2,764 % fällig am 29.03.2021	500	500	0,03	Dell International LLC				Hewlett Packard Enterprise Co.			
Ally Financial, Inc.				3,480 % fällig am 01.06.2019	18.325	18.375	1,00	2,850 % fällig am 05.10.2018	6.062	6.071	0,33
3,500 % fällig am 27.01.2019	2.400	2.400	0,13	Delta Air Lines, Inc.				4,251 % fällig am 05.10.2018	1.000	1.004	0,05
3,750 % fällig am 18.11.2019	1.700	1.702	0,09	2,875 % fällig am 13.03.2020	2.500	2.485	0,14	HP, Inc.			
4,125 % fällig am 30.03.2020	500	502	0,03	3,625 % fällig am 15.03.2022	1.700	1.682	0,09	3,288 % fällig am 14.01.2019	5.000	5.011	0,27
4,750 % fällig am 10.09.2018	1.400	1.404	0,08	Discover Bank				Hyundai Capital America			
American Express Co.				2,600 % fällig am 13.11.2018	5.700	5.697	0,31	1,750 % fällig am 27.09.2019	3.700	3.630	0,20
2,846 % fällig am 17.05.2021	2.100	2.107	0,11	Discovery Communications LLC				2,000 % fällig am 01.07.2019	1.312	1.295	0,07
American International Group, Inc.				2,750 % fällig am 15.11.2019	1.975	1.960	0,11	2,400 % fällig am 30.10.2018	2.229	2.226	0,12
2,300 % fällig am 16.07.2019	2.000	1.988	0,11	3,035 % fällig am 20.09.2019	1.000	1.005	0,05	2,500 % fällig am 18.03.2019	1.000	996	0,05
American Tower Corp.				DISH DBS Corp.				2,550 % fällig am 06.02.2019	3.800	3.786	0,21
3,400 % fällig am 15.02.2019	750	752	0,04	7,875 % fällig am 01.09.2019	200	208	0,01	3,261 % fällig am 08.07.2021	1.300	1.301	0,07
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.				Dominion Energy Gas Holdings LLC				Incitec Pivot Finance LLC			
3,052 % fällig am 12.01.2024	800	808	0,04	2,926 % fällig am 15.06.2021	3.900	3.899	0,21	6,000 % fällig am 10.12.2019	3.500	3.620	0,20
Anthem, Inc.								International Lease Finance Corp.			
2,250 % fällig am 15.08.2019	1.000	992	0,05					5,875 % fällig am 01.04.2019	6.000	6.124	0,33
2,300 % fällig am 15.07.2018	1.000	1.000	0,05								

	PARI	MARKT-	% DES		PARI	MARKT-	% DES		PARI	MARKT-	% DES
BESCHREIBUNG	(000S)	WERT	NETTOVER-	BESCHREIBUNG	(000S)	WERT	NETTOVER-	BESCHREIBUNG	(000S)	WERT	NETTOVER-
		(000S)	MÖGENS			(000S)	MÖGENS			(000S)	MÖGENS
6.250 % fällig am 15.05.2019	\$ 1.700	\$ 1.743	0,10	Springleaf Finance Corp.	\$ 250	\$ 270	0,02	BX Trust	\$ 633	\$ 634	0,04
7.125 % fällig am 01.09.2018	5.950	5.989	0,33	8.250 % fällig am 15.12.2020				CGMS Commercial Mortgage Trust	47	47	0,00
8.250 % fällig am 15.12.2020	3.000	3.310	0,18	Sprint Capital Corp.	1.800	1.841	0,10	2.719 % fällig am 15.07.2030			
Jackson National Life Global Funding				6.900 % fällig am 01.05.2019				Citigroup Commercial Mortgage Trust	4.000	4.005	0,22
2.807 % fällig am 11.06.2021	2.000	2.003	0,11	Sprint Communications, Inc.	1.300	1.328	0,07	2.923 % fällig am 15.07.2032	3.000	3.002	0,16
Jersey Central Power & Light Co.				9.000 % fällig am 15.11.2018				3.353 % fällig am 15.07.2027			
7.350 % fällig am 01.02.2019	754	772	0,04	Starwood Property Trust, Inc.	400	392	0,02	Cold Storage Trust	2.000	2.011	0,11
JPMorgan Chase & Co.				3.625 % fällig am 01.02.2021				3.073 % fällig am 15.04.2036	1.800	1.803	0,10
2.945 % fällig am 18.06.2022	10.000	10.002	0,54	Synchro Financial				Commercial Mortgage Trust	2.000	2.001	0,11
3.419 % fällig am 07.06.2021	4.000	4.077	0,22	2.600 % fällig am 15.01.2019	6.210	6.199	0,34	2.676 % fällig am 10.03.2046			
Kinder Morgan Energy Partners LP				3.000 % fällig am 15.08.2019	7.000	6.987	0,38	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.	469	472	0,03
2.650 % fällig am 01.02.2019	2.500	2.495	0,14	3.584 % fällig am 03.02.2020	4.250	4.291	0,23	3.567 % fällig am 25.09.2034			
Kinder Morgan, Inc.				Time Warner Cable LLC				Credit Suisse Mortgage Capital Trust	2.000	2.001	0,11
3.050 % fällig am 01.12.2019	400	399	0,02	6.750 % fällig am 01.07.2018	9.650	9.650	0,53	2.823 % fällig am 15.07.2032			
3.628 % fällig am 15.01.2023	1.500	1.525	0,08	8.250 % fällig am 01.04.2019	3.660	3.797	0,21	Great Wolf Trust	3.000	3.006	0,16
Komatsu Finance America, Inc.				8.750 % fällig am 14.02.2019	3.600	3.721	0,20	3.073 % fällig am 15.09.2034			
2.437 % fällig am 11.09.2022	2.200	2.115	0,12	Toyota Motor Credit Corp.				GS Mortgage Securities Corp. Trust	1.500	1.501	0,08
Kraft Heinz Foods Co.				2.721 % fällig am 17.05.2022	8.100	8.128	0,44	2.773 % fällig am 15.07.2032			
2.000 % fällig am 02.07.2018	3.755	3.755	0,20	Tyson Foods, Inc.	2.500	2.501	0,14	GS Mortgage Securities Trust	1.300	1.316	0,07
2.923 % fällig am 10.02.2021	2.100	2.103	0,11	2.781 % fällig am 21.08.2020				GSR Mortgage Loan Trust	136	134	0,01
3.173 % fällig am 10.08.2022	2.000	2.008	0,11	VEREIT Operating Partnership LP	2.000	1.999	0,11	3.718 % fällig am 25.11.2035 ^	344	322	0,02
Masco Corp.				3.000 % fällig am 06.02.2019				Hyatt Hotel Portfolio Trust	2.000	1.998	0,11
3.500 % fällig am 01.04.2021	400	400	0,02	Verizon Communications, Inc.	3.200	3.252	0,18	2.731 % fällig am 09.08.2032			
McDonald's Corp.				3.335 % fällig am 16.03.2022	8.700	8.698	0,47	Impac CMB Trust	252	247	0,01
2.759 % fällig am 28.10.2021	4.100	4.118	0,22	3.443 % fällig am 15.05.2025				JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.	2.300	2.304	0,13
MGM Resorts International				Viacom, Inc.				3.000 % fällig am 15.06.2032 (b)			
5.250 % fällig am 31.03.2020	400	408	0,02	2.750 % fällig am 15.12.2019	596	591	0,03	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust	535	537	0,03
6.750 % fällig am 01.10.2020	4.700	4.935	0,27	2.300 % fällig am 21.08.2020	4.200	4.114	0,22	3.624 % fällig am 25.05.2033	1.032	1.029	0,06
8.625 % fällig am 01.02.2019	300	309	0,02	2.950 % fällig am 21.08.2022	600	576	0,03	3.967 % fällig am 25.03.2033			
Mississippi Power Co.				Volkswagen Group of America Finance LLC				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust	10	10	0,00
2.987 % fällig am 27.03.2020	3.000	3.000	0,16	2.125 % fällig am 23.05.2019	2.900	2.877	0,16	2.361 % fällig am 25.09.2035			
Morgan Stanley				2.450 % fällig am 20.11.2019	6.500	6.430	0,35	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust	1.000	1.000	0,05
2.903 % fällig am 10.02.2021	7.800	7.817	0,43	Warner Media LLC	3.000	2.980	0,16	8.223 % fällig am 15.02.2033			
3.292 % fällig am 22.07.2022	3.000	3.026	0,16	2.100 % fällig am 01.06.2019				RBSSP Resecurization Trust	1.161	1.174	0,06
Navent Corp.				WEA Finance LLC				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust	32	32	0,00
4.875 % fällig am 17.06.2019	3.700	3.723	0,20	2.700 % fällig am 17.09.2019	5.050	5.030	0,27	2.745 % fällig am 19.10.2034	1.053	1.015	0,06
5.500 % fällig am 15.01.2019	6.891	6.955	0,38	Western Gas Partners LP	2.000	1.999	0,11	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	91	91	0,01
6.625 % fällig am 26.07.2021	200	206	0,01	2.600 % fällig am 15.08.2018				2.551 % fällig am 25.04.2045	4	4	0,00
8.000 % fällig am 25.03.2020	4.000	4.230	0,23	ZF North America Capital, Inc.	280	282	0,02	3.278 % fällig am 25.10.2035	804	814	0,04
Nissan Motor Acceptance Corp.				4.000 % fällig am 29.04.2020				Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust	523	537	0,03
2.726 % fällig am 28.09.2020	1.500	1.501	0,08	Zimmer Biomet Holdings, Inc.	2.700	2.705	0,15	3.755 % fällig am 25.01.2035	80	82	0,00
2.732 % fällig am 13.07.2020	1.900	1.903	0,10	3.076 % fällig am 19.03.2021				3.822 % fällig am 25.03.2036			
2.853 % fällig am 13.09.2019	2.000	2.008	0,11					Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust	3.000	3.052	0,17
2.992 % fällig am 13.07.2022	6.800	6.810	0,37					3.273 % fällig am 15.06.2045			
3.026 % fällig am 28.09.2022	4.400	4.408	0,24								
3.232 % fällig am 13.01.2022	1.700	1.723	0,09								
Phillips 66											
2.919 % fällig am 26.02.2021	1.500	1.502	0,08								
3.098 % fällig am 15.04.2020	2.000	2.001	0,11								
Piper Jaffray Cos.											
5.060 % fällig am 09.10.2018	1.800	1.809	0,10								
Plains All American Pipeline LP											
2.600 % fällig am 15.12.2019	1.800	1.782	0,10								
Protective Life Global Funding											
2.856 % fällig am 28.06.2021	1.500	1.500	0,08								
QUALCOMM, Inc.											
2.600 % fällig am 30.01.2023	300	287	0,02								
2.881 % fällig am 20.05.2020	3.000	3.017	0,16								
3.089 % fällig am 30.01.2023	1.000	998	0,05								
QVC, Inc.											
3.125 % fällig am 01.04.2019	1.000	999	0,05								
Reliance Standard Life Global Funding											
2.150 % fällig am 15.10.2018	3.500	3.495	0,19								
Sabine Pass Liquefaction LLC											
6.250 % fällig am 15.03.2022	200	215	0,01								
Santander Holdings USA, Inc.											
2.700 % fällig am 24.05.2019	3.000	2.992	0,16								
Sempra Energy											
2.791 % fällig am 15.03.2021	4.000	4.003	0,22								
Southern Co.											
2.950 % fällig am 01.07.2023	800	773	0,04								
3.037 % fällig am 30.09.2020	3.100	3.116	0,17								
Southern Power Co.											
2.875 % fällig am 20.12.2020	5.200	5.203	0,28								
Spirit AeroSystems, Inc.											
3.118 % fällig am 15.06.2021	2.600	2.605	0,14								

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTOVER-MÖGENS
<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
U.S. Treasury Notes				VW CR, Inc.				2.799 % fällig am 27.07.2018 (c)(d)			
2,250 % fällig am 31.03.2020 (h)	\$ 111.800	\$ 111.307	6,05	2,800 % fällig am 10.12.2018	\$ 5.300	\$ 5.235	0,29		\$ 900	\$ 898	0,05
Summe USA		899.804	48,93			39.396	2,14	Summe kurzfristige Instrumente		44.483	2,42
<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				<b>AKTIEN</b>			
<b>COMMERCIAL PAPER</b>				<b>COMMERCIAL PAPER</b>				<b>ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS</b>			
Florida Power & Light Co.				Harris Corp.				PIMCO Funds Ireland p.l.c. -			
2,700 % fällig am 29.11.2018	16.000	15.818	0,86	2,794 % fällig am 27.02.2019	2.600	2.602	0,14	PIMCO US Dollar			
Ford Motor Credit Co.				Letras del Banco Central de la Republica Argentina				Short-Term Floating			
2,780 % fällig am 19.02.2019	8.000	7.860	0,43	40,700 % fällig am 18.07.2018 ARS	8.524	290	0,02	NAV Fund (f)	73.539	736	0,04
Schlumberger Holdings				Pacific Gas & Electric Co.				Summe Übertragbare Wertpapiere und			
2,560 % fällig am 09.08.2018	1.000	997	0,05	2,549 % fällig am 28.11.2018	\$ 1.000	996	0,05	Geldmarktinstrumente – Amtliche			
Sempra Energy Holdings						3.888	0,21	Börse/Geregelter Markt	\$ 1.835.899	99,82	
2,520 % fällig am 19.07.2018	3.000	2.996	0,16								
Virginia Electric & Power Co.											
2,580 % fällig am 23.07.2018	6.500	6.490	0,35								

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
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2018	5.329	\$ (2.619)	(0,14)
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2019	276	(13)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09/2018	1.046	247	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2018	4.684	0	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09/2018	158	(523)	(0,03)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09/2018	502	(599)	(0,03)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (3.507)	(0,19)

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 – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-29 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2022	\$ 26.700	\$ 384	0,02
CDX.HY-30 5-Year Index	(5,000)	20.06.2023	25.400	80	0,01
				\$ 464	0,03

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	3-Month CAD Bank Bill	2,300 %	16.07.2020	CAD 185.100	\$ 90	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,000	21.06.2020	\$ 442.000	(100)	(0,01)
					\$ (10)	0,00
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 454	0,03

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Teilfonds 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.

FREIVERKEHRFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

## OPTIONSKAUF

## ZINSSWAPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
UAG	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,750 %	23.08.2018	\$ 353.600	\$ 235	\$ 277	0,01
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,040	23.08.2018	353.600	236	96	0,01
							\$ 471	\$ 373	0,02

## VERKAUFSOPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.07.2018	\$ 8.700	\$ (12)	\$ (3)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.07.2018	12.800	(12)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	14.000	(17)	(15)	0,00
CBK	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.07.2018	8.600	(9)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,900	19.09.2018	10.000	(14)	(11)	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,725	18.07.2018	15.400	(14)	(6)	0,00
						\$ (78)	\$ (41)	0,00

## ZINSSWAPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,000 %	26.07.2018	\$ 144.200	\$ (216)	\$ (168)	(0,01)
UAG	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,880	23.08.2018	81.600	(255)	(371)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,410	23.08.2018	81.600	(256)	(29)	0,00
							\$ (727)	\$ (568)	(0,03)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07/2018	\$ 8.214	AUD 11.127	\$ 7	\$ 0	\$ 7	0,00
	08/2018	AUD 11.127	\$ 8.214	0	(7)	(7)	0,00
BPS	07/2018	€ 27.525	\$ 31.925	0	(212)	(212)	(0,01)
	07/2018	¥ 6.131.600	\$ 56.455	1.099	0	1.099	0,06
CBK	07/2018	\$ 22.922	£ 17.301	0	(80)	(80)	0,00
	08/2018	MXN 3.087	\$ 158	2	0	2	0,00
DUB	07/2018	ARS 10.046	\$ 356	13	0	13	0,00
GLM	07/2018	AUD 12.673	\$ 9.527	164	0	164	0,01
	07/2018	€ 393	\$ 459	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 18.637	€ 16.053	106	0	106	0,01
	07/2018	£ 1.474	£ 1.095	0	(29)	(29)	0,00
HUS	07/2018	€ 48	\$ 56	0	0	0	0,00
	07/2018	\$ 245	ARS 6.886	0	(10)	(10)	0,00
	07/2018	€ 47	€ 41	0	0	0	0,00
JPM	07/2018	CAD 1.136	\$ 877	13	0	13	0,00
	07/2018	£ 537	\$ 707	0	(2)	(2)	0,00
	07/2018	\$ 1.137	AUD 1.546	6	0	6	0,00
NGF	07/2018	ARS 5.364	\$ 189	6	0	6	0,00
SSB	07/2018	\$ 13.812	€ 11.865	41	0	41	0,00
	08/2018	€ 11.865	\$ 13.843	0	(40)	(40)	0,00
TOR	07/2018	\$ 55.808	¥ 6.131.600	0	(451)	(451)	(0,03)
	08/2018	¥ 6.131.600	\$ 55.922	455	0	455	0,02
UAG	07/2018	£ 17.859	\$ 23.614	36	0	36	0,00
	08/2018	\$ 23.648	£ 17.859	0	(37)	(37)	0,00
				\$ 1.948	\$ (868)	\$ 1.080	0,06

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2018 standen für die Institutionell EUR (Hegend) Class und Class E EUR (Hegend) 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	07/2018	\$ 5.203	€ 4.473	\$ 19	\$ 0	\$ 19	0,00
BOA	07/2018	130.866	111.485	0	(702)	(702)	(0,04)
BRC	07/2018	6.421	5.550	59	(1)	58	0,01
CBK	07/2018	€ 6.818	\$ 7.892	6	(75)	(69)	0,00
	07/2018	\$ 169	€ 144	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07/2018	€ 80	\$ 92	0	(1)	(1)	0,00
MSB	07/2018	113.839	131.484	0	(1.429)	(1.429)	(0,08)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	07/2018	\$ 18.003	€ 15.337	\$ 0	\$ (97)	\$ (97)	(0,01)
	08/2018	131.774	113.839	1.428	0	1.428	0,08
RYL	07/2018	€ 961	\$ 1.124	2	0	2	0,00
SCX	07/2018	\$ 121.748	€ 105.086	951	(5)	946	0,05
SSB	07/2018	€ 113.381	\$ 131.987	0	(391)	(391)	(0,02)
	07/2018	\$ 121.903	€ 104.758	408	0	408	0,02
	08/2018	132.280	113.381	386	0	386	0,02
				\$ 3.259	\$ (2.702)	\$ 557	0,03
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 1.401	0,08

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MOGENS
<b>Einlagenzertifikate</b>			
Credit Suisse AG 2,722 % fallig am 28.09.2018	\$ 15.900	\$ 15.917	0,86
First Rep Bank San Francisco 2,650 % fallig am 16.07.2018	9.300	9.303	0,51
Summe Einlagenzertifikate		\$ 25.220	1,37
Summe Anlagen		\$ 1.859.467	101,11
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (20.316)	(1,11)
Nettovermogen		\$ 1.839.151	100,00

### ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden zum 30. Juni 2018 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 44.602 als Sicherheiten verpfandet.

Barmittel in Hohe von USD 8.246 wurden zum 30. Juni 2018 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2018 Barmittel in Hohe von USD 3.100 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

(i) Pensionsgeschafte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungs- datum	Falligkeits- datum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschafte, zum Wert	Zu erhaltende Erlose aus Pensions- geschaft <sup>(1)</sup>	% des Nettover- mogens
SSB	0,850	29.06.2018	02.07.2018	\$ 301	U.S. Treasury Bonds 3,375 % fallig am 15.11.2019	\$ (310)	\$ 301	\$ 301	0,02
Summe Pensionsgeschafte						\$ (310)	\$ 301	\$ 301	0,02

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

### Bewertung zum Marktwert<sup>1</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2018 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	\$ 40.696	\$ 1.795.071	\$ 132	\$ 1.835.899
Einlagen bei Kreditinstituten	0	25.220	0	25.220
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(3.507)	1.855	0	(1.652)
Summen	\$ 37.189	\$ 1.822.146	\$ 132	\$ 1.859.467

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2017 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	\$ 47.209	\$ 1.301.661	\$ 1.777	\$ 1.350.647
Einlagen bei Kreditinstituten	0	9.908	0	9.908
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	501	(3.054)	0	(2.553)
<b>Summen</b>	<b>\$ 47.710</b>	<b>\$ 1.308.515</b>	<b>\$ 1.777</b>	<b>\$ 1.358.002</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 der Wertpapieranlagen.

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2018:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
JPS	2,350 %	29.06.2018	02.07.2018	\$ (44.856)	\$ (44.862)	(2,44)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (44.862)</b>	<b>(2,44)</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 2018:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 19	\$ 0	\$ 19
BOA	(705)	2.000	1.295
BPS	868	(900)	(32)
BRC	58	0	58
CBK	(161)	280	119
DUB	13	0	13
GLM	240	(290)	(50)
HUS	(10)	0	(10)
JPM	11	0	11
MSB	(98)	30	(68)
MYC	(168)	(440)	(608)
NGF	6	0	6
RYL	2	0	2
SCX	946	0	946
SSB	404	790	1.194
TOR	4	0	4
UAG	(28)	0	(28)

<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 der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2018:

	30. Juni 2018 (%)	31. Dez. 2017 (%)
Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse	62,13	60,08
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	27,82	33,05
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	9,87	5,31
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,19)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,03	(0,13)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,08	(0,09)
Einlagenzertifikate	1,37	0,72
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(2,44)	(0,01)

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US Short-Term Fund

30. Juni 2018

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2018</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2018</b>		
PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	55.915.032	\$ 559.799	PIMCO Funds Ireland p.l.c. - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	60.556.700	\$ 606.300
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.12.2019	\$ 420.000	417.639	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.12.2019	\$ 420.000	417.313
U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2020	118.800	118.719	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.12.2022	99.000	97.066
U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.12.2022	99.000	97.503	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	34.900	34.791
	<b>AKTIEN</b>		U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.05.2027	35.900	34.447
PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)	393.850	40.025	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)	29.141	28.462
	<b>PARI (000S)</b>		U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.10.2022	21.500	21.270
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	\$ 34.900	34.507	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	16.113	15.739
Central Nippon Expressway Co Ltd 2,803 % fällig am 15.02.2022	30.000	30.000	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2020	7.000	6.971
Export Development Canada 2,315 % fällig am 19.07.2019	18.000	18.000	Goldman Sachs Group, Inc. 3,139 % fällig am 31.10.2022	3.400	3.422
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b) 0,500 % fällig am 15.01.2028	16.098	15.774	Santander UK PLC 3,816 % fällig am 14.03.2019	2.500	2.523
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 01.05.2018	¥ 1.640.000	15.018	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 5,125 % fällig am 01.05.2026	2.300	2.327
Erste Abwicklungsanstalt 2,500 % fällig am 13.03.2020	\$ 13.000	12.975	HSBC Holdings PLC 6,250 % fällig am 23.03.2023	2.000	2.040
Dell International LLC 3,480 % fällig am 01.06.2019	12.700	12.758	Goldman Sachs Group, Inc. 3,359 % fällig am 24.07.2023	1.800	1.825
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 16.04.2018	¥ 1.380.000	12.492	eBay, Inc. 3,229 % fällig am 30.01.2023	1.800	1.811
Macquarie Bank Ltd. 2,600 % fällig am 24.06.2019	\$ 11.500	11.492	Verizon Communications, Inc. 3,335 % fällig am 16.03.2022	1.500	1.533
Freddie Mac Strips 2,257 % fällig am 15.02.2038	10.590	10.596	Jackson National Life Global Funding 3,067 % fällig am 27.06.2022	1.500	1.521
JPMorgan Chase & Co 2,945 % fällig am 18.06.2022	10.000	10.000	Sempra Energy 2,848 % fällig am 15.01.2021	1.500	1.502
SBA Tower Trust 0,000 % fällig am 04.09.2043	10.000	10.000	HSBC Holdings PLC 4,561 % fällig am 08.03.2021	1.400	1.475
Japan Bank for International Cooperation 1,750 % fällig am 13.11.2018	10.000	9.955	Sky PLC 9,500 % fällig am 11.15.2018	1.350	1.427
Pepper Residential Securities Trust No 20 2,565 % fällig am 16.09.2059	12.500	9.634			
Air Lease Corp. 3,375 % fällig am 15.01.2019	9.500	9.585			

(a) Der US Short-Term Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds 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 Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

## 1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die einzelnen in diesem Bericht beschriebenen Teilfonds (nachfolgend jeweils als „Teilfonds“ und gemeinsam als die „Teilfonds“ 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 Teilfonds und mit beschränkter Haftung, die gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 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 insofern um eine Gesellschaft des Umbrellatyps, als zu gegebener Zeit Investmentanteilklassen mit Bezug auf unterschiedliche Teilfonds ausgegeben werden können. Nach dem Ermessen des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“) dürfen für einen Teilfonds mehrere Anteilklassen („Klassen“) ausgegeben werden. Für jeden einzelnen Teilfonds wird ein gesondertes Vermögenswertportfolio geführt, welches in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die auf diesen Teilfonds zutreffen, angelegt wird. Der Verwaltungsrat darf mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Teilfonds auflegen. Darüber hinaus darf der Verwaltungsrat zu gegebener Zeit weitere Klassen einrichten. Er muss die Zentralbank vorab darüber informieren und diese Klassen von ihr freigeben lassen. Die Gesellschaft wurde am 10. Dezember 1997 gegründet.

Wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft angegeben, wurden Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Limited und PIMCO Deutschland GmbH (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) als Anlageberatungsgesellschaften für verschiedene Teilfonds der Gesellschaft bestellt. PIMCO Asia Pte. (ebenfalls eine „Anlageberatungsgesellschaft“) hat von der irischen Zentralbank die Genehmigung erhalten, als Anlageberatungsgesellschaft für irische Fonds zu agieren.

Gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft kann jede Anlageberatungsgesellschaft die diskretionäre Anlageverwaltung der Teilfonds vorbehaltlich sämtlicher geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen an eine oder mehrere Unter-Anlageberatungsgesellschaften übertragen. Soweit eine Anlageberatungsgesellschaft für einen bestimmten Teilfonds bestellt wurde, hat die Anlageberatungsgesellschaft die jeweils übrigen Anlageberatungsgesellschaften als Unter-Anlageberatungsgesellschaften bezüglich des bzw. der betreffenden Teilfonds bestellt. Die Gebühren jeder entsprechend bestellten Unter-Anlageberatungsgesellschaft sind von der Anlageberatungsgesellschaft aus ihrer eigenen Gebühr zu entrichten.

Parametric Portfolio Associates, LLC wurde damit beauftragt, Unterstützung bei der Umsetzung der Anlagepolitik des PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund, des PIMCO RAE Fundamental Europe Fund, des PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund, des PIMCO RAE Fundamental US Fund und des Strategic Income Fund zu bieten und verfügt über beschränkte Anlageentscheidungsbefugnis. In dieser Hinsicht verfügt Parametric Portfolio Associates, LLC über eine Ermessensbefugnis, für die bestimmte Parameter und Einschränkungen gelten, die zwischen der Anlageberatungsgesellschaft und Research Affiliates, LLC vereinbart wurden. Research Affiliates, LLC wurde zur Unter-Anlageberatungsgesellschaft mit Ermessensbefugnis bezüglich der oben erwähnten Fonds bestellt.

Research Affiliates, LLC wurde für den PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund, den PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund und den PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund zur Unter-Anlageberatungsgesellschaft ohne Entscheidungsbefugnis bestellt.

## 2. WICHTIGE BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Die wichtigen Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden und Schätzungstechniken, die von der Gesellschaft angewandt und bei der Aufstellung dieses Abschlusses verwendet wurden, entsprechen denen, die auf den geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017 (der „geprüfte Jahresabschluss“) angewandt wurden.

### Erstellungsgrundlage

Bei dem vorliegenden Abschluss handelt es sich um den ungeprüften verkürzten Abschluss für den Sechsmonatszeitraum zum 30. Juni 2018. Er wurde gemäß Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Zwischenberichterstattung“, der vom Financial Reporting Council („FRC“) veröffentlicht wurde, und den OGAW-Verordnungen erstellt.

Der ungeprüfte verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Jahresabschluss gelesen werden, dem ein uneingeschränkter Bestätigungsvermerk erteilt wurde und der im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen (FRS 102), dem Irischen Statut, bestehend aus dem Companies Act von 2014, und den OGAW-Verordnungen erstellt wurde. Die in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden für das Aufstellen des Abschlusses wurden vom FRC herausgegeben.

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 Ausnahme keine Kapitalflussrechnung zu erstellen Gebrauch gemacht, die offenen Investmentfonds nach FRS 102 zur Verfügung steht.

Dieser Abschluss wurde nach der Anschaffungskostenregelung unter Zugrundelegung der Neubewertung der ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten Finanzvermögen und -verbindlichkeiten aufgestellt.

Bestimmte Vergleichszahlen aus dem Vorjahreszeitraum wurden umgebucht, damit sie mit der Präsentation dieses Berichtszeitraums übereinstimmen. Diese Umbuchungen hatten keine Auswirkungen auf das ausgewiesene Handelsnettovermögen der Anteilinhaber.

Die Zahlen im Abschluss wurden auf Tausend gerundet, es sei denn, im Bericht werden anders lautende Angaben gemacht.

## 3. ANLAGEN ZUM MARKTWERT

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 Bewertungsverfahren zur Bemessung des beizulegenden Zeitwertes verwendeten Inputfaktoren.

Der beizulegende Zeitwert ist als der Betrag definiert, zu dem in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ein Vermögenswert ausgetauscht, eine Verbindlichkeit beglichen oder ein Eigenkapitalinstrument gewährt würde. Es müssen getrennt für jede Hauptklasse von Aktiva und Passiva Angaben zur Marktbewertungshierarchie gemacht werden, wobei die Bewertung zum Marktwert in Stufen (Stufen 1, 2 und 3) eingeteilt werden muss. 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 — Der nicht bereinigte, an einem aktiven Markt quotierte Preis für identische Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, auf den die Gesellschaft zum Bewertungsstichtag zugreifen kann.
- Stufe 2 — Inputparameter, bei denen es sich nicht um die der Stufe 1 zugeordneten quotierten Preise handelt, die für einen Vermögenswert oder eine Verbindlichkeit entweder direkt oder indirekt beobachtbar (d. h. anhand von Marktdaten hergeleitet) sind.
- Stufe 3 — Nicht beobachtbare Inputfaktoren (d. h. für die keine Marktdaten verfügbar sind) für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit.

Eine Analyse der zum 30. Juni 2018 und zum 31. Dezember 2017 zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Teilfonds ist der Aufstellung der Wertpapieranlagen zu entnehmen. Die von den Teilfonds für die Einordnung der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in eine Marktbewertungshierarchie verwendete Methode entspricht derjenigen, die auch für den jüngsten geprüften Jahresabschluss verwendet wurde.

## 4. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Innerhalb der durch die Anlageziele und Anlagepolitik der Teilfonds und nach Maßgabe der von der Zentralbank jeweils festgesetzten Grenzen und des laut Prospektbestimmungen erlaubten Umfangs sind die Finanzderivate und Anlagetechniken von allen Teilfonds für eine effiziente Portfolioverwaltung einzusetzen. Die Teilfonds 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 2018 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) insgesamt betrug \$17.365.610/(\$1.140.152) (30. Juni 2017 \$6.849.410/(\$1.595.749)).

Der durch die umgekehrten Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2018 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) insgesamt betrug \$813.165/(\$74.629.665) (30. Juni 2017 \$1.972.652/(\$27.028.554)).

Der durch die Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2018 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) insgesamt betrug \$217.793/(\$8.686.391) (30. Juni 2017 \$4.356.960/(\$1.381.006)).

**5. DIVIDENDENAUSCHÜTTUNGSPOLITIK**

Wie in der jeweiligen Teilfondsergänzung 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 realisierter und nicht realisierter Verluste negativ sind, können die Teilfonds dennoch Dividenden aus den Nettokapitalerträgen und/oder Kapital bezahlen.
- (iii) Andere Mittel (einschließlich Kapital), die nach dem Gesetz aus dem betreffenden Teilfonds bzw. der betreffenden Anteilsklasse des betreffenden Teilfonds ausgeschüttet werden können.
- (iv) Nettokapitalerträge und/oder Kapital.
- (v) Bruttoerträge, wobei die Verwaltungsgebühr und andere Gebühren oder ein Teil davon dem Kapital belastet wird. 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 Anleger ausschüttbaren Betrag zu maximieren.

Für die Anteile der Income II Class (wodurch höhere Renditen für Anteilinhaber erzielt werden sollen) 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 in Erwägung zu ziehen (was einer Ausschüttung aus dem Kapital entspricht). Das Renditedifferenzial kann positiv oder negativ sein und wird aufgrund der Differenz zwischen der impliziten Rendite der Währung der jeweiligen abgesicherten Anteilsklasse und der Basiswährung des Teilfonds errechnet.

Im Falle der Teilfonds Emerging Asia Bond Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Short-Term Fund, Income Fund, US Short-Term Fund und Mortgage Opportunities Fund sowie der Anteile der Class M Retail werden Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Anteilsklassen G Retail, G Institutional und Investor Income A werden Dividenden jährlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers jährlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Im Falle aller anderen Teilfonds 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 Teilfonds 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 Teilfonds wurde ein Teil der Dividendenausschüttungen gemäß der Betriebsergebnisrechnung aus dem Kapital gezahlt (Angaben in Tausend):

Fonds	Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2017 abgeschlossener Berichtszeitraum
Emerging Asia Bond Fund	-	\$ 338
Euro Income Bond Fund	€ 431	€ 2
Global Multi-Asset Fund	\$ 854	-
Income Fund	-	\$ 1

**6. SOFT COMMISSIONS**

Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann Transaktionen im Namen der Teilfonds 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 Geseellschaft bzw. ihr Anlageberatungsgesellschaft kann diesen Maklern Full-Service-Maklergebühren zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen verwendet werden. Diese Anlageberatungsgesellschaften, bei denen es sich um MiFID-Investmentgesellschaften handelt, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Teilfonds kaufen, direkt aus ihren eigenen Mitteln bezahlen.

**7. GETRENNTE HAFTUNG**

Die Gesellschaft ist eine offene Umbrella-Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und getrennter Haftung zwischen ihren Teilfonds. Dementsprechend sind etwaige Verbindlichkeiten, die im Namen eines Teilfonds der Gesellschaft entstanden oder diesem zuzuordnen sind, ausschließlich aus den Vermögenswerten des betreffenden Teilfonds zu begleichen, und weder die Gesellschaft noch ein Verwaltungsratsmitglied, Konkursverwalter, Revisor, Insolvenzverwalter, kommissarischer Insolvenzverwalter oder eine sonstige Personen dürfen die Vermögenswerte dieses Teilfonds zum Ausgleich von Verbindlichkeiten im Namen eines anderen Teilfonds der Gesellschaft verwenden oder sind verpflichtet, sie hierzu zu verwenden, unabhängig davon, wann diese Verbindlichkeit entstanden ist.

**8. ÄNDERUNGEN AM PROSPEKT, AN DER GRÜNDUNGSKRUNDE UND DER SATZUNG**

Der Nachtrag der Gesellschaft wurden aktualisiert und am 2. Januar 2018 und dann erneut am 5. Februar 2018 von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

Die folgenden Änderungen am konsolidierten Verkaufsprospekt wurden genehmigt:

- Der Low Duration Income Fund wurde genehmigt (10. Mai 2018)

Folgende Sachverhalte wurden in den Ergänzungen zum konsolidierten Verkaufsprospekt geändert:

- Änderungen am PIMCO Capital Securities Fund (5. Februar 2018)
- Änderungen am Euro Credit Fund (29. Juni 2018)
- Änderungen am UK Corporate Bond Fund (29. Juni 2018)
- Änderungen am PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (29. Juni 2018)
- Änderungen am PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund (29. Juni 2018)
- Änderungen am PIMCO RAE Fundamental US Fund (29. Juni 2018)
- Änderungen am PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund (29. Juni 2018)
- Änderungen am PIMCO RAE Fundamental Europe Fund (29. Juni 2018)

**9. GEBÜHREN UND KOSTEN**

**(a) An die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Gebühren**

Die an PIMCO Global Advisors (Ireland), Ltd. (die „Verwaltungsgesellschaft“) zu zahlenden Gebühren sind im Verkaufsprospekt aufgeführt und dürfen 2,50 % per annum des NIWs des jeweiligen Teilfonds nicht übersteigen.

**(b) Verwaltungsgebühr**

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder liefert für jeden Teilfonds, wie im Verkaufsprospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwah- und sonstige Dienste, für die jeder Teilfonds eine einzige Verwaltungsgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Verwaltungsgebühr (wie im Verkaufsprospekt definiert) für jeden Teilfonds läuft an jedem Handelstag (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Teilfonds 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-, Verwah- und anderen Dienste begleichen können, die die Verwaltungsgesellschaft für die Teilfonds erbracht hat. Die Verwaltungsgebühr für die einzelnen Klassen der einzelnen Teilfonds (angegeben in Prozent pro Jahr ihres NIW) lautet wie folgt:

Fonds	Inst'1, G Inv, Admin Classes (%)	Inst'1 (%)	Class H Retail, M Retail, T (%)	Class E, G Retail, M Retail, T (%)	Class R (in %)
PIMCO Capital Securities Fund	0,79	0,96	1,69	0,93	
Commodity Real Return Fund	0,74	0,91	1,64	0,90	
PIMCO Credit Absolute Return Fund	0,90	1,07	1,80	0,99	
Diversified Income Fund	0,69	0,86	1,59	0,87	
Diversified Income Duration Hedged Fund	0,69	0,86	1,59	0,87	

Fonds	Inst'l, G Inv, Admin Classes (%)	Inst'l Inst'l (%)	Class E, G	
			Retail, M Retail, T (%)	Class R (in %)
Dynamic Multi-Asset Fund <sup>(1)</sup>	0,80	0,97	1,85	1,02
Emerging Asia Bond Fund	0,65	0,82	1,50	0,83
Emerging Local Bond Fund	0,89	1,06	1,89	1,04
Emerging Markets 2018 Fund	0,50	0,67	1,30	0,72
Emerging Markets Bond Fund	0,79	0,96	1,69	0,93
Emerging Markets Corporate Bond Fund	0,95	1,12	1,85	1,02
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	0,85	1,02	1,75	0,96
Euro Bond Fund	0,46	0,63	1,36	0,75
Euro Credit Fund <sup>(2)</sup>	0,46	0,63	1,36	0,75
Euro Income Bond Fund	0,49	0,66	1,39	0,76
Euro Long Average Duration Fund	0,46	0,63	1,36	0,75
Euro Low Duration Fund	0,46	0,63	1,36	0,75
Euro Short-Term Fund	0,40	0,57	1,15	0,63
Global Advantage Fund	0,70	0,87	1,70	0,94
Global Advantage Real Return Fund	0,69	0,86	1,59	0,87
Global Bond ESG Fund	0,52	0,69	1,42	0,78
Global Bond Fund	0,49	0,66	1,39	0,76
Global Bond Ex-US Fund	0,49	0,66	1,39	0,76
Global High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80
Global Investment Grade Credit Fund	0,49	0,66	1,39	0,76
Global Libor Plus Bond Fund	0,49	0,66	1,20	0,66
Global Low Duration Real Return Fund	0,49	0,66	1,39	0,76
Global Multi-Asset Fund	0,95	1,12	2,15	1,18
Global Real Return Fund	0,49	0,66	1,39	0,76
Income Fund	0,55	0,72	1,45	0,80
Inflation Strategy Fund	0,90	1,07	2,10	1,16
Low Average Duration Fund	0,46	0,63	1,36	0,75
Low Duration Income Fund <sup>(3)</sup>	0,55	0,72	1,30	0,78
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	0,49	0,66	1,39	0,76
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	0,84 <sup>(4)</sup>	1,16	2,20	1,21
Mortgage Opportunities Fund	0,69	0,86	1,59	0,87
PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund <sup>(5)</sup>	0,75	0,92	1,60	0,88
PIMCO RAE Fundamental Europe Fund <sup>(6)</sup>	0,45	0,62	1,30	0,72
PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund <sup>(7)</sup>	0,50	0,67	1,35	0,74
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund	1,15	1,32	2,50	1,38
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund	0,95	1,12	2,25	1,24
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund	0,85	1,02	2,15	1,18
PIMCO RAE Fundamental US Fund <sup>(8)</sup>	0,40	0,57	1,25	0,69
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund	0,89	1,06	1,74	0,96
StocksPLUS™ Fund	0,55	0,72	1,45	0,80
Strategic Income Fund <sup>(9)</sup>	0,85	1,02	1,75	0,94
Total Return Bond Fund	0,50	0,67	1,40	0,77
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund <sup>(10)</sup>	1,15	1,32	2,25	1,22
UK Corporate Bond Fund <sup>(11)</sup>	0,46	0,63	1,36	0,75
UK Long Term Corporate Bond Fund	0,46	0,63	1,36	0,75
Unconstrained Bond Fund	0,90	1,07	1,80	0,99
US High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80
US Investment Grade Corporate Bond Fund	0,49	0,66	1,39	0,76
US Short-Term Fund <sup>(11)</sup>	0,45	0,62	0,85	0,47

- (1) Bei allen Klassen (mit Ausnahme der Class E, G Retail, M Retail, Class R und Class T) wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,05 % p.a. für die Zeit vom 1. Januar 2018 bis zum 31. Dezember 2018 berücksichtigt. Der Gebührenverzicht endet am 1. Januar 2019.
- (2) Seit dem 1. Juli 2017 wird in den Gebühren der Class Institutional ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,08 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht läuft zum 1. Juli 2019 ab. In dem angegebenen Betrag ist der für die Institutional Class geltende Gebührenverzicht nicht berücksichtigt.
- (3) Bei allen Klassen (mit Ausnahme der Class E, G und T) wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,05 % p.a. für die Zeit ab Auflegung bis zum 31. Dezember 2019 berücksichtigt. Der Gebührenverzicht endet am 1. Januar 2020. Bei der Class E, G und T wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,20 % p.a. für die Zeit ab Auflegung bis zum 30. Juni 2019 berücksichtigt. Der Gebührenverzicht endet am 1. Juli 2019.
- (4) Diese Zahl berücksichtigt einen Gebührenverzicht in Höhe von 0,15 % durch die Verwaltungsgesellschaft bis zum 30. Juni 2018. Der Gebührenverzicht endet am 1. Juli 2018 und der Nachtrag wird bei der nächsten Gelegenheit nach dem Ablauf ab dem 1. Juli 2018 aktualisiert. Der Verwaltungsrat kann in seinem Ermessen jedoch beschließen, den Gebührenverzicht über den 1. Juli 2018 hinaus zu verlängern, und der Nachtrag wird entsprechend aktualisiert.
- (5) Bei allen Klassen mit Ausnahme der Class R wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,10 % p.a. berücksichtigt. Für Class R wird ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,05 % p.a. berücksichtigt. Die Gebührenverzichtzeile verlängern sich bis zum 31. Oktober 2018. Der Gebührenverzicht endet am 1. November 2018.
- (6) Bei allen Klassen mit Ausnahme der Class R wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,20 % p.a. berücksichtigt. Für Class R wird ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,11 % p.a. berücksichtigt. Die Gebührenverzichtzeile verlängern sich bis zum 31. Oktober 2018. Der Gebührenverzicht endet am 1. November 2018.
- (7) Bei allen Klassen mit Ausnahme der Class R wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,10 % p.a. berücksichtigt. Für Class R wird ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,06 % p.a. berücksichtigt. Die Gebührenverzichtzeile verlängern sich bis zum 31. Oktober 2018. Der Gebührenverzicht endet am 1. November 2018.
- (8) Diese Zahl berücksichtigt für alle Klassen einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,05 % bis zum 31. Dezember 2018.
- (9) Diese Zahl berücksichtigt für alle Klassen einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,25 % bis zum 31. Juli 2018.
- (10) Seit dem 1. Juli 2017 wird in den Gebühren der Class Institutional ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,07 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht läuft zum 1. Juli 2019 ab. In dem angegebenen Betrag ist der für die Institutional Class geltende Gebührenverzicht nicht berücksichtigt.
- (11) In den Gebühren für Class E, G Retail und M Retail wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,30 % p.a. berücksichtigt. In den Gebühren für Class R wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,16 % p.a. berücksichtigt. Die Gebührenverzichtzeile verlängern sich bis zu dem Zeitpunkt, zu dem der Manager durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Teilfonds entscheidet, diesen Gebührenverzicht künftig nicht mehr anzuwenden oder zu reduzieren.

Während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2018 blieben die Verwaltungsgebühren gegenüber 2017 unverändert.

Der Low Duration Income Fund wurde während des Berichtszeitraums aufgelegt.

Die Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen Class H Institutional, Class E, Class G Retail, Class M Retail und Class T 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 Anteilinhabern dieser Anteilsklassen der Teilfonds 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 Anteilinhabern 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 kämen alle Preissenkungen für von der Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste der Verwaltungsgesellschaft und nicht den Anteilinhabern zugute. Dies betrifft u.a. geringere Kosten (in Prozent des Nettovermögens) aufgrund eines steigenden Nettovermögens.

Aufgrund der Art der Emission von Class Z wird in der Betriebsergebnisrechnung keine Verwaltungsgebühr ausgewiesen (die Class Z-Anteile werden primär für andere Teilfonds der Gesellschaft oder für Direktanlagen durch institutionelle Anleger angeboten, die mit der Anlageberatungsgesellschaft oder einem verbundenen Unternehmen von PIMCO eine Anlageverwaltungsvereinbarung oder sonstige Vereinbarung abgeschlossen haben). Um doppelte Gebühren zu vermeiden, wird die Verwaltungsgebühr für Class Z-Anteile 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 Teilfonds. 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 Unterdepotdienste für die einzelnen Teilfonds. 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 der Notierungs- und Zahlstellen- sowie sonstige Vertretungsdienste vor Ort, Buchhaltungs-, Prüf-, Rechts- sowie sonstige Dienste qualifizierter Berater, Gesellschaftssekretärsdienste, Druck-, Veröffentlichungs- und Übersetzungsdienste sowie die Erbringung und Koordination bestimmter Aufsichts-, Administrations- und Anteilinhaberdienste, die für den Betrieb der Teilfonds erforderlich sind. Gebühren und ordentliche Aufwendungen für diese Dienste (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften für die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr gezahlt.

Die Fonds übernehmen sonstige Aufwendungen im Zusammenhang mit ihrem Betrieb, die nicht von der Managementgebühr 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, 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 Verwaltungsratsmitgliedern während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2018 €116.500 (zum 30. Juni 2017 lag dieser Betrag bei €60.000). Darüber hinaus werden jedem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied alle angemessenen Auslagen erstattet. Die Verwaltungsrats honorare 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 Anteilinhaberdienstleistungen oder für die Verwaltung von Plänen oder Programmen, die Teilfondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, und um sonstige verbundene Aufwendungen zu erstatten. Die Verwaltungsgesellschaft erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Anteilinhaber der Investor Classes. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten identische Dienstleistungen für die erhobenen Gebühren. Diese Dienste können beinhalten: die Beantwortung von Anteilinhaberanfragen zu den Teilfonds und ihrer Wertentwicklung, die Unterstützung von Anteilinhabern beim Erwerb, der Rücknahme und dem Tausch von Anteilen, die Führung von individueller Kontoinformationen und die Bereitstellung von Kontoauszügen an die Anteilinhaber sowie die Führung sonstiger Unterlagen, die für die Anlage der Anteilinhaber im Teilfonds relevant sind.

Pläne oder Programme, die Teilfondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, können fondsgebundene Versicherungsprodukte sowie Pensions-, Altersversorgungs- oder Sparpläne von Arbeitgebern beinhalten. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten Dienstleistungen entsprechend der Vereinbarungen mit den Finanzintermediären, mit denen die Anteilinhaber ein Dienstleistungsverhältnis unterhalten. Die Servicegebühr errechnet sich jährlich aus 0,35 % des NIW des jeweiligen Teilfonds, der auf die Investor Classes entfällt. Die Servicegebühr hat sich von 2017 auf 2018 nicht geändert. Die Servicegebühr wird aus dem NIW gezahlt, der auf den NIW der Investor Classes dieser Teilfonds entfällt. Die Servicegebühr für die einzelnen Teilfonds 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 Anteile der Administrative Class ist zahlbar an die Vertriebsstelle für persönliche Dienstleistungen, die sie den Anteilinhabern der Teilfonds erbringt, und für die Führung der Anteilinhaberkonten, einschließlich der Vergütung und der Aufwendungen (einschließlich Telefonkosten 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 Anteilinhabern regelmäßig Informationen über ihre Beteiligung an den Teilfondsanteilen liefern, Informationen von der Gesellschaft an die Anteilinhaber weitergeben, laufende Beratungsleistungen in Bezug auf die Eignung bestimmter vom Teilfonds angebotener Anlagemöglichkeiten vor dem Hintergrund der Anteilinhaberanforderungen erbringen, Anfragen der Anteilinhaber zu diesen Diensten beantworten oder 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 Anteilen der Administrative Class. Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Teilfonds 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 Bestandspflegegebühr für die einzelnen Teilfonds (dargestellt in Prozent des NIW) beläuft sich mit Ausnahme des StocksPLUS™ Fund auf 0,50 % p.a. des auf die Administrative Classes entfallenden NIW. Die Bestandspflegegebühr für den StocksPLUS™ Fund (dargestellt in Prozent des NIW) beläuft sich 0,75 % p.a. des auf die Administrative Classes entfallenden NIW.

Die Bestandspflegevergütungen wurden gegenüber 2017 nicht geändert.

### **(e) Vertriebsgebühr**

Die Vertriebsgebühr, die für Anteile der Class T anwendbar ist, wird an die Vertriebsstelle für Dienstleistungen bezahlt, die diese Anteilinhabern des Teilfonds erbracht hat.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Anteilen der Class T. Die Vertriebsgebühr errechnet sich jährlich aus 0,40 % des NIW des jeweiligen Teilfonds, der auf die Anteile der Class T entfällt, außer in Bezug auf den PIMCO Credit Absolute Return Fund, den Euro Bond Fund, den Global Bond ESG Fund, den Global Bond Fund, den Global Bond Ex-US Fund, den Global Libor Plus Bond Fund, den Global Low Duration Real Return Fund, den Global Real Return Fund, den PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund, den PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund, den Total Return Bond Fund und den Unconstrained Bond Fund. Für diese Teilfonds wird eine Vertriebsgebühr von 0,30 % p.a. auf den NIW dieser Teilfonds bezahlt.

Die Vertriebsgebühr für die einzelnen Teilfonds 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 Teilfonds für alle Klassen des Teilfonds 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 Teilfonds (vor Anrechnung eines etwa anwendbaren Verzichts auf die Verwaltungsgebühr) aus etwa anfallenden Service- und Bestandspflegegebühren sowie aus sonstigen von dieser Teilfondsklasse zu tragenden Kosten, die die oben beschriebene Verwaltungsgebühr nicht abdeckt, (ausgenommen Gründungskosten und anteilige Verwaltungsrats honorare) zzgl. 0,0049 % pro Jahr (täglich auf Basis des Teilfonds-NIW berechnet) überschreiten. .

In jedem Monat, in dem der Verwaltungsvertrag gilt, darf die Verwaltungsgesellschaft von einem Teilfonds 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 pro Jahr 0,0049 % vom durchschnittlichen (täglich berechneten) Nettovermögen der Klasse des betreffenden Teilfonds 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 Teilfonds 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. An diese Parteien zahlbare Gebühren werden in Erläuterung 9 offengelegt

Zum 30. Juni 2018 hielt die Verwaltungsgesellschaft 1.748.726 (31. Dezember 2017: 1.431.711) Anteile des US Short-Term Fund.

Zum 30. Juni 2018 war der Global Multi-Asset Fund in Anteile der Class Z des Global Advantage Real Return Fund und des Income Fund investiert. Der Dynamic Multi-Asset Fund war in Anteile der Class Z des Income Fund und des Mortgage Opportunities Fund investiert. Der Diversified Income Fund, der Diversified Income Duration Hedged Fund, der Global Bond Fund, der Low Average Duration Fund, der Total Return Bond Fund, der Unconstrained Bond Fund und der US High Yield Bond Fund waren in Anteile der Class Z des US Short-Term Fund investiert. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Z Class und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Z Class dieser Teilfonds 0,00 % pro Jahr.

Bestimmte Teilfonds legen in Anteile der Class Z des PIMCO China Bond Fund an, die als mit der Gesellschaft verbunden gelten. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Class Z und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Class Z beider Fonds 0,00 % pro Jahr.

Bestimmte Teilfonds investieren in den PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF Fund, den PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF Fund und den PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF Fund, und diese gelten als mit der Gesellschaft verbunden. Da diese Teilfonds keine gebührenfreien Anteilsklassen haben, wird die Verwaltungsgebühr vom Dachfonds und dem verbundenen Zielfonds bezahlt. Ein Verzicht auf die Anlageberatungsgebühr wird daher vor der Zahlung durch den Teilfonds an den Manager ausgeglichen, was in der Betriebsergebnisrechnung innerhalb der Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen wird.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2018 und zum 30. Juni 2017 kauften und verkauften die unten erwähnten Teilfonds Wertpapiere verbundener Teilfonds, sie nahmen Käufe und Verkäufe in Bezug auf Überkreuzinvestitionen und Käufe und Verkäufe in verbundenen Teilfonds vor (Angaben in Tausend):

Fonds	30. Juni 2018	
	Käufe	Verkäufe
PIMCO Capital Securities Fund	\$ 772.428	\$ 950.687
Commodity Real Return Fund	4.518	605
PIMCO Credit Absolute Return Fund	110.449	134.237
Diversified Income Fund	300.206	358.452
Diversified Income Duration Hedged Fund	142.167	67.294
Dynamic Multi-Asset Fund	55.629	41.839
Emerging Asia Bond Fund	193	202
Emerging Local Bond Fund	914.274	776.271
Emerging Markets 2018 Fund	253	1.155
Emerging Markets Bond Fund	1.261.762	1.576.688
Emerging Markets Corporate Bond Fund	75.244	93.416

Fonds	30. Juni 2018	
	Käufe	Verkäufe
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	13.605	543
Euro Bond Fund	76.954	45.597
Euro Credit Fund	121.431	238.417
Euro Income Bond Fund	212.640	91.643
Euro Long Average Duration Fund	31.664	31.065
Euro Low Duration Fund	17.076	57.005
Euro Short-Term Fund	44.460	133.205
Global Advantage Fund	133.776	171.326
Global Advantage Real Return Fund	25.828	23.202
Global Bond ESG Fund	4.158	-
Global Bond Fund	3.328.164	2.912.747
Global Bond Ex-US Fund	167.227	168.464
Global High Yield Bond Fund	1.207.282	1.478.743
Global Investment Grade Credit Fund	4.632.617	4.913.170
Global Libor Plus Bond Fund	66.565	52.267
Global Low Duration Real Return Fund	433.483	425.282
Global Multi-Asset Fund	340.589	349.695
Global Real Return Fund	495.417	361.490
Income Fund	12.996.741	13.947.049
Inflation Strategy Fund	28.540	27.700
Low Average Duration Fund	238.088	219.621
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	154.022	145.799
Low Duration Income Fund	\$ 5.046	\$ -
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	17.764	29.200
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund	528	2.312
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund	-	26.588
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund	242.851	199.003
StocksPLUS™ Fund	76.243	4.213
Total Return Bond Fund	898.235	693.700
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	2.814	3.800
UK Corporate Bond Fund	15.095	57.597
UK Long Term Corporate Bond Fund	116.677	62.725
Unconstrained Bond Fund	249.175	250.222
US High Yield Bond Fund	109.024	33.792
US Investment Grade Corporate Bond Fund	16.745	17.291
US Short-Term Fund	685.259	675.760

Fonds	30. Juni 2017	
	Käufe	Verkäufe
PIMCO Capital Securities Fund	\$ 174.854	\$ 101.808
Commodity Real Return Fund	630	829
PIMCO Credit Absolute Return Fund	14.980	41.738
Diversified Income Fund	525.337	87.730
Diversified Income Duration Hedged Fund	101.301	155.602
Dynamic Multi-Asset Fund	57	74
Emerging Asia Bond Fund	1.910	4.153
Emerging Local Bond Fund	72.136	88.502
Emerging Markets 2018 Fund	273	210
Emerging Markets Bond Fund	131.589	179.596
Emerging Markets Corporate Bond Fund	10.650	15.147
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	331	1.226
Euro Bond Fund	56.829	14.172
Euro Credit Fund	15.523	27.992
Euro Income Bond Fund	24.774	16.326
Euro Long Average Duration Fund	13.667	13.156
Euro Low Duration Fund	401	9.884
Euro Short-Term Fund	117.260	2.218
Global Advantage Fund	9.941	8.930
Global Advantage Real Return Fund	5.034	5.706
Global Bond ESG Fund	10.879	2.929
Global Bond Fund	148.864	123.216
Global Bond Ex-US Fund	19.116	17.654
Global High Yield Bond Fund	119.549	44.929
Global Investment Grade Credit Fund	645.261	613.785
Global Libor Plus Bond Fund	870	506
Global Low Duration Real Return Fund	86.911	54.745
Global Multi-Asset Fund	26.064	50.971
Global Real Return Fund	55.619	105.628
Income Fund	1.078.977	458.065
Inflation Strategy Fund	2.778	2.946
Low Average Duration Fund	22.852	28.270
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	43.017	45.628
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	2.223	499
Mortgage Opportunities Fund	21.011	918
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund	147	171
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund	2.253	7.190
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund	54	11.210
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund	13.998	22.884
StocksPLUS™ Fund	29.445	12.717

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	30. Juni 2017	
	Käufe	Verkäufe
Strategic Income Fund	\$ 14.033	\$ 17.532
Total Return Bond Fund	105.709	158.488
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	11.216	29.193
UK Corporate Bond Fund	87.591	6.255
UK Long Term Corporate Bond Fund	8.910	82.637
Unconstrained Bond Fund	127.323	31.245
US High Yield Bond Fund	27.762	45.926
US Investment Grade Corporate Bond Fund	4.406	5.657
US Short-Term Fund	94.077	119.686

In der folgenden Tabelle ist der Wert der umlaufenden Anteile aufgeführt, die zum 30. Juni 2018 und zum 31. Dezember 2017 von der Allianz Group als verbundene Parteien der Gesellschaft gehalten wurden und jeweils mehr als 20 % der Gesamtanteile eines Teilfonds ausmachen.

Fonds	2018 % Gehalten	2017 % Gehalten
Diversified Income Fund	26,72	23,31
Dynamic Multi-Asset Fund	34,17	k. A.
Emerging Asia Bond Fund	21,17	k. A.
Emerging Local Bond Fund	32,76	25,15
Emerging Markets 2018 Fund	72,91	72,08
Emerging Markets Bond Fund	36,69	50,75
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	24,67	32,00
Euro Income Bond Fund	k. A.	20,13
Global Investment Grade Credit Fund	k. A.	27,29
Global Multi-Asset Fund	28,83	25,16
Inflation Strategy Fund	47,92	46,97
PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund	k. A.	21,41
PIMCO RAE Fundamental Europe Fund	72,35	67,27
PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund	65,90	52,76
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund	39,68	k. A.
PIMCO RAE Fundamental US Fund	96,34	98,66
Strategic Income Fund	69,54	64,38
Total Return Bond Fund	20,43	20,48

### Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs an Anteilen und Verträgen

Zum 30. Juni 2018 hielt V. Mangala Ananthanarayanan 8.758,00 (31. Dezember 2017: 8.758,00) Anteile des Dynamic Multi-Asset Fund, 7.365,04 (31. Dezember 2017: 7.239,00) Anteile des Global Investment Grade Credit Fund und 19.170,65 (31. Dezember 2017: 18.801,00) Anteile des Income Fund, bei denen es sich jeweils um Teilfonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2018 hielt David M. Kennedy 5.852,91 (31. Dezember 2017: 6.033,93) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 16.786,79 (31. Dezember 2017: 16.786,79) Anteile des Global Multi-Asset Fund. Beide sind Teilfonds der Gesellschaft.

Zum 30. Juni 2018 hielt Michael J. Meagher 2.218,88 (31. Dezember 2017: 2.218,88) Anteile des Global Low Duration Real Return Fund, eines Teilfonds der Gesellschaft.

Keines der Verwaltungsratsmitglieder verfügte über einen Dienstleistungsvertrag mit der Gesellschaft.

Während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2018 hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

### 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 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 Teilfonds und Finanzdaten für die Gesellschaft zu erhalten (was nach irischem Gesellschaftsrecht erforderlich ist), wurden die Beträge im Finanzstatus zu dem am 30. Juni 2018 geltenden Wechselkurs von Euro in USD (USD/EUR 0,85649) (31. Dezember 2017 USD/EUR 0,83278) und von Pfund Sterling in USD (USD/GBP 0,75743) (31. Dezember 2017 USD/GBP 0,73924) umgerechnet. Die Beträge in der Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen wurden zu einem durchschnittlichen Wechselkurs während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2018 von Euro in USD (USD/EUR 0,82683) (Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017 USD/EUR 0,88677) und von GBP in USD (USD/GBP 0,72721) (Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017 USD/GBP 0,77667) umgerechnet.

Die folgende Tabelle gibt die am 30. Juni 2018 und am 31. Dezember 2017 für die Umrechnung in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar verwendeten Wechselkurse wieder. Diese wurden ebenfalls verwendet, um die Anlagen sowie sonstigen Aktiva und Passiva, die nicht auf Pfund Sterling, Euro und US-Dollar lauten, umzurechnen.

Fremdwährung	30. Juni 2018 Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67315
ARS	33,68383	k. A.	28,85000
AUD	1,58023	1,78690	1,35346
BRL	4,49203	k. A.	3,84740
CAD	1,53585	1,73672	1,31545
CHF	1,15932	k. A.	0,99295
CLP	k. A.	k. A.	651,04500
CNH	7,73829	8,75036	6,62780
CNY	7,73537	k. A.	6,62530
COP	3.429,08415	k. A.	2.936,99000
CZK	26,01501	k. A.	22,28170
DKK	7,45072	8,42518	6,38150
DOP	k. A.	k. A.	49,64000
EGP	k. A.	k. A.	17,89000
EUR (oder €)	1,00000	1,13079	0,85649
GBP (oder £)	0,88434	1,00000	0,75743
HKD	9,15996	k. A.	7,84545
HUF	329,12519	k. A.	281,89375
IDR	16.730,99870	k. A.	14.330,00000
ILS	k. A.	k. A.	3,66055
INR	k. A.	k. A.	68,51500
JPY (oder ¥)	129,32373	146,23755	110,76500
KRW	1.301,23503	k. A.	1.114,50000
KZT	k. A.	k. A.	341,20500
MXN	22,94908	25,95051	19,65575
MYR	k. A.	k. A.	4,03950
NGN	422,06951	k. A.	361,50000
NOK	9,51600	10,76057	8,15040
NZD	1,72447	1,95000	1,47700
PEN	k. A.	k. A.	3,27450
PHP	k. A.	k. A.	53,36750
PLN	4,37125	k. A.	3,74395
RON	k. A.	k. A.	3,99440
RUB	73,20834	k. A.	62,70250
SEK	10,44491	k. A.	8,94600
SGD	1,59196	1,80016	1,36350
THB	k. A.	k. A.	33,13000
TRY	5,34878	6,04833	4,58120
TWD	35,59686	k. A.	30,48850
UAH	k. A.	k. A.	26,33000
USD (oder \$)	1,16755	1,32025	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	31,30500
VND	k. A.	k. A.	22.958,50000
ZAR	16,00274	k. A.	13,70625

Fremdwahrung	31. Dezember 2017 Prasentationswahrung		
	EUR	GBP	USD
ARS	22,60506	k. A.	18,82500
AUD	1,53526	1,72953	1,27853
BRL	3,98317	4,48721	3,31710
CAD	1,50454	1,69493	1,25295
CHF	1,17018	k. A.	0,97450
CLP	k. A.	k. A.	614,98000
CNH	7,81967	8,80917	6,51205
CNY	7,81961	k. A.	6,51200
COP	k. A.	k. A.	2.984,50000
CZK	25,52901	k. A.	21,26000
DKK	7,44544	8,38759	6,20040
EGP	k. A.	k. A.	17,78000
EUR (oder €)	1,00000	1,12654	0,83278
GBP (oder £)	0,88767	1,00000	0,73924
HKD	9,38702	k. A.	7,81713
HUF	310,20506	k. A.	258,33195
IDR	16.291,85689	k. A.	13.567,50000
ILS	k. A.	k. A.	3,47165
INR	76,64408	86,34264	63,82750
JPY (oder ¥)	135,27014	152,38727	112,65000
KRW	1.285,51667	k. A.	1.070,55000
MXN	23,49426	26,46723	19,56550
MYR	k. A.	k. A.	4,04700
NGN	432,28808	k. A.	360,00000
NOK	9,82177	11,06461	8,17935
NZD	1,68841	1,90207	1,40607
PEN	3,89119	4,38359	3,24050
PHP	k. A.	k. A.	49,92000
PLN	4,17254	k. A.	3,47480
RON	k. A.	k. A.	3,88800
RUB	69,13157	k. A.	57,57125
SEK	9,83155	k. A.	8,18750
SGD	1,60475	1,80781	1,33640
THB	k. A.	k. A.	32,59000
TRY	4,55295	5,12909	3,79160
TWD	35,73401	k. A.	29,75850
USD (oder \$)	1,20080	1,35275	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	28,77000
VND	k. A.	k. A.	22.709,00000
ZAR	14,86591	k. A.	12,38000

### 13. FINANZIELLE RISIKEN

Durch ihre Aktivitaten sind die Fonds verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt, z. B. dem Marktrisiko (einschlielich Preisrisiko, Zinsrisiko und Wahrungsrisiko), dem Kreditrisiko und dem Liquiditatsrisiko. Der allgemeine Risikomanagementprozess fur die Fonds konzentriert sich auf die Unvorhersehbarkeit der Finanzmarkte und versucht, potenziell nachteilige Effekte auf die finanzielle Entwicklung der Fonds zu minimieren.

Die Zielsetzungen und Richtlinien des Finanzrisikomanagements der Gesellschaft entsprechen auch weiterhin denjenigen, die im gepruften Jahresabschluss der Gesellschaft fur das Geschaftsjahr zum 31. Dezember 2017 angegeben sind.

### 14. GRUNDKAPITAL

#### (a) Genehmigte Anteile

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft betragt €38.092 und ist in 30.000 Zeichneranteile zu je €1,27 und 50.000.000.000 Aktien ohne Nennwert aufgeteilt, die ursprunglich als „nicht klassifizierte Anteile“ bezeichnet wurden.

#### (b) Zeichneranteile

Bis auf sieben sind die ursprunglichen 30.000 Zeichneranteile zuruckgenommen worden. Die Zeichneranteile sind nicht Bestandteil des NIW der Gesellschaft und werden daher im Abschluss nur in Form dieser Erlauterung erwahnt. Nach Ansicht des Verwaltungsrates geben diese Offenlegungen die Art des Geschaftes der Gesellschaft als Investmentfonds wieder.

### (c) Ruckgabe- und gewinnberechtigte Anteile

Das ausgegebene gewinnberechtigte Grundkapital entspricht jederzeit dem NIW der Teilfonds. Ruckgabe- und gewinnberechtigte Anteile werden auf Antrag des Anteilinhabers zuruckgenommen und sind als Finanzverbindlichkeiten klassifiziert.

### 15. NETTOINVENTARWERTE

Im Folgenden sind das ruckgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhabern zuzuschreibende Nettovermogen der einzelnen Teilfonds, die ausgegebenen und umlaufenden Anteile und der Nettoinventarwert je Anteil der vergangenen drei Jahre (Angaben in Tausend, ausgenommen Betrage je Anteil) aufgefuhrt. Das Nettovermogen geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen und umlaufenden Anteile kann vom NIW aufgrund gerundeter Werte abweichen:

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
	PIMCO Capital Securities Fund		
Nettovermogen	\$ 7.742.951	\$ 8.731.253	\$ 5.410.259
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 1.157.514	\$ 1.431.662	\$ 1.001.084
ausgegebene und umlaufende Anteile	67.627	81.156	63.143
NIW je Anteil	\$ 17,12	\$ 17,64	\$ 15,86
Ausschüttende Anteile	\$ 345.068	\$ 343.253	\$ 197.244
ausgegebene und umlaufende Anteile	33.758	31.990	19.728
NIW je Anteil	\$ 10,22	\$ 10,73	\$ 10,00
Institutional BRL (Hedged)			
Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 7.757	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	926	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,37	k. A.	k. A.
Institutional CHF (Hedged)			
Class:			
Thesaurierende Anteile	CHF 41.911	CHF 89.004	CHF 62.356
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.845	5.773	4.396
NIW je Anteil	CHF 14,73	CHF 15,42	CHF 14,19
Institutional EUR (Hedged)			
Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 1.953.412	€ 2.215.360	€ 1.480.114
ausgegebene und umlaufende Anteile	149.201	161.980	118.097
NIW je Anteil	€ 13,09	€ 13,68	€ 12,54
Ausschüttende Anteile	€ 406.591	€ 421.390	€ 318.007
ausgegebene und umlaufende Anteile	34.304	33.412	26.557
NIW je Anteil	€ 11,85	€ 12,61	€ 11,98
Income II Shares	€ 68.129	€ 75.209	€ 24.502
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.305	7.548	2.570
NIW je Anteil	€ 9,33	€ 9,96	€ 9,54
Institutional GBP (Hedged)			
Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 39.730	£ 42.723	£ 47.460
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.035	3.139	3.836
NIW je Anteil	£ 13,09	£ 13,61	£ 12,37
Ausschüttende Anteile	£ 324.013	£ 364.210	£ 289.190
ausgegebene und umlaufende Anteile	26.563	28.196	23.766
NIW je Anteil	£ 12,20	£ 12,92	£ 12,17
Institutional SGD (Hedged)			
Class:			
Income II Shares	SGD 1.028	SGD 1.089	SGD 233
ausgegebene und umlaufende Anteile	102	103	23
NIW je Anteil	SGD 10,04	SGD 10,62	SGD 10,00

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)</b>			
Investor Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 303.163	\$ 253.944	\$ 53.207
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.644	20.805	4.833
NIW je Anteil	\$ 11,82	\$ 12,21	\$ 11,01
Ausschüttende Anteile	\$ 158.764	\$ 186.250	\$ 38.710
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.611	17.448	3.892
NIW je Anteil	\$ 10,17	\$ 10,67	\$ 9,95
Investor AUD (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	AUD 13	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD 9,84	k. A.	k. A.
Investor CAD (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	CAD 329	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	33	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CAD 9,96	k. A.	k. A.
Investor EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 21.651	€ 27.155	€ 2.205
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.872	2.244	198
NIW je Anteil	€ 11,56	€ 12,10	€ 11,13
Investor CNH (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	CNH 1.595	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	16	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CNH 99,71	k. A.	k. A.
Investor SGD (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	SGD 13	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,84	k. A.	k. A.
Administrative Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 187.997	\$ 214.268	\$ 188.070
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.292	12.456	12.104
NIW je Anteil	\$ 16,65	\$ 17,20	\$ 15,54
Ausschüttende Anteile	\$ 151.065	\$ 181.676	\$ 142.647
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.994	12.598	10.616
NIW je Anteil	\$ 13,74	\$ 14,42	\$ 13,44
Administrative EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 38.555	€ 46.152	€ 37.640
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.453	2.804	2.483
NIW je Anteil	€ 15,72	€ 16,46	€ 15,17
Administrative SEK (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	SEK 3.885	SEK 3.556	SEK 3.280
ausgegebene und umlaufende Anteile	36	31	31
NIW je Anteil	SEK 108,46	SEK 113,74	SEK 104,91
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 374.950	\$ 382.594	\$ 300.536
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.111	29.675	25.706
NIW je Anteil	\$ 12,45	\$ 12,89	\$ 11,69
Ausschüttende Anteile	\$ 103.753	\$ 104.130	\$ 73.906
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.192	9.747	7.425
NIW je Anteil	\$ 10,18	\$ 10,68	\$ 9,96
Class E CHF (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	CHF 15.030	CHF 15.294	CHF 6.356
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.421	1.376	616
NIW je Anteil	CHF 10,58	CHF 11,12	CHF 10,33
Class E EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 618.524	€ 579.684	€ 403.807
ausgegebene und umlaufende Anteile	52.319	46.731	35.204
NIW je Anteil	€ 11,82	€ 12,40	€ 11,47
Ausschüttende Anteile	€ 91.610	€ 61.794	€ 14.402
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.390	5.954	1.461
NIW je Anteil	€ 9,76	€ 10,38	€ 9,86
Class G Institutional EUR (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 1.142	€ 1.370	€ 200
ausgegebene und umlaufende Anteile	110	126	19

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)</b>			
NIW je Anteil	€ 10,37	€ 10,83	€ 10,59
Class M Retail:			
Income II Shares	\$ 359.442	\$ 537.623	\$ 240.410
ausgegebene und umlaufende Anteile	36.712	51.882	24.505
NIW je Anteil	\$ 9,79	\$ 10,36	\$ 9,81
Class M Retail HKD (Unhedged):			
Ausschüttende Anteile	HKD 148.261	HKD 172.357	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.183	16.877	k. A.
NIW je Anteil	HKD 9,76	HKD 10,21	k. A.
Class M Retail SGD (Hedged):			
Income II Shares	SGD 52.244	SGD 51.645	SGD 45.616
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.312	4.943	4.602
NIW je Anteil	SGD 9,83	SGD 10,45	SGD 9,92
Class R:			
Ausschüttende Anteile	\$ 8.362	\$ 10.474	\$ 8.365
ausgegebene und umlaufende Anteile	814	971	833
NIW je Anteil	\$ 10,28	\$ 10,79	\$ 10,05
Class R EUR (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 17.720	€ 18.031	€ 4.736
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.864	1.783	493
NIW je Anteil	€ 9,50	€ 10,11	€ 9,61
Class R GBP (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	£ 9.788	£ 9.497	£ 4.177
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.004	920	429
NIW je Anteil	£ 9,75	£ 10,33	£ 9,73
Class T:			
Ausschüttende Anteile	\$ 7.981	\$ 11.523	\$ 2.728
ausgegebene und umlaufende Anteile	761	1.047	266
NIW je Anteil	\$ 10,49	\$ 11,01	\$ 10,26
Class T EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 53.765	€ 43.841	€ 8.581
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.937	3.829	807
NIW je Anteil	€ 10,89	€ 11,45	€ 10,63
Class Z:			
Ausschüttende Anteile	\$ 108.640	\$ 121.268	\$ 220.242
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.661	10.273	20.029
NIW je Anteil	\$ 11,25	\$ 11,80	\$ 11,00
Class Z AUD (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	AUD 54.021	AUD 37.737	AUD 3.401
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.215	3.466	337
NIW je Anteil	AUD 10,36	AUD 10,89	AUD 10,09
<b>Commodity Real Return Fund</b>			
Nettvermögen	\$ 638.523	\$ 518.533	\$ 433.637
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 409.411	\$ 336.611	\$ 284.951
ausgegebene und umlaufende Anteile	60.875	49.850	43.333
NIW je Anteil	\$ 6,73	\$ 6,75	\$ 6,58
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 38.074	€ 18.983	€ 24.227
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.256	2.578	3.314
NIW je Anteil	€ 7,24	€ 7,36	€ 7,31
Institutional GBP (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 10.794	£ 8.070	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.090	805	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,90	£ 10,02	k. A.
Investor Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 24.643	\$ 17.440	\$ 4.911
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.185	2.944	849
NIW je Anteil	\$ 5,89	\$ 5,92	\$ 5,79
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 113.246	\$ 99.205	\$ 96.006
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.224	17.568	17.302
NIW je Anteil	\$ 5,60	\$ 5,65	\$ 5,55

	Zum 30. Jun. 2018 Zum 31. Dez. 2017 Zum 31. Dez. 2016		
	Commodity Real Return Fund (Forts.)		
Ausschüttende Anteile	\$ 2.162	\$ 2.265	\$ 2.928
ausgegebene und umlaufende Anteile	555	577	757
NIW je Anteil	\$ 3,89	\$ 3,93	\$ 3,87
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 25.972	€ 24.400	€ 18.285
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.501	4.138	3.097
NIW je Anteil	€ 5,77	€ 5,90	€ 5,90
<b>Class G Institutional EUR (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	€ 28	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,05	k. A.	k. A.
	PIMCO Credit Absolute Return Fund		
Nettvermögen	\$ 182.982	\$ 288.667	\$ 290.967
<b>Institutional Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 37.778	\$ 46.235	\$ 41.154
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.001	3.651	3.478
NIW je Anteil	\$ 12,59	\$ 12,66	\$ 11,83
<b>Institutional CHF (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	CHF 22.819	CHF 23.303	CHF 16.436
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.160	2.160	1.593
NIW je Anteil	CHF 10,56	CHF 10,79	CHF 10,32
<b>Institutional EUR (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 45.041	€ 77.990	€ 58.809
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.770	6.405	5.070
NIW je Anteil	€ 11,94	€ 12,18	€ 11,80
Income II Shares	€ 14.672	€ 32.224	€ 115.527
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.659	3.472	12.541
NIW je Anteil	€ 8,85	€ 9,28	€ 9,21
<b>Investor Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 10	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,41	\$ 10,50	k. A.
Ausschüttende Anteile	\$ 10	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,97	\$ 10,27	k. A.
<b>Class E:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 14.878	\$ 18.521	\$ 8.784
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.375	1.693	852
NIW je Anteil	\$ 10,82	\$ 10,94	\$ 10,32
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 30.570	€ 54.537	€ 38.545
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.970	5.174	3.805
NIW je Anteil	€ 10,29	€ 10,54	€ 10,13
<b>Class G Institutional EUR (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	€ 73	€ 73	€ 63
ausgegebene und umlaufende Anteile	8	8	6
NIW je Anteil	€ 9,30	€ 9,48	€ 9,83
<b>Class T EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 1.565	€ 1.712	€ 242
ausgegebene und umlaufende Anteile	157	167	24
NIW je Anteil	€ 10,00	€ 10,25	€ 9,88

	Zum 30. Jun. 2018 Zum 31. Dez. 2017 Zum 31. Dez. 2016		
	Diversified Income Fund		
Nettvermögen	\$ 6.999.008	\$ 7.918.902	\$ 5.875.038
<b>Institutional Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 276.927	\$ 287.237	\$ 250.095
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.245	12.435	11.740
NIW je Anteil	\$ 22,61	\$ 23,10	\$ 21,31
Ausschüttende Anteile	\$ 88.067	\$ 72.704	\$ 43.894
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.156	4.873	3.064
NIW je Anteil	\$ 14,31	\$ 14,92	\$ 14,33
<b>Institutional CHF (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	CHF 10.005	CHF 11.755	CHF 9.359
ausgegebene und umlaufende Anteile	773	876	740
NIW je Anteil	CHF 12,94	CHF 13,42	CHF 12,65
Ausschüttende Anteile	CHF 2.115	CHF 2.319	CHF 7.241
ausgegebene und umlaufende Anteile	231	240	762
NIW je Anteil	CHF 9,15	CHF 9,68	CHF 9,50
<b>Institutional EUR (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 812.940	€ 918.478	€ 760.392
ausgegebene und umlaufende Anteile	50.132	54.721	48.157
NIW je Anteil	€ 16,22	€ 16,78	€ 15,79
Ausschüttende Anteile	€ 387.727	€ 384.525	€ 393.698
ausgegebene und umlaufende Anteile	39.999	37.534	39.260
NIW je Anteil	€ 9,69	€ 10,24	€ 10,03
<b>Institutional GBP (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	£ 953.118	£ 981.839	£ 991.139
ausgegebene und umlaufende Anteile	73.707	73.724	79.776
NIW je Anteil	£ 12,93	£ 13,32	£ 12,43
Ausschüttende Anteile	£ 524.997	£ 574.861	£ 367.946
ausgegebene und umlaufende Anteile	74.468	77.547	51.111
NIW je Anteil	£ 7,05	£ 7,41	£ 7,20
<b>Institutional SEK (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	SEK 625.605	SEK 598.823	SEK 562.109
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.747	3.463	3.451
NIW je Anteil	SEK 166,97	SEK 172,94	SEK 162,93
<b>Investor Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 30.840	\$ 34.667	\$ 16.607
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.648	2.909	1.506
NIW je Anteil	\$ 11,65	\$ 11,92	\$ 11,03
Ausschüttende Anteile	\$ 7.577	\$ 3.390	\$ 2.330
ausgegebene und umlaufende Anteile	785	337	241
NIW je Anteil	\$ 9,65	\$ 10,06	\$ 9,67
<b>Investor EUR (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 12.865	€ 14.159	€ 10.341
ausgegebene und umlaufende Anteile	824	875	677
NIW je Anteil	€ 15,60	€ 16,18	€ 15,27
Ausschüttende Anteile	€ 3.461	€ 3.632	€ 2.853
ausgegebene und umlaufende Anteile	378	375	301
NIW je Anteil	€ 9,15	€ 9,67	€ 9,47
<b>Administrative Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	\$ 16.064	\$ 15.722	\$ 9.446
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.522	1.429	894
NIW je Anteil	\$ 10,55	\$ 11,00	\$ 10,57

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Diversified Income Fund (Forts.)</b>			
<b>Administrative EUR (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 1.948	€ 3.109	€ 2.593
ausgegebene und umlaufende Anteile	127	195	172
NIW je Anteil	€ 15,35	€ 15,93	€ 15,06
<b>Administrative GBP (Hedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	£ 3.052	£ 2.746	£ 3.282
ausgegebene und umlaufende Anteile	296	253	312
NIW je Anteil	£ 10,32	£ 10,85	£ 10,53
<b>Class E:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 388.326	\$ 443.537	\$ 309.747
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.144	21.310	15.993
NIW je Anteil	\$ 20,28	\$ 20,81	\$ 19,37
Ausschüttende Anteile	\$ 474.427	\$ 548.435	\$ 455.841
ausgegebene und umlaufende Anteile	37.157	41.196	35.659
NIW je Anteil	\$ 12,77	\$ 13,31	\$ 12,79
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 777.302	€ 848.054	€ 634.820
ausgegebene und umlaufende Anteile	52.546	55.140	43.486
NIW je Anteil	€ 14,79	€ 15,38	€ 14,60
Ausschüttende Anteile	€ 743.748	€ 837.214	€ 734.442
ausgegebene und umlaufende Anteile	67.341	71.729	64.276
NIW je Anteil	€ 11,04	€ 11,67	€ 11,43
<b>Class G Institutional EUR (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	€ 2.781	€ 2.391	€ 879
ausgegebene und umlaufende Anteile	289	240	86
NIW je Anteil	€ 9,63	€ 9,97	€ 10,21
<b>Class G Retail EUR (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	€ 983	€ 1.051	€ 1.401
ausgegebene und umlaufende Anteile	99	101	133
NIW je Anteil	€ 9,97	€ 10,36	€ 10,52
<b>Class H Institutional:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 286.111	\$ 424.028	\$ 206.581
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.642	24.125	12.723
NIW je Anteil	\$ 17,19	\$ 17,58	\$ 16,24
<b>Class M Retail:</b>			
Ausschüttende Anteile	\$ 98.990	\$ 104.094	\$ 82.708
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.068	9.145	7.567
NIW je Anteil	\$ 10,92	\$ 11,38	\$ 10,93
Income II Shares	\$ 19.375	\$ 22.893	\$ 18.441
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.057	2.313	1.909
NIW je Anteil	\$ 9,42	\$ 9,90	\$ 9,66
<b>Class M Retail AUD (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	AUD 16.746	AUD 32.382	AUD 29.915
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.591	2.950	2.851
NIW je Anteil	AUD 10,52	AUD 10,98	AUD 10,49
<b>Class R:</b>			
Ausschüttende Anteile	\$ 2.079	\$ 1.000	\$ 662
ausgegebene und umlaufende Anteile	212	98	68
NIW je Anteil	\$ 9,79	\$ 10,21	\$ 9,81
<b>Class T:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 4.795	\$ 4.767	\$ 2.381
ausgegebene und umlaufende Anteile	430	416	222
NIW je Anteil	\$ 11,14	\$ 11,46	\$ 10,70
Ausschüttende Anteile	\$ 1.781	\$ 1.913	\$ 1.181
ausgegebene und umlaufende Anteile	178	183	118
NIW je Anteil	\$ 10,03	\$ 10,46	\$ 10,04

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Diversified Income Fund (Forts.)</b>			
<b>Class T EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 25.960	€ 31.415	€ 6.005
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.463	2.861	574
NIW je Anteil	€ 10,54	€ 10,98	€ 10,47
Ausschüttende Anteile	€ 16.996	€ 63.955	€ 4.692
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.797	6.399	479
NIW je Anteil	€ 9,46	€ 9,99	€ 9,79
<b>Nettovermögen</b>	\$ 1.323.238	\$ 1.258.972	\$ 1.298.408
<b>Institutional Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 128.951	\$ 122.146	\$ 171.503
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.772	9.205	13.971
NIW je Anteil	\$ 13,20	\$ 13,27	\$ 12,28
Ausschüttende Anteile	\$ 4.957	\$ 4.434	\$ 403
ausgegebene und umlaufende Anteile	469	409	39
NIW je Anteil	\$ 10,57	\$ 10,84	\$ 10,40
<b>Institutional EUR (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 60.487	€ 86.638	€ 207.519
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.721	6.637	16.862
NIW je Anteil	€ 12,81	€ 13,05	€ 12,31
Income II Shares	€ 200.602	€ 196.530	€ 211.832
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.493	21.133	23.153
NIW je Anteil	€ 8,92	€ 9,30	€ 9,15
<b>Institutional GBP (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	£ 302.696	£ 326.098	£ 361.138
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.436	23.842	28.223
NIW je Anteil	£ 13,49	£ 13,68	£ 12,80
Ausschüttende Anteile	£ 61.281	£ 52.472	£ 47.144
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.581	5.449	5.050
NIW je Anteil	£ 9,31	£ 9,63	£ 9,34
<b>Investor Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 14.510	\$ 15.916	\$ 7.182
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.299	1.414	688
NIW je Anteil	\$ 11,17	\$ 11,25	\$ 10,45
Ausschüttende Anteile	\$ 2.615	\$ 507	\$ 761
ausgegebene und umlaufende Anteile	272	51	80
NIW je Anteil	\$ 9,63	\$ 9,88	\$ 9,48
<b>Class E:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 31.179	\$ 33.684	\$ 22.270
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.786	2.981	2.111
NIW je Anteil	\$ 11,19	\$ 11,30	\$ 10,55
Ausschüttende Anteile	\$ 49.805	\$ 52.688	\$ 61.754
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.956	5.113	6.249
NIW je Anteil	\$ 10,05	\$ 10,30	\$ 9,88
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 195.587	€ 101.462	€ 65.966
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.021	8.121	5.549
NIW je Anteil	€ 12,21	€ 12,49	€ 11,89
Ausschüttende Anteile	€ 64.046	€ 44.656	€ 13.878
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.157	4.802	1.527
NIW je Anteil	€ 8,95	€ 9,30	€ 9,09

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)</b>			
<b>Class R:</b>			
Ausschüttende Anteile	\$ 1.642	\$ 1.085	\$ 3.426
ausgegebene und umlaufende Anteile	169	109	359
NIW je Anteil	\$ 9,71	\$ 9,96	\$ 9,55
<b>Class T:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 1.072	\$ 915	\$ 90
ausgegebene und umlaufende Anteile	98	83	9
NIW je Anteil	\$ 10,89	\$ 11,02	\$ 10,33
<b>Dynamic Multi-Asset Fund</b>			
Nettovermögen	€ 1.165.166	€ 1.033.781	€ 436.861
<b>Institutional Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 595.079	€ 500.270	€ 139.146
ausgegebene und umlaufende Anteile	52.738	43.742	12.973
NIW je Anteil	€ 11,28	€ 11,44	€ 10,73
Income II Shares	€ 1.671	€ 61.986	€ 66.111
ausgegebene und umlaufende Anteile	149	5.459	6.202
NIW je Anteil	€ 11,19	€ 11,35	€ 10,66
<b>Institutional CHF (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	CHF 1.486	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	150	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 9,90	k. A.	k. A.
<b>Institutional GBP (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	£ 1.802	£ 1.485	£ 483
ausgegebene und umlaufende Anteile	156	128	45
NIW je Anteil	£ 11,52	£ 11,62	£ 10,80
<b>Institutional USD (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 50.006	\$ 40.153	\$ 18.927
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.230	3.397	1.740
NIW je Anteil	\$ 11,82	\$ 11,82	\$ 10,88
<b>Class E:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 507.195	€ 425.880	€ 213.085
ausgegebene und umlaufende Anteile	46.102	37.997	20.050
NIW je Anteil	€ 11,00	€ 11,21	€ 10,63
Ausschüttende Anteile	€ 8	€ 8	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,76	€ 9,94	k. A.
<b>Class E USD (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 1.668	\$ 4.675	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	160	445	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,44	\$ 10,50	k. A.
Ausschüttende Anteile	\$ 10	\$ 13	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,45	\$ 10,50	k. A.
<b>Class T:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 13.270	€ 6.321	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.283	599	1
NIW je Anteil	€ 10,34	€ 10,55	€ 10,05
<b>Class G Institutional:</b>			
Ausschüttende Anteile	€ 357	€ 300	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	35	29	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,17	€ 10,30	k. A.
<b>Emerging Asia Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 35.857	\$ 39.966	\$ 51.319
<b>Institutional Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 18	\$ 18	\$ 17
ausgegebene und umlaufende Anteile	2	2	2
NIW je Anteil	\$ 10,62	\$ 10,91	\$ 10,26
<b>Institutional EUR (Unhedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 23	€ 33	€ 7.734
ausgegebene und umlaufende Anteile	2	2	528
NIW je Anteil	€ 13,69	€ 13,67	€ 14,65

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Emerging Asia Bond Fund (Forts.)</b>			
<b>Class E:</b>			
Ausschüttende Anteile	\$ 23.263	\$ 25.579	\$ 28.491
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.851	2.980	3.306
NIW je Anteil	\$ 8,16	\$ 8,58	\$ 8,62
<b>Class E EUR (Unhedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 3.512	€ 3.594	€ 3.141
ausgegebene und umlaufende Anteile	281	287	232
NIW je Anteil	€ 12,49	€ 12,53	€ 13,53
<b>Class M Retail HKD (Unhedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	HKD 66.295	HKD 78.271	HKD 87.931
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.284	10.455	11.794
NIW je Anteil	HKD 7,14	HKD 7,49	HKD 7,46
<b>Emerging Local Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 2.356.190	\$ 3.008.766	\$ 2.225.792
<b>Institutional Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 745.034	\$ 592.053	\$ 446.269
ausgegebene und umlaufende Anteile	60.230	44.585	38.568
NIW je Anteil	\$ 12,37	\$ 13,28	\$ 11,57
Ausschüttende Anteile	\$ 93.376	\$ 683.235	\$ 611.545
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.262	81.096	79.875
NIW je Anteil	\$ 7,61	\$ 8,42	\$ 7,65
<b>Institutional CHF (Unhedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	CHF 107.933	CHF 113.911	CHF 102.670
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.933	11.954	11.855
NIW je Anteil	CHF 9,04	CHF 9,53	CHF 8,66
<b>Institutional EUR (Unhedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 151.232	€ 251.016	€ 227.271
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.940	20.577	18.779
NIW je Anteil	€ 11,69	€ 12,20	€ 12,10
Ausschüttende Anteile	€ 729.619	€ 761.754	€ 444.161
ausgegebene und umlaufende Anteile	97.050	94.167	53.072
NIW je Anteil	€ 7,52	€ 8,09	€ 8,37
<b>Institutional GBP (Unhedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	£ 79.362	£ 84.385	£ 80.453
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.289	4.353	4.350
NIW je Anteil	£ 18,50	£ 19,39	£ 18,49
<b>Investor Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 15.827	\$ 11.918	\$ 19.394
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.671	1.170	2.177
NIW je Anteil	\$ 9,47	\$ 10,19	\$ 8,90
<b>Investor CHF (Unhedged) Class:</b>			
ausgegebene und umlaufende Anteile	165	196	269
NIW je Anteil	CHF 9,91	CHF 10,45	CHF 9,53
<b>Investor EUR (Unhedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 4.235	€ 3.960	€ 3.633
ausgegebene und umlaufende Anteile	387	346	319
NIW je Anteil	€ 10,94	€ 11,44	€ 11,38

Th  
esauri  
rende  
Anteile

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Emerging Local Bond Fund (Forts.)</b>			
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 46.645	\$ 52.921	\$ 61.758
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.143	4.357	5.777
NIW je Anteil	\$ 11,26	\$ 12,15	\$ 10,68
Ausschüttende Anteile	\$ 21.818	\$ 23.735	\$ 21.638
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.061	3.009	3.018
NIW je Anteil	\$ 7,13	\$ 7,89	\$ 7,17
Class E EUR (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 106.390	€ 102.979	€ 114.551
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.008	7.390	8.203
NIW je Anteil	€ 13,29	€ 13,94	€ 13,96
Class G Institutional EUR (Unhedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 26.997	€ 28.090	€ 480
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.983	2.973	47
NIW je Anteil	€ 9,05	€ 9,45	€ 10,31
Class G Retail EUR (Unhedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 2.784	€ 4.594	€ 5.693
ausgegebene und umlaufende Anteile	358	563	646
NIW je Anteil	€ 7,78	€ 8,16	€ 8,81
Class T EUR (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 295	€ 97	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	32	10	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,36	€ 9,84	k. A.
Class Z:			
Ausschüttende Anteile	\$ 25.654	\$ 27.847	\$ 22.874
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.811	2.757	2.492
NIW je Anteil	\$ 9,13	\$ 10,10	\$ 9,18
<b>Emerging Markets 2018 Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 66.276	\$ 73.238	\$ 66,8
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 226	\$ 224	\$ 216
ausgegebene und umlaufende Anteile	19	19	19
NIW je Anteil	\$ 11,60	\$ 11,50	\$ 11,11
Ausschüttende Anteile	\$ 153	\$ 40.762	\$ 40.797
ausgegebene und umlaufende Anteile	15	3.964	3.964
NIW je Anteil	\$ 10,21	\$ 10,28	\$ 10,29
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 47.381	€ 15.920	€ 20.093
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.301	1.439	1.843
NIW je Anteil	€ 11,01	€ 11,07	€ 10,90
Investor Class:			
Thesaurierende Anteile	k. A.	\$ 422	\$ 411
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	37	37
NIW je Anteil	k. A.	\$ 11,37	\$ 11,02
Administrative EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 56	€ 56	€ 56
ausgegebene und umlaufende Anteile	5	5	5
NIW je Anteil	€ 10,81	€ 10,89	€ 10,78
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 40	\$ 63	\$ 63
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	6	6
NIW je Anteil	\$ 11,26	\$ 11,20	\$ 10,91

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Emerging Markets 2018 Fund (Forts.)</b>			
Class E EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 8.144	€ 9.610	€ 2.909
ausgegebene und umlaufende Anteile	762	891	272
NIW je Anteil	€ 10,69	€ 10,78	€ 10,71
Class G Retail EUR (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 35	€ 36	€ 145
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	4	14
NIW je Anteil	€ 9,64	€ 9,72	€ 10,30
Class R GBP (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	£ 698	£ 740	£ 683
ausgegebene und umlaufende Anteile	62	66	62
NIW je Anteil	£ 11,26	£ 11,25	£ 11,02
<b>Emerging Markets Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 2.644.154	\$ 3.324.965	\$ 2.599.611
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 294.341	\$ 421.362	\$ 250.633
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.568	8.969	5.881
NIW je Anteil	\$ 44,81	\$ 46,98	\$ 42,63
Ausschüttende Anteile	\$ 77.539	\$ 86.402	\$ 348.978
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.325	4.505	19.145
NIW je Anteil	\$ 17,93	\$ 19,18	\$ 18,23
Institutional CHF (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	CHF 74.434	CHF 79.222	CHF 75.613
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.793	3.717	3.646
NIW je Anteil	CHF 19,63	CHF 21,32	CHF 20,75
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 295.119	€ 477.012	€ 423.467
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.595	11.549	11.083
NIW je Anteil	€ 38,86	€ 41,30	€ 38,22
Ausschüttende Anteile	€ 842.623	€ 991.292	€ 937.770
ausgegebene und umlaufende Anteile	91.672	99.416	97.119
NIW je Anteil	€ 9,19	€ 9,97	€ 9,66
Institutional EUR (Unhedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 36.292	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.556	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,21	k. A.	k. A.
Institutional GBP (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 224.963	£ 257.097	£ 45.390
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.082	9.811	1.888
NIW je Anteil	£ 24,77	£ 26,20	£ 24,04
Ausschüttende Anteile	£ 66.794	£ 69.803	£ 11.096
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.773	14.300	2.365
NIW je Anteil	£ 4,52	£ 4,88	£ 4,69
Investor Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 6.944	\$ 7.138	\$ 4.234
ausgegebene und umlaufende Anteile	164	160	105
NIW je Anteil	\$ 42,36	\$ 44,49	\$ 40,51
Ausschüttende Anteile	\$ 806	\$ 1.061	\$ 824
ausgegebene und umlaufende Anteile	69	85	69
NIW je Anteil	\$ 11,73	\$ 12,55	\$ 11,93
Investor EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 4.200	€ 5.185	€ 3.785
ausgegebene und umlaufende Anteile	115	133	105
NIW je Anteil	€ 36,59	€ 38,96	€ 36,18

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016	
<b>Emerging Markets Bond Fund (Forts.)</b>				
Administrative Class:				
Thesaurierende Anteile	\$ 27.978	\$ 30.087	\$ 17.736	
ausgegebene und umlaufende Anteile	671	687	444	
NIW je Anteil	\$ 41,69	\$ 43,81	\$ 39,95	
Class E:				
Thesaurierende Anteile	\$ 62.114	\$ 99.556	\$ 56.017	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.543	2.349	1.445	
NIW je Anteil	\$ 40,24	\$ 42,38	\$ 38,79	
Ausschüttende Anteile	\$ 118.434	\$ 147.729	\$ 80.552	
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.960	12.781	7.333	
NIW je Anteil	\$ 10,80	\$ 11,56	\$ 10,99	
Class E EUR (Hedged):				
Thesaurierende Anteile	€ 132.533	€ 119.656	€ 107.250	
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.805	3.218	3.090	
NIW je Anteil	€ 34,83	€ 37,19	€ 34,72	
Class E SGD (Hedged):				
Thesaurierende Anteile	SGD 10.099	SGD 12.231	SGD 5.284	
ausgegebene und umlaufende Anteile	173	198	93	
NIW je Anteil	SGD 58,33	SGD 61,72	SGD 56,63	
Class G Institutional EUR (Hedged):				
Ausschüttende Anteile	€ 477	€ 492	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile	51	49	k. A.	
NIW je Anteil	€ 9,39	€ 9,98	k. A.	
Class H Institutional:				
Thesaurierende Anteile	\$ 25.547	\$ 41.318	\$ 70.047	
ausgegebene und umlaufende Anteile	580	895	1.669	
NIW je Anteil	\$ 44,01	\$ 46,18	\$ 41,97	
Class M Retail:				
Ausschüttende Anteile	\$ 18.320	\$ 25.294	\$ 24.063	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.886	2.434	2.437	
NIW je Anteil	\$ 9,71	\$ 10,39	\$ 9,88	
Income II Shares	\$ 1.387	\$ 4.609	\$ 35.236	
ausgegebene und umlaufende Anteile	157	483	3.825	
NIW je Anteil	\$ 8,85	\$ 9,54	\$ 9,21	
Class M Retail AUD (Hedged):				
Ausschüttende Anteile	AUD 3.443	AUD 12.442	AUD 9.528	
ausgegebene und umlaufende Anteile	374	1.261	1.020	
NIW je Anteil	AUD 9,22	AUD 9,87	AUD 9,34	
Class T EUR (Hedged):				
Thesaurierende Anteile	€ 754	€ 221	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile	76	21	k. A.	
NIW je Anteil	€ 9,95	€ 10,65	k. A.	
Class Z:				
Ausschüttende Anteile	\$ 8.816	\$ 4.110	\$ 3.663	
ausgegebene und umlaufende Anteile	740	322	302	
NIW je Anteil	\$ 11,92	\$ 12,75	\$ 12,12	
<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>				
Nettovermögen	\$ 199.350	\$ 233.998	\$ 236.470	
Institutional Class:				
Thesaurierende Anteile	\$ 25.825	\$ 26.491	\$ 42.030	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.725	1.722	2.977	
NIW je Anteil	\$ 14,97	\$ 15,38	\$ 14,12	
Institutional EUR (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	€ 69.883	€ 84.518	€ 71.227	
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.081	5.903	5.317	
NIW je Anteil	€ 13,75	€ 14,32	€ 13,40	

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016	
<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)</b>				
Institutional GBP (Hedged) Class:				
Ausschüttende Anteile	£ 5.260	£ 64	£ 4.311	
ausgegebene und umlaufende Anteile	580	7	457	
NIW je Anteil	£ 9,08	£ 9,63	£ 9,43	
Administrative Class:				
Thesaurierende Anteile	\$ 475	\$ 691	\$ 2.551	
ausgegebene und umlaufende Anteile	52	72	278	
NIW je Anteil	\$ 9,07	\$ 9,55	\$ 9,19	
Class E:				
Thesaurierende Anteile	\$ 13.748	\$ 20.403	\$ 24.986	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.166	1.677	2.217	
NIW je Anteil	\$ 11,79	\$ 12,17	\$ 11,27	
Class E CHF (Hedged):				
Thesaurierende Anteile	CHF 21.902	CHF 26.397	CHF 36.077	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.024	2.328	3.357	
NIW je Anteil	CHF 10,82	CHF 11,34	CHF 10,75	
Class E EUR (Hedged):				
Thesaurierende Anteile	€ 39.058	€ 45.324	€ 45.439	
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.108	3.449	3.663	
NIW je Anteil	€ 12,56	€ 13,14	€ 12,41	
Class Z:				
Ausschüttende Anteile	\$ 3.107	\$ 3.324	\$ 3.027	
ausgegebene und umlaufende Anteile	307	312	295	
NIW je Anteil	\$ 10,13	\$ 10,65	\$ 10,25	
<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>				
Nettovermögen	\$ 56.873	\$ 44.882	\$ 38.275	
Institutional Class:				
Thesaurierende Anteile	\$ 16.323	\$ 5.708	\$ 6.105	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.224	412	495	
NIW je Anteil	\$ 13,33	\$ 13,86	\$ 12,33	
Institutional EUR (Unhedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	€ 10.868	€ 9.522	€ 7.021	
ausgegebene und umlaufende Anteile	851	737	536	
NIW je Anteil	€ 12,78	€ 12,92	€ 13,09	
Class E:				
Thesaurierende Anteile	\$ 8.193	\$ 7.821	\$ 7.479	
ausgegebene und umlaufende Anteile	670	612	652	
NIW je Anteil	\$ 12,24	\$ 12,78	\$ 11,47	
Ausschüttende Anteile	\$ 2.586	\$ 2.730	\$ 3.064	
ausgegebene und umlaufende Anteile	258	257	320	
NIW je Anteil	\$ 10,02	\$ 10,60	\$ 9,59	
Class E EUR (Unhedged):				
Thesaurierende Anteile	€ 14.631	€ 14.314	€ 13.484	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.159	1.116	1.029	
NIW je Anteil	€ 12,62	€ 12,82	€ 13,10	
<b>Euro Bond Fund</b>				
Nettovermögen	€ 1.480.570	€ 1.264.884	€ 1.223.748	
Institutional Class:				
Thesaurierende Anteile	€ 1.292.728	€ 1.074.100	€ 965.771	
ausgegebene und umlaufende Anteile	53.272	44.517	40.816	
NIW je Anteil	€ 24,27	€ 24,13	€ 23,66	
Ausschüttende Anteile	€ 60.468	€ 60.087	€ 80.845	
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.752	3.737	5.085	
NIW je Anteil	€ 16,12	€ 16,08	€ 15,90	

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Euro Bond Fund (Forts.)</b>			
Institutional CHF (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	CHF 7.268	CHF 7.238	CHF 10.389
ausgegebene und umlaufende Anteile	215	215	313
NIW je Anteil	CHF 33,81	CHF 33,67	CHF 33,17
Investor Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 16.320	€ 12.132	€ 29.827
ausgegebene und umlaufende Anteile	711	531	1.326
NIW je Anteil	€ 22,95	€ 22,85	€ 22,49
Ausschüttende Anteile	€ 674	€ 1.772	€ 2.313
ausgegebene und umlaufende Anteile	44	115	152
NIW je Anteil	€ 15,47	€ 15,44	€ 15,26
Administrative Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 3.557	€ 3.854	€ 4.184
ausgegebene und umlaufende Anteile	160	174	192
NIW je Anteil	€ 22,20	€ 22,12	€ 21,80
Class E:			
Thesaurierende Anteile	€ 70.215	€ 73.882	€ 92.283
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.234	3.408	4.301
NIW je Anteil	€ 21,71	€ 21,68	€ 21,46
Ausschüttende Anteile	€ 28.837	€ 31.553	€ 37.948
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.458	2.693	3.273
NIW je Anteil	€ 11,73	€ 11,72	€ 11,59
Class G Institutional:			
Ausschüttende Anteile	€ 620	€ 539	€ 343
ausgegebene und umlaufende Anteile	55	48	31
NIW je Anteil	€ 11,19	€ 11,12	€ 11,13
Class T:			
Thesaurierende Anteile	€ 881	€ 779	€ 544
ausgegebene und umlaufende Anteile	84	74	52
NIW je Anteil	€ 10,54	€ 10,54	€ 10,46
<b>Euro Credit Fund</b>			
Nettovermögen	€ 696.137	€ 774.565	€ 437.297
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 493.559	€ 523.296	€ 267.634
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.895	32.802	17.234
NIW je Anteil	€ 15,98	€ 15,95	€ 15,53
Income II Shares	€ 106.850	€ 159.753	€ 67.035
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.840	14.603	6.183
NIW je Anteil	€ 10,86	€ 10,94	€ 10,84
Class E:			
Thesaurierende Anteile	€ 95.728	€ 91.516	€ 102.628
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.313	6.967	7.951
NIW je Anteil	€ 13,09	€ 13,14	€ 12,91
<b>Euro Income Bond Fund</b>			
Nettovermögen	€ 1.408.103	€ 1.046.201	€ 736.637
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 75.436	€ 73.968	€ 45.740
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.186	5.042	3.272
NIW je Anteil	€ 14,55	€ 14,67	€ 13,98
Ausschüttende Anteile	€ 128.536	€ 51.352	€ 63.349
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.824	4.620	5.752
NIW je Anteil	€ 10,87	€ 11,11	€ 11,02
Institutional USD (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 75.509	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.523	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,04	k. A.	k. A.

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Euro Income Bond Fund (Forts.)</b>			
Investor Class:			
Ausschüttende Anteile	€ 5.514	€ 9.412	€ 19.208
ausgegebene und umlaufende Anteile	512	854	1.751
NIW je Anteil	€ 10,76	€ 11,02	€ 10,97
Class E:			
Thesaurierende Anteile	€ 485.948	€ 263.809	€ 133.583
ausgegebene und umlaufende Anteile	35.694	19.127	10.073
NIW je Anteil	€ 13,61	€ 13,79	€ 13,26
Ausschüttende Anteile	€ 626.888	€ 630.215	€ 470.311
ausgegebene und umlaufende Anteile	61.937	60.611	45.157
NIW je Anteil	€ 10,12	€ 10,40	€ 10,42
Class T:			
Thesaurierende Anteile	€ 13.063	€ 10.179	€ 2.723
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.224	940	260
NIW je Anteil	€ 10,67	€ 10,83	€ 10,46
Ausschüttende Anteile	€ 8.045	€ 7.266	€ 1.723
ausgegebene und umlaufende Anteile	880	772	182
NIW je Anteil	€ 9,14	€ 9,41	€ 9,49
<b>Euro Long Average Duration Fund</b>			
Nettovermögen	€ 234.599	€ 254.382	€ 338.449
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 234.599	€ 254.382	€ 338.449
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.314	10.482	14.177
NIW je Anteil	€ 25,19	€ 24,27	€ 23,88
<b>Euro Low Duration Fund</b>			
Nettovermögen	€ 675.979	€ 434.279	€ 76.326
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 649.449	€ 418.083	€ 59.590
ausgegebene und umlaufende Anteile	57.044	36.496	5.226
NIW je Anteil	€ 11,39	€ 11,46	€ 11,40
Institutional AUD (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	k. A.	AUD 10.689	AUD 10.379
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1.000	1.000
NIW je Anteil	k. A.	AUD 10,69	AUD 10,38
Class E:			
Thesaurierende Anteile	€ 26.530	€ 9.234	€ 9.612
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.643	911	944
NIW je Anteil	€ 10,04	€ 10,14	€ 10,19
<b>Euro Short-Term Fund</b>			
Nettovermögen	€ 1.058.749	€ 1.458.614	€ 1.518.400
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 712.646	€ 1.015.934	€ 985.504
ausgegebene und umlaufende Anteile	58.810	83.123	80.455
NIW je Anteil	€ 12,12	€ 12,22	€ 12,25
Income II Shares	€ 101	€ 96.124	€ 123.237
ausgegebene und umlaufende Anteile	10	9.714	12.374
NIW je Anteil	€ 9,80	€ 9,90	€ 9,96
Class E:			
Thesaurierende Anteile	€ 346.002	€ 346.556	€ 409.659
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.304	30.971	36.253
NIW je Anteil	€ 11,05	€ 11,19	€ 11,30

	Zum 30. Jun. 2018			Zum 31. Dez. 2017			Zum 31. Dez. 2016		
	Global Advantage Fund								
Nettovermögen	\$	746.525	\$	789.081	\$	724.172			
Institutional Class:									
Thesaurierende Anteile	\$	22.652	\$	23.161	\$	21.181			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.673		1.675		1.696			
NIW je Anteil	\$	13,54	\$	13,83	\$	12,49			
Institutional CHF (Partially Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	CHF	104.097	CHF	114.924	CHF	115.501			
ausgegebene und umlaufende Anteile		9.962		10.725		11.039			
NIW je Anteil	CHF	10,45	CHF	10,71	CHF	10,46			
Institutional DKK (Partially Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	DKK	589.891	DKK	597.128	DKK	585.530			
ausgegebene und umlaufende Anteile		54.268		54.268		54.268			
NIW je Anteil	DKK	10,87	DKK	11,00	DKK	10,79			
Institutional EUR (Partially Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	€	358.737	€	366.096	€	367.502			
ausgegebene und umlaufende Anteile		27.964		28.210		28.891			
NIW je Anteil	€	12,83	€	12,98	€	12,72			
Institutional GBP (Partially Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	£	27.401	£	27.637	£	38.315			
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.301		2.301		3.313			
NIW je Anteil	£	11,91	£	12,01	£	11,56			
Institutional NOK (Partially Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	NOK	436.088	NOK	441.591	NOK	419.728			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.311		3.309		3.303			
NIW je Anteil	NOK	131,72	NOK	133,47	NOK	127,08			
Class E:									
Thesaurierende Anteile	\$	4.616	\$	5.302	\$	5.543			
ausgegebene und umlaufende Anteile		426		476		546			
NIW je Anteil	\$	10,84	\$	11,13	\$	10,16			
Ausschüttende Anteile	\$	123	\$	138	\$	253			
ausgegebene und umlaufende Anteile		12		13		26			
NIW je Anteil	\$	10,13	\$	10,45	\$	9,60			
Class E EUR (Partially Hedged):									
Thesaurierende Anteile	€	11.421	€	12.710	€	15.893			
ausgegebene und umlaufende Anteile		964		1.055		1.332			
NIW je Anteil	€	11,85	€	12,05	€	11,93			
	Global Advantage Real Return Fund								
Nettovermögen	\$	101.439	\$	126.444	\$	196.580			
Institutional Class:									
Thesaurierende Anteile	\$	14.995	\$	16.496	\$	16.648			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.643		1.730		1.929			
NIW je Anteil	\$	9,13	\$	9,54	\$	8,63			
Institutional CHF (Partially Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	CHF	9.252	CHF	9.889	CHF	9.485			
ausgegebene und umlaufende Anteile		938		971		969			
NIW je Anteil	CHF	9,86	CHF	10,18	CHF	9,79			
Institutional EUR (Partially Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	€	6.625	€	6.890	€	12.759			
ausgegebene und umlaufende Anteile		625		632		1.175			
NIW je Anteil	€	10,60	€	10,90	€	10,86			
Ausschüttende Anteile	€	8.808	€	10.177	€	47.137			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.080		1.194		5.390			
NIW je Anteil	€	8,15	€	8,52	€	8,75			
Income II Shares	k. A.		€	9.460	€	18.142			
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		1.066		1.978			
NIW je Anteil	k. A.		€	8,88	€	9,18			

	Zum 30. Jun. 2018			Zum 31. Dez. 2017			Zum 31. Dez. 2016		
	Global Advantage Real Return Fund (Forts.)								
Institutional GBP (Partially Hedged) Class:									
Ausschüttende Anteile	£	8.628	£	9.507	£	12.026			
ausgegebene und umlaufende Anteile		934		986		1.242			
NIW je Anteil	£	9,24	£	9,64	£	9,69			
Class E:									
Thesaurierende Anteile	\$	2.935	\$	3.334	\$	2.723			
ausgegebene und umlaufende Anteile		360		390		348			
NIW je Anteil	\$	8,16	\$	8,56	\$	7,82			
Class E EUR (Partially Hedged):									
Thesaurierende Anteile	€	28.808	€	33.430	€	57.211			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.209		3.606		6.141			
NIW je Anteil	€	8,98	€	9,27	€	9,32			
Class G Institutional EUR (Partially Hedged):									
Ausschüttende Anteile	€	100	€	103	€	34			
ausgegebene und umlaufende Anteile		11		11		3			
NIW je Anteil	€	9,36	€	9,62	€	10,18			
Class Z:									
Ausschüttende Anteile	\$	11.032	\$	11.487	\$	10.325			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.453		1.424		1.373			
NIW je Anteil	\$	7,59	\$	8,06	\$	7,52			
	Global Bond ESG Fund								
Nettovermögen	\$	440.962	\$	286.096	k. A.				
Institutional Class:									
Thesaurierende Anteile	\$	10.541	\$	9.399	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.015		906	k. A.				
NIW je Anteil	\$	10,38	\$	10,38	k. A.				
Institutional CHF (Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	CHF	1.512	CHF	1.468	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		151		145	k. A.				
NIW je Anteil	CHF	10,00	CHF	10,15	k. A.				
Institutional EUR (Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	€	63.649	€	63.404	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.323		6.220	k. A.				
NIW je Anteil	€	10,07	€	10,19	k. A.				
Ausschüttende Anteile	€	60.093	€	20.104	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.076		1.994	k. A.				
NIW je Anteil	€	9,89	€	10,08	k. A.				
Institutional GBP (Hedged) Class:									
Ausschüttende Anteile	£	695	£	379	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		69		37	k. A.				
NIW je Anteil	£	10,02	£	10,16	k. A.				
Institutional NOK (Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	NOK	1.898.477	NOK	1.066.960	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		185.054		103.421	k. A.				
NIW je Anteil	NOK	10,26	NOK	10,32	k. A.				
Institutional NZD (Hedged) Class:									
Ausschüttende Anteile	NZD	41.264	NZD	35.196	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.045		3.432	k. A.				
NIW je Anteil	NZD	10,20	NZD	10,26	k. A.				
Class E:									
Ausschüttende Anteile	\$	23	\$	16	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		2		2	k. A.				
NIW je Anteil	\$	10,21	\$	10,28	k. A.				
Class E EUR (Hedged):									
Thesaurierende Anteile	€	13.907	€	14.231	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.397		1.405	k. A.				
NIW je Anteil	€	9,96	€	10,13	k. A.				

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016	
<b>Global Bond ESG Fund (Forts.)</b>				
Class Z AUD (Hedged):				
Ausschüttende Anteile	AUD 8.630	AUD 2.325		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	841	225		k. A.
NIW je Anteil	AUD 10,26	AUD 10,33		k. A.
<b>Global Bond Fund</b>				
Nettovermögen	\$ 10.588.646	\$ 10.419.008	\$ 8.532.444	
Institutional Class:				
Thesaurierende Anteile	\$ 2.716.440	\$ 2.640.065	\$ 2.245.984	
ausgegebene und umlaufende Anteile	88.079	85.867	76.375	
NIW je Anteil	\$ 30,84	\$ 30,75	\$ 29,41	
Ausschüttende Anteile	\$ 97.388	\$ 107.382	\$ 43.450	
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.279	5.786	2.409	
NIW je Anteil	\$ 18,45	\$ 18,56	\$ 18,04	
Institutional CHF (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	CHF 319.808	CHF 287.857	CHF 236.673	
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.865	8.776	7.366	
NIW je Anteil	CHF 32,42	CHF 32,80	CHF 32,13	
Ausschüttende Anteile	CHF 120.313	CHF 127.473	CHF 223.805	
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.876	6.097	10.755	
NIW je Anteil	CHF 20,48	CHF 20,91	CHF 20,81	
Institutional EUR (Currency Exposure) Class:				
Thesaurierende Anteile	€ 59.992	€ 40.958	€ 45.127	
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.830	3.352	3.534	
NIW je Anteil	€ 12,42	€ 12,22	€ 12,77	
Institutional EUR (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	€ 1.833.071	€ 1.445.088	€ 724.822	
ausgegebene und umlaufende Anteile	68.334	53.338	27.439	
NIW je Anteil	€ 26,83	€ 27,09	€ 26,42	
Ausschüttende Anteile	€ 364.774	€ 344.516	€ 342.350	
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.890	18.432	18.486	
NIW je Anteil	€ 18,34	€ 18,69	€ 18,52	
Income II Shares	€ 411	€ 30.947		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	42	3.105		k. A.
NIW je Anteil	€ 9,75	€ 9,97		k. A.
Institutional GBP (Currency Exposure) Class:				
Thesaurierende Anteile	£ 3.789			k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	369			k. A.
NIW je Anteil	£ 10,28			k. A.
Institutional GBP (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	£ 109.623	£ 56.406	£ 168.589	
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.218	2.672	8.254	
NIW je Anteil	£ 21,01	£ 21,11	£ 20,43	
Ausschüttende Anteile	£ 397.129	£ 537.676	£ 347.936	
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.464	39.338	25.901	
NIW je Anteil	£ 13,48	£ 13,67	£ 13,44	
Institutional ILS (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	ILS 1.131	ILS 916	ILS 1.847	
ausgegebene und umlaufende Anteile	75	60	125	
NIW je Anteil	ILS 15,16	ILS 15,25	ILS 14,77	
<b>Global Bond Fund (Forts.)</b>				
Institutional NOK (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	NOK 5.011.354	NOK 4.619.407	NOK 2.742.319	
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.212	22.248	13.716	
NIW je Anteil	NOK 206,98	NOK 207,63	NOK 199,96	
Institutional NZD (Hedged) Class:				
Ausschüttende Anteile	NZD 114.793	NZD 111.226	NZD 549.444	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.647	2.552	13.079	
NIW je Anteil	NZD 43,37	NZD 43,58	NZD 42,01	
Institutional SEK (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	SEK 812.866	SEK 1.213.289	SEK 970.650	
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.949	5.835	4.781	
NIW je Anteil	SEK 205,83	SEK 207,94	SEK 203,03	
Institutional SGD (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	SGD 71.359	SGD 74.426	SGD 101.052	
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.216	4.393	6.222	
NIW je Anteil	SGD 16,92	SGD 16,94	SGD 16,24	
Institutional USD (Currency Exposure) Class:				
Thesaurierende Anteile	\$ 305.019	\$ 361.581	\$ 362.949	
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.952	11.661	12.755	
NIW je Anteil	\$ 30,65	\$ 31,01	\$ 28,46	
Ausschüttende Anteile	\$ 25.207	\$ 9.181	\$ 8.673	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.191	425	430	
NIW je Anteil	\$ 21,17	\$ 21,61	\$ 20,15	
Investor Class:				
Thesaurierende Anteile	\$ 408.158	\$ 332.626	\$ 266.559	
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.151	11.547	9.641	
NIW je Anteil	\$ 28,84	\$ 28,80	\$ 27,65	
Ausschüttende Anteile	\$ 24.983	\$ 30.677	\$ 23.501	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.612	1.968	1.551	
NIW je Anteil	\$ 15,50	\$ 15,59	\$ 15,16	
Investor CHF (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	CHF 277.559	CHF 277.561	CHF 268.555	
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.907	21.615	21.276	
NIW je Anteil	CHF 12,67	CHF 12,84	CHF 12,62	
Investor EUR (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	€ 45.491	€ 50.537	€ 119.425	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.778	1.953	4.716	
NIW je Anteil	€ 25,58	€ 25,88	€ 25,33	
Investor GBP (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	£ 5.323	£ 4.225	£ 24.454	
ausgegebene und umlaufende Anteile	265	209	1.247	
NIW je Anteil	£ 20,08	£ 20,21	£ 19,61	
Investor NOK (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	NOK 52.912	NOK 62.933	NOK 70.555	
ausgegebene und umlaufende Anteile	267	316	366	
NIW je Anteil	NOK 198,42	NOK 199,39	NOK 192,69	

	Zum 30. Jun. 2018			Zum 31. Dez. 2017			Zum 31. Dez. 2016		
	Global Bond Fund (Forts.)								
Investor USD (Currency Exposure) Class:									
Thesaurierende Anteile	\$	6.850	\$	6.791	\$	7.920			
ausgegebene und umlaufende Anteile		234		229		290			
NIW je Anteil	\$	29,25	\$	29,65	\$	27,30			
Administrative Class:									
Thesaurierende Anteile	\$	16.019	\$	18.633	\$	29.127			
ausgegebene und umlaufende Anteile		567		660		1.074			
NIW je Anteil	\$	28,24	\$	28,23	\$	27,13			
Administrative EUR (Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	€	100	€	10	€	10			
ausgegebene und umlaufende Anteile		10		1		1			
NIW je Anteil	€	10,18	€	10,31	€	10,11			
Administrative GBP (Hedged) Class:									
Ausschüttende Anteile	£	393	£	1.047	£	1.145			
ausgegebene und umlaufende Anteile		26		69		76			
NIW je Anteil	£	15,03	£	15,23	£	14,97			
Class E:									
Thesaurierende Anteile	\$	239.112	\$	240.402	\$	247.034			
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.671		8.706		9.269			
NIW je Anteil	\$	27,58	\$	27,61	\$	26,65			
Ausschüttende Anteile	\$	302.661	\$	326.585	\$	254.897			
ausgegebene und umlaufende Anteile		22.716		24.366		19.565			
NIW je Anteil	\$	13,32	\$	13,40	\$	13,03			
Class E CHF (Hedged):									
Thesaurierende Anteile	CHF	29		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	CHF	10,05		k. A.		k. A.			
Class E EUR (Hedged):									
Thesaurierende Anteile	€	674.344	€	585.296	€	511.005			
ausgegebene und umlaufende Anteile		28.105		24.046		21.334			
NIW je Anteil	€	23,99	€	24,34	€	23,95			
Ausschüttende Anteile	€	22.064	€	22.152	€	12.824			
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.193		2.160		1.261			
NIW je Anteil	€	10,06	€	10,26	€	10,17			
Class E GBP (Hedged):									
Ausschüttende Anteile	£	2.390	£	3.018	£	3.082			
ausgegebene und umlaufende Anteile		175		218		227			
NIW je Anteil	£	13,65	£	13,84	£	13,60			
Class E USD (Currency Exposure):									
Thesaurierende Anteile	\$	19.776	\$	88.569	\$	72.373			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.551		6.834		6.031			
NIW je Anteil	\$	12,75	\$	12,96	\$	12,00			
Ausschüttende Anteile	\$	9.558	\$	10.608	\$	11.405			
ausgegebene und umlaufende Anteile		844		918		1.058			
NIW je Anteil	\$	11,32	\$	11,56	\$	10,78			
Class G Institutional:									
Thesaurierende Anteile	\$	84.643	\$	85.413	\$	58.552			
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.785		7.880		5.647			
NIW je Anteil	\$	10,87	\$	10,84	\$	10,37			
Class G Institutional EUR (Hedged):									
Ausschüttende Anteile	€	2.176	€	1.693	€	54			
ausgegebene und umlaufende Anteile		217		167		5			
NIW je Anteil	€	10,05	€	10,15	€	10,19			
Class G Retail EUR (Hedged):									
Ausschüttende Anteile	€	204.041	€	238.238	€	383.940			
ausgegebene und umlaufende Anteile		20.032		23.056		36.939			
NIW je Anteil	€	10,19	€	10,33	€	10,39			
Class H Institutional:									
Thesaurierende Anteile	\$	303.606	\$	426.531	\$	326.070			
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.104		14.224		11.349			
NIW je Anteil	\$	30,05	\$	29,99	\$	28,73			

	Zum 30. Jun. 2018			Zum 31. Dez. 2017			Zum 31. Dez. 2016		
	Global Bond Fund (Forts.)								
Ausschüttende Anteile	\$	11	\$	11	\$	10			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1			
NIW je Anteil	\$	10,52	\$	10,58	\$	10,23			
Class M Retail:									
Income II Shares	\$	949	\$	911		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		95		90		k. A.			
NIW je Anteil	\$	9,98	\$	10,12		k. A.			
Class M Retail HKD (Unhedged):									
Income II Shares	HKD	4.601	HKD	2.138		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		457		210		k. A.			
NIW je Anteil	HKD	10,06	HKD	10,16		k. A.			
Class R:									
Thesaurierende Anteile	\$	1.096	\$	1.758	\$	1.046			
ausgegebene und umlaufende Anteile		91		147		91			
NIW je Anteil	\$	11,99	\$	11,97	\$	11,48			
Class R EUR (Hedged):									
Thesaurierende Anteile	€	739	€	1.815	€	815			
ausgegebene und umlaufende Anteile		65		158		73			
NIW je Anteil	€	11,36	€	11,49	€	11,24			
Class R GBP (Hedged):									
Ausschüttende Anteile	£	1.659	£	1.577	£	3.367			
ausgegebene und umlaufende Anteile		157		147		319			
NIW je Anteil	£	10,60	£	10,75	£	10,56			
Class R USD (Currency Exposure):									
Thesaurierende Anteile	\$	628	\$	486	\$	448			
ausgegebene und umlaufende Anteile		60		46		46			
NIW je Anteil	\$	10,51	\$	10,65	\$	9,80			
Class T:									
Thesaurierende Anteile	\$	10.563	\$	9.096	\$	12.890			
ausgegebene und umlaufende Anteile		967		830		1.216			
NIW je Anteil	\$	10,92	\$	10,95	\$	10,60			
Ausschüttende Anteile	\$	3.037	\$	3.913	\$	6.600			
ausgegebene und umlaufende Anteile		286		366		636			
NIW je Anteil	\$	10,62	\$	10,68	\$	10,38			
Class T EUR (Hedged):									
Thesaurierende Anteile	€	13.246	€	15.059	€	12.391			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.270		1.421		1.184			
NIW je Anteil	€	10,43	€	10,60	€	10,46			
Nettvermögen	\$	997.535	\$	931.240	\$	800.872			
Institutional Class:									
Thesaurierende Anteile	\$	614.468	\$	595.172	\$	565.852			
ausgegebene und umlaufende Anteile		27.948		27.575		27.143			
NIW je Anteil	\$	21,99	\$	21,58	\$	20,85			
Ausschüttende Anteile	\$	54.759	\$	62.737	\$	61.378			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.446		3.989		3.989			
NIW je Anteil	\$	15,89	\$	15,73	\$	15,39			
Institutional EUR (Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	€	62.861	€	35.083	€	28.110			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.670		2.060		1.676			
NIW je Anteil	€	17,13	€	17,03	€	16,77			
Investor Class:									
Thesaurierende Anteile	\$	9.558	\$	7.914	\$	7.360			
ausgegebene und umlaufende Anteile		454		382		367			
NIW je Anteil	\$	21,05	\$	20,70	\$	20,07			
Administrative Class:									
Thesaurierende Anteile	\$	10.636	\$	8.824	\$	9.334			
ausgegebene und umlaufende Anteile		518		437		476			
NIW je Anteil	\$	20,52	\$	20,19	\$	19,61			

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Global Bond Ex-US Fund (Forts.)</b>			
Class E:			
Ausschüttende Anteile	\$ 165.288	\$ 144.819	\$ 91.757
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.711	9.481	6.140
NIW je Anteil	\$ 15,43	\$ 15,27	\$ 14,94
Class E USD (Currency Exposure):			
Ausschüttende Anteile	\$ 69.434	\$ 69.645	\$ 35.542
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.008	6.915	3.885
NIW je Anteil	\$ 9,91	\$ 10,07	\$ 9,15
<b>Global High Yield Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 4.028.622	\$ 5.349.958	\$ 4.893.852
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 783.530	\$ 855.877	\$ 1.002.528
ausgegebene und umlaufende Anteile	33.366	36.113	45.386
NIW je Anteil	\$ 23,48	\$ 23,70	\$ 22,10
Ausschüttende Anteile	\$ 201.362	\$ 141.646	\$ 165.980
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.575	12.620	15.100
NIW je Anteil	\$ 10,84	\$ 11,22	\$ 11,00
Institutional AUD (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	k. A.	k. A.	AUD 53.206
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	4.952
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	AUD 10,75
Institutional CHF (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	CHF 28.068	CHF 30.053	CHF 33.614
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.743	1.823	2.138
NIW je Anteil	CHF 16,10	CHF 16,49	CHF 15,73
Ausschüttende Anteile	CHF 16.794	CHF 17.642	CHF 22.616
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.821	1.820	2.329
NIW je Anteil	CHF 9,22	CHF 9,69	CHF 9,71
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 731.159	€ 996.069	€ 1.101.128
ausgegebene und umlaufende Anteile	33.006	43.987	51.171
NIW je Anteil	€ 22,15	€ 22,64	€ 21,53
Ausschüttende Anteile	€ 215.950	€ 245.176	€ 126.014
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.047	19.529	10.059
NIW je Anteil	€ 11,97	€ 12,55	€ 12,53
Institutional GBP (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 15.373	£ 44.613	£ 78.645
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.087	3.099	5.795
NIW je Anteil	£ 14,15	£ 14,40	£ 13,57
Ausschüttende Anteile	£ 555.329	£ 974.163	£ 805.893
ausgegebene und umlaufende Anteile	95.370	160.275	133.938
NIW je Anteil	£ 5,82	£ 6,08	£ 6,02
Investor Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 15.806	\$ 8.285	\$ 5.231
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.410	731	493
NIW je Anteil	\$ 11,21	\$ 11,34	\$ 10,61
Investor EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 11.302	€ 12.043	€ 6.604
ausgegebene und umlaufende Anteile	524	545	313
NIW je Anteil	€ 21,58	€ 22,10	€ 21,08
Administrative Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 61.928	\$ 69.503	\$ 88.403
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.770	3.072	4.172
NIW je Anteil	\$ 22,36	\$ 22,62	\$ 21,20
Ausschüttende Anteile	\$ 21.549	\$ 32.430	\$ 16.654
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.032	2.954	1.549
NIW je Anteil	\$ 10,60	\$ 10,98	\$ 10,76

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Global High Yield Bond Fund (Forts.)</b>			
Administrative EUR (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	€ 1.669	€ 3.338	€ 4.146
ausgegebene und umlaufende Anteile	168	320	399
NIW je Anteil	€ 9,94	€ 10,42	€ 10,41
Administrative GBP (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	£ 2.992	£ 3.022	£ 2.732
ausgegebene und umlaufende Anteile	286	277	253
NIW je Anteil	£ 10,45	£ 10,90	£ 10,80
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 203.349	\$ 251.279	\$ 232.323
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.626	11.734	11.535
NIW je Anteil	\$ 21,12	\$ 21,41	\$ 20,15
Ausschüttende Anteile	\$ 248.835	\$ 256.114	\$ 238.260
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.330	23.185	22.022
NIW je Anteil	\$ 10,67	\$ 11,05	\$ 10,82
Class E EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 260.718	€ 337.097	€ 281.873
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.646	14.665	12.790
NIW je Anteil	€ 22,39	€ 22,99	€ 22,04
Ausschüttende Anteile	€ 43.486	€ 59.070	€ 31.726
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.446	5.756	3.098
NIW je Anteil	€ 9,78	€ 10,26	€ 10,24
Class E GBP (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	£ 11.357	£ 11.414	£ 2.960
ausgegebene und umlaufende Anteile	927	893	234
NIW je Anteil	£ 12,25	£ 12,79	£ 12,66
Class E SGD (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	SGD 2.078	SGD 2.353	SGD 612
ausgegebene und umlaufende Anteile	204	223	59
NIW je Anteil	SGD 10,17	SGD 10,57	SGD 10,38
Class G Institutional EUR (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 2.040	€ 2.265	€ 1.383
ausgegebene und umlaufende Anteile	208	225	131
NIW je Anteil	€ 9,83	€ 10,05	€ 10,59
Class G Retail EUR (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 5.484	€ 5.993	€ 7.314
ausgegebene und umlaufende Anteile	561	597	697
NIW je Anteil	€ 9,78	€ 10,04	€ 10,49
Class H Institutional:			
Thesaurierende Anteile	\$ 56.572	\$ 149.750	\$ 193.898
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.489	6.522	9.045
NIW je Anteil	\$ 22,73	\$ 22,96	\$ 21,44
Ausschüttende Anteile	\$ 11.482	\$ 14.814	\$ 14.261
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.194	1.488	1.463
NIW je Anteil	\$ 9,61	\$ 9,95	\$ 9,75
Class M Retail:			
Ausschüttende Anteile	\$ 43.618	\$ 50.236	\$ 41.068
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.145	4.611	3.849
NIW je Anteil	\$ 10,52	\$ 10,89	\$ 10,67
Income II Shares	\$ 48.336	\$ 46.123	\$ 27.313
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.324	4.871	2.902
NIW je Anteil	\$ 9,08	\$ 9,47	\$ 9,41

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Global High Yield Bond Fund (Forts.)</b>			
<b>Class R:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 11.140	\$ 12.543	\$ 11.624
ausgegebene und umlaufende Anteile	854	951	944
NIW je Anteil	\$ 13,05	\$ 13,19	\$ 12,32
<b>Class R GBP (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	£ 2.963	£ 1.600	£ 2.562
ausgegebene und umlaufende Anteile	308	159	258
NIW je Anteil	£ 9,62	£ 10,04	£ 9,95
<b>Class T:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 7.195	\$ 7.806	\$ 8.362
ausgegebene und umlaufende Anteile	628	671	761
NIW je Anteil	\$ 11,45	\$ 11,63	\$ 10,99
Ausschüttende Anteile	\$ 3.944	\$ 5.597	\$ 4.877
ausgegebene und umlaufende Anteile	397	544	484
NIW je Anteil	\$ 9,94	\$ 10,29	\$ 10,08
<b>Class T EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 1.751	€ 2.347	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	172	224	1
NIW je Anteil	€ 10,20	€ 10,49	€ 10,08
<b>Global Investment Grade Credit Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 18.989.710	\$ 20.741.806	\$ 15.577.640
<b>Institutional Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 3.639.459	\$ 3.775.065	\$ 3.174.114
ausgegebene und umlaufende Anteile	195.719	199.759	178.971
NIW je Anteil	\$ 18,60	\$ 18,90	\$ 17,74
Ausschüttende Anteile	\$ 669.050	\$ 770.142	\$ 661.450
ausgegebene und umlaufende Anteile	54.308	60.469	53.562
NIW je Anteil	\$ 12,32	\$ 12,74	\$ 12,35
<b>Institutional USD (Currency Exposure) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 84.196	\$ 231.850	\$ 47.662
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.878	15.706	3.558
NIW je Anteil	\$ 14,32	\$ 14,76	\$ 13,40
Ausschüttende Anteile	\$ 26.409	\$ 56.258	\$ 17.817
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.745	5.575	1.884
NIW je Anteil	\$ 9,62	\$ 10,09	\$ 9,46
<b>Institutional CHF (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	CHF 971.932	CHF 904.368	CHF 715.428
ausgegebene und umlaufende Anteile	58.925	53.159	43.743
NIW je Anteil	CHF 16,49	CHF 17,01	CHF 16,36
Ausschüttende Anteile	CHF 69.610	CHF 73.272	CHF 61.647
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.588	7.612	6.449
NIW je Anteil	CHF 9,17	CHF 9,63	CHF 9,56
<b>Institutional CZK (Hedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	CZK 1.927.576	CZK 1.814.287	CZK 1.494.778
ausgegebene und umlaufende Anteile	206.749	186.002	152.861
NIW je Anteil	CZK 9,32	CZK 9,75	CZK 9,78
<b>Institutional EUR (Currency Exposure) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 15.490	€ 16.693	€ 13.934
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.263	1.358	1.097
NIW je Anteil	€ 12,26	€ 12,29	€ 12,70

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)</b>			
<b>Institutional EUR (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 2.990.307	€ 3.241.293	€ 2.857.038
ausgegebene und umlaufende Anteile	162.211	170.740	157.238
NIW je Anteil	€ 18,43	€ 18,98	€ 18,18
Ausschüttende Anteile	€ 797.663	€ 819.850	€ 676.903
ausgegebene und umlaufende Anteile	67.079	65.803	54.968
NIW je Anteil	€ 11,89	€ 12,46	€ 12,32
<b>Institutional GBP (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	£ 688.901	£ 846.149	£ 603.180
ausgegebene und umlaufende Anteile	35.047	42.012	31.546
NIW je Anteil	£ 19,66	£ 20,14	£ 19,13
Ausschüttende Anteile	£ 2.521.355	£ 2.972.701	£ 2.015.808
ausgegebene und umlaufende Anteile	188.516	213.210	147.459
NIW je Anteil	£ 13,37	£ 13,94	£ 13,67
<b>Institutional HUF (Hedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	HUF 5.175.699	HUF 3.410.424	HUF 3.244.633
ausgegebene und umlaufende Anteile	545.672	343.216	331.797
NIW je Anteil	HUF 9,49	HUF 9,94	HUF 9,78
<b>Institutional ILS (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	ILS 288.364	ILS 293.653	ILS 202.099
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.157	19.023	13.772
NIW je Anteil	ILS 15,05	ILS 15,44	ILS 14,68
<b>Institutional NOK (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	NOK 917.852	NOK 1.171.267	NOK 1.732.887
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.576	8.205	12.843
NIW je Anteil	NOK 139,58	NOK 142,76	NOK 134,97
<b>Institutional PLN (Hedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	PLN 17.343	PLN 16.084	PLN 46.800
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.704	1.519	4.564
NIW je Anteil	PLN 10,18	PLN 10,59	PLN 10,26
<b>Institutional SEK (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	SEK 3.231.009	SEK 1.199.605	SEK 103.509
ausgegebene und umlaufende Anteile	207.817	74.896	6.741
NIW je Anteil	SEK 15,55	SEK 16,02	SEK 15,36
<b>Institutional SGD (Hedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	SGD 1.213	SGD 1.277	SGD 517
ausgegebene und umlaufende Anteile	119	120	50
NIW je Anteil	SGD 10,23	SGD 10,62	SGD 10,32
<b>Investor Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 1.033.051	\$ 579.333	\$ 431.271
ausgegebene und umlaufende Anteile	50.191	27.648	21.855
NIW je Anteil	\$ 20,58	\$ 20,95	\$ 19,74
Ausschüttende Anteile	\$ 94.400	\$ 123.268	\$ 118.410
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.204	9.099	9.014
NIW je Anteil	\$ 13,10	\$ 13,55	\$ 13,14

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)</b>			
Investor AUD (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	AUD 330	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	33	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD 10,00	k. A.	k. A.
Investor CAD (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	CAD 330	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	33	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CAD 10,00	k. A.	k. A.
Investor CHF (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	CHF 12.635	CHF 12.618	CHF 9.950
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.029	995	813
NIW je Anteil	CHF 12,27	CHF 12,68	CHF 12,24
Ausschüttende Anteile	CHF 13.471	CHF 12.751	CHF 13.045
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.140	1.029	1.060
NIW je Anteil	CHF 11,81	CHF 12,40	CHF 12,31
Investor EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 32.713	€ 45.946	€ 48.057
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.852	2.522	2.746
NIW je Anteil	€ 17,66	€ 18,22	€ 17,50
Ausschüttende Anteile	€ 16.881	€ 86.852	€ 135.685
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.354	6.649	10.509
NIW je Anteil	€ 12,47	€ 13,06	€ 12,92
Investor GBP (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	£ 6.762	£ 9.068	£ 9.837
ausgegebene und umlaufende Anteile	521	670	742
NIW je Anteil	£ 12,98	£ 13,53	£ 13,26
Investor CNH (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	CNH 1.602	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	16	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CNH 100,11	k. A.	k. A.
Investor SGD (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	SGD 14	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,01	k. A.	k. A.
Administrative Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 110.293	\$ 114.487	\$ 109.661
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.215	6.332	6.431
NIW je Anteil	\$ 17,75	\$ 18,08	\$ 17,06
Ausschüttende Anteile	\$ 70.919	\$ 113.783	\$ 133.586
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.598	8.688	10.520
NIW je Anteil	\$ 12,67	\$ 13,10	\$ 12,70
Administrative CHF (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	CHF 1.682	CHF 1.645	CHF 2.791
ausgegebene und umlaufende Anteile	155	146	257
NIW je Anteil	CHF 10,87	CHF 11,24	CHF 10,87
Administrative EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 32.089	€ 21.854	€ 16.411
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.912	1.261	985
NIW je Anteil	€ 16,79	€ 17,33	€ 16,67
Ausschüttende Anteile	€ 6.796	€ 5.476	€ 3.198
ausgegebene und umlaufende Anteile	565	434	257
NIW je Anteil	€ 12,03	€ 12,61	€ 12,46
Administrative GBP (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	£ 15.365	£ 16.506	£ 17.497
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.190	1.227	1.326
NIW je Anteil	£ 12,91	£ 13,46	£ 13,20
Administrative HKD (Unhedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	HKD 14.418	HKD 80.536	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.478	8.016	k. A.
NIW je Anteil	HKD 9,75	HKD 10,05	k. A.

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)</b>			
Administrative SEK (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	SEK 715.096	SEK 546.204	SEK 359.459
ausgegebene und umlaufende Anteile	63.592	47.023	32.127
NIW je Anteil	SEK 11,25	SEK 11,62	SEK 11,19
Administrative SGD (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	SGD 13.410	SGD 13.922	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.394	1.394	k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,62	SGD 9,99	k. A.
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 592.206	\$ 702.174	\$ 694.392
ausgegebene und umlaufende Anteile	34.680	40.279	42.065
NIW je Anteil	\$ 17,08	\$ 17,43	\$ 16,51
Ausschüttende Anteile	\$ 551.179	\$ 650.164	\$ 487.756
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.230	47.052	36.396
NIW je Anteil	\$ 13,37	\$ 13,82	\$ 13,40
Class E CHF (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	CHF 139.990	CHF 125.012	CHF 26.920
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.245	10.555	2.342
NIW je Anteil	CHF 11,43	CHF 11,84	CHF 11,49
Class E EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 508.530	€ 581.919	€ 522.646
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.807	34.083	31.700
NIW je Anteil	€ 16,51	€ 17,07	€ 16,49
Ausschüttende Anteile	€ 268.405	€ 302.293	€ 290.320
ausgegebene und umlaufende Anteile	26.174	28.137	27.335
NIW je Anteil	€ 10,25	€ 10,74	€ 10,62
Class E GBP (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	£ 35.195	£ 39.802	£ 46.240
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.612	2.833	3.357
NIW je Anteil	£ 13,48	£ 14,05	£ 13,78
Class E SGD (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	SGD 37.841	SGD 47.386	SGD 67.818
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.696	4.458	6.564
NIW je Anteil	SGD 10,24	SGD 10,63	SGD 10,33
Class G Institutional:			
Thesaurierende Anteile	k. A.	k. A.	\$ 26.726
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	2.555
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,46
Class G Institutional EUR (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	€ 769	€ 130	€ 33
ausgegebene und umlaufende Anteile	78	13	3
NIW je Anteil	€ 9,91	€ 10,21	€ 10,23
Class G Retail EUR (Currency Exposure):			
Ausschüttende Anteile	€ 6.086	€ 6.218	€ 7.118
ausgegebene und umlaufende Anteile	564	572	595
NIW je Anteil	€ 10,80	€ 10,87	€ 11,96
Class H Institutional:			
Thesaurierende Anteile	\$ 118.286	\$ 124.072	\$ 87.510
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.067	6.257	4.694
NIW je Anteil	\$ 19,50	\$ 19,83	\$ 18,65
Ausschüttende Anteile	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,98	k. A.	k. A.
Class M Retail:			
Ausschüttende Anteile	\$ 34.714	\$ 44.752	\$ 69.547
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.431	4.278	6.857
NIW je Anteil	\$ 10,12	\$ 10,46	\$ 10,15
Income II Shares	\$ 88.273	\$ 156.169	\$ 61.179
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.064	15.402	6.137
NIW je Anteil	\$ 9,74	\$ 10,14	\$ 9,97

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)</b>			
Class M Retail HKD (Unhedged):			
Ausschüttende Anteile	HKD 136.279	HKD 250.769	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.971	24.955	k. A.
NIW je Anteil	HKD 9,75	HKD 10,05	k. A.
Class R:			
Thesaurierende Anteile	\$ 15.887	\$ 17.490	\$ 12.923
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.330	1.439	1.130
NIW je Anteil	\$ 11,95	\$ 12,16	\$ 11,44
Ausschüttende Anteile	\$ 5.181	\$ 5.919	\$ 6.741
ausgegebene und umlaufende Anteile	517	571	670
NIW je Anteil	\$ 10,03	\$ 10,37	\$ 10,06
Class R EUR (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 14.595	€ 17.841	€ 1.046
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.525	1.779	105
NIW je Anteil	€ 9,57	€ 10,03	€ 9,92
Class R GBP (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	£ 15.145	£ 15.778	£ 15.631
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.539	1.538	1.555
NIW je Anteil	£ 9,84	£ 10,26	£ 10,06
Class T:			
Thesaurierende Anteile	\$ 19.295	\$ 19.305	\$ 11.714
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.775	1.736	1.108
NIW je Anteil	\$ 10,87	\$ 11,12	\$ 10,57
Class T EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 7.163	€ 7.885	€ 6.552
ausgegebene und umlaufende Anteile	690	733	628
NIW je Anteil	€ 10,38	€ 10,75	€ 10,43
<b>Global Libor Plus Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 667.860	\$ 540.876	\$ 12.914
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 2.345	\$ 9.007	\$ 12.060
ausgegebene und umlaufende Anteile	218	839	1.159
NIW je Anteil	\$ 10,75	\$ 10,73	\$ 10,40
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 6.414	€ 103.774	€ 266
ausgegebene und umlaufende Anteile	624	9.992	26
NIW je Anteil	€ 10,27	€ 10,39	€ 10,27
Ausschüttende Anteile	€ 19.958	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.017	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,90	k. A.	k. A.
Institutional GBP (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 478.251	£ 301.051	£ 464
ausgegebene und umlaufende Anteile	45.514	28.480	45
NIW je Anteil	£ 10,51	£ 10,57	£ 10,36
Investor Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 760	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	76	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,00	k. A.	k. A.
Investor EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 460	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	47	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,90	k. A.	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 1.719	€ 8	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	175	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,80	€ 9,94	k. A.
Class G Institutional EUR (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,97	k. A.	k. A.

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Global Low Duration Real Return Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 1.557.184	\$ 2.197.467	\$ 1.116.635
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 205.143	\$ 583.308	\$ 320.472
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.746	56.437	31.522
NIW je Anteil	\$ 10,39	\$ 10,34	\$ 10,17
Ausschüttende Anteile	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,95	k. A.	k. A.
Institutional CHF (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	CHF 21.903	CHF 36.099	CHF 15.055
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.269	3.705	1.534
NIW je Anteil	CHF 9,65	CHF 9,74	CHF 9,81
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 740.395	€ 944.381	€ 580.035
ausgegebene und umlaufende Anteile	75.060	95.008	58.200
NIW je Anteil	€ 9,86	€ 9,94	€ 9,97
Ausschüttende Anteile	€ 35.308	€ 36.025	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.661	3.664	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,64	€ 9,83	k. A.
Income II Shares	€ 12.221	€ 18.189	€ 26.845
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.303	1.897	2.747
NIW je Anteil	€ 9,38	€ 9,59	€ 9,77
Institutional GBP (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 24.128	£ 21.783	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.411	2.170	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,01	£ 10,04	k. A.
Ausschüttende Anteile	£ 137.594	£ 131.136	£ 22.361
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.106	13.252	2.246
NIW je Anteil	£ 9,75	£ 9,90	£ 9,96
Investor Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 6.069	\$ 5.826	\$ 85
ausgegebene und umlaufende Anteile	594	572	8
NIW je Anteil	\$ 10,22	\$ 10,18	\$ 10,05
Investor EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 9	€ 9	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	€ 9,85	€ 9,94	€ 10,01
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 43.711	\$ 42.361	\$ 41.269
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.376	4.244	4.164
NIW je Anteil	\$ 9,99	\$ 9,98	\$ 9,91
Class E EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 125.672	€ 102.385	€ 68.499
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.255	10.668	7.056
NIW je Anteil	€ 9,48	€ 9,60	€ 9,71
<b>Global Multi-Asset Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 1.026.920	\$ 1.066.739	\$ 1.106.633
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 353.261	\$ 350.129	\$ 414.710
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.873	20.515	27.746
NIW je Anteil	\$ 16,92	\$ 17,07	\$ 14,95
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 168.264	€ 182.482	€ 241.117
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.401	11.131	16.161
NIW je Anteil	€ 16,18	€ 16,39	€ 14,92
Ausschüttende Anteile	€ 10.897	€ 9.450	€ 1.192
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.071	898	120
NIW je Anteil	€ 10,18	€ 10,52	€ 9,97

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016		Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
	<b>Global Multi-Asset Fund (Forts.)</b>				<b>Global Real Return Fund (Forts.)</b>		
Institutional GBP (Hedged) Class:				Ausschüttende Anteile	€ 79.772	€ 72.280	€ 87.473
Thesaurierende Anteile	£ 952	£ 5.772	£ 5.242	ausgegebene und umlaufende Anteile	5.339	4.735	5.752
ausgegebene und umlaufende Anteile	80	484	487	NIW je Anteil	€ 14,94	€ 15,26	€ 15,21
NIW je Anteil	£ 11,82	£ 11,92	£ 10,76	Income II Shares	k. A.	€ 9.535	€ 9.356
Ausschüttende Anteile	£ 5.039	£ 5.184	£ 5.122	ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	887	869
ausgegebene und umlaufende Anteile	474	474	499	NIW je Anteil	k. A.	€ 10,75	€ 10,77
NIW je Anteil	£ 10,63	£ 10,93	£ 10,27	Institutional GBP (Hedged) Class:			
Investor Class:				Thesaurierende Anteile	£ 5.867	£ 16.724	£ 62.210
Thesaurierende Anteile	\$ 13.444	\$ 13.192	\$ 7.200	ausgegebene und umlaufende Anteile	499	1.413	5.402
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.055	1.025	636	NIW je Anteil	£ 11,77	£ 11,84	£ 11,52
NIW je Anteil	\$ 12,75	\$ 12,87	\$ 11,31	Ausschüttende Anteile	£ 104.507	£ 69.912	£ 93.793
Class E:				ausgegebene und umlaufende Anteile	11.497	7.567	10.271
Thesaurierende Anteile	\$ 40.088	\$ 44.207	\$ 51.293	NIW je Anteil	£ 9,09	£ 9,24	£ 9,13
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.637	2.866	3.752	Institutional SEK (Hedged) Class:			
NIW je Anteil	\$ 15,20	\$ 15,42	\$ 13,67	Thesaurierende Anteile	SEK 2.137	SEK 2.161	k. A.
Ausschüttende Anteile	\$ 5.886	\$ 6.442	\$ 7.786	ausgegebene und umlaufende Anteile	21	21	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	605	639	837	NIW je Anteil	SEK 101,76	SEK 102,90	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,74	\$ 10,08	\$ 9,30	Institutional SGD (Hedged) Class:			
Class E EUR (Hedged):				Thesaurierende Anteile	SGD 126.381	SGD 126.652	SGD 224.293
Thesaurierende Anteile	€ 196.673	€ 189.616	€ 158.305	ausgegebene und umlaufende Anteile	8.290	8.290	15.221
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.542	12.807	11.608	NIW je Anteil	SGD 15,24	SGD 15,28	SGD 14,74
NIW je Anteil	€ 14,52	€ 14,81	€ 13,64	Institutional USD (Currency Exposure) Class:			
Ausschüttende Anteile	€ 14.479	€ 13.178	€ 12.21	Thesaurierende Anteile	\$ 89.541	\$ 91.263	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.532	1.341	1.296	ausgegebene und umlaufende Anteile	8.907	8.907	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,45	€ 9,83	€ 9,42	NIW je Anteil	\$ 10,05	\$ 10,25	k. A.
Class G Institutional EUR (Hedged):				Investor Class:			
Ausschüttende Anteile	€ 188	€ 161	€ 38	Thesaurierende Anteile	\$ 77.782	\$ 71.817	\$ 87.262
ausgegebene und umlaufende Anteile	18	15	4	ausgegebene und umlaufende Anteile	3.997	3.691	4.645
NIW je Anteil	€ 10,61	€ 10,75	€ 10,38	NIW je Anteil	\$ 19,46	\$ 19,46	\$ 18,79
Class G Retail EUR (Hedged):				Ausschüttende Anteile	\$ 4.237	\$ 4.409	\$ 7.825
Ausschüttende Anteile	€ 15.618	€ 17.718	€ 16.801	ausgegebene und umlaufende Anteile	293	303	549
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.583	1.762	1.716	NIW je Anteil	\$ 14,45	\$ 14,58	\$ 14,25
NIW je Anteil	€ 9,87	€ 10,06	€ 9,79	Investor CHF (Hedged) Class:			
Class Z:				Ausschüttende Anteile	CHF 4.135	CHF 4.641	CHF 5.898
Thesaurierende Anteile	\$ 132.167	\$ 142.493	\$ 159.642	ausgegebene und umlaufende Anteile	319	350	443
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.928	11.739	15.160	NIW je Anteil	CHF 12,97	CHF 13,27	CHF 13,31
NIW je Anteil	\$ 12,09	\$ 12,14	\$ 10,53	Investor EUR (Hedged) Class:			
Nettovermögen	<b>Global Real Return Fund</b>			Thesaurierende Anteile	€ 8.988	€ 17.445	€ 23.638
	\$ 2.228.399	\$ 2.197.667	\$ 2.424.998	ausgegebene und umlaufende Anteile	501	960	1.321
Institutional Class:				NIW je Anteil	€ 17,94	€ 18,17	€ 17,89
Thesaurierende Anteile	\$ 460.676	\$ 439.066	\$ 470.441	Ausschüttende Anteile	€ 5.354	€ 5.673	€ 5.462
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.473	21.455	23.895	ausgegebene und umlaufende Anteile	391	406	392
NIW je Anteil	\$ 20,50	\$ 20,46	\$ 19,69	NIW je Anteil	€ 13,69	€ 13,99	€ 13,94
Ausschüttende Anteile	\$ 28.912	\$ 23.391	\$ 28.654	Administrative Class:			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.751	1.405	1.760	Thesaurierende Anteile	\$ 85.173	\$ 97.761	\$ 98.950
NIW je Anteil	\$ 16,52	\$ 16,65	\$ 16,28	ausgegebene und umlaufende Anteile	4.445	5.099	5.337
Institutional CHF (Hedged) Class:				NIW je Anteil	\$ 19,16	\$ 19,17	\$ 18,54
Thesaurierende Anteile	CHF 55.370	CHF 69.968	CHF 237.812	Class E:			
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.969	4.952	17.048	Thesaurierende Anteile	\$ 137.175	\$ 137.691	\$ 175.501
NIW je Anteil	CHF 13,95	CHF 14,13	CHF 13,95	ausgegebene und umlaufende Anteile	7.490	7.498	9.846
Ausschüttende Anteile	CHF 46.740	CHF 47.905	CHF 30.477	NIW je Anteil	\$ 18,31	\$ 18,36	\$ 17,82
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.552	4.559	2.890	Ausschüttende Anteile	\$ 31.352	\$ 33.315	\$ 31.137
NIW je Anteil	CHF 10,27	CHF 10,51	CHF 10,54	ausgegebene und umlaufende Anteile	2.237	2.357	2.254
Institutional EUR (Hedged) Class:				NIW je Anteil	\$ 14,02	\$ 14,14	\$ 13,81
Thesaurierende Anteile	€ 440.349	€ 382.057	€ 452.557				
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.363	20.047	24.201				
NIW je Anteil	€ 18,85	€ 19,06	€ 18,70				

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Global Real Return Fund (Forts.)</b>			
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 218.217	€ 243.191	€ 226.202
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.943	14.203	13.344
NIW je Anteil	€ 16,86	€ 17,12	€ 16,95
<b>Class E GBP (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	£ 5.541	£ 6.484	£ 5.341
ausgegebene und umlaufende Anteile	410	472	393
NIW je Anteil	£ 13,51	£ 13,74	£ 13,57
<b>Class H Institutional:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 41.987	\$ 35.646	\$ 23.437
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.097	1.782	1.216
NIW je Anteil	\$ 20,02	\$ 20,00	\$ 19,27
<b>Class R:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 2.276	\$ 3.378	\$ 3.264
ausgegebene und umlaufende Anteile	200	297	297
NIW je Anteil	\$ 11,39	\$ 11,39	\$ 10,99
<b>Class R EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 4.025	€ 4.507	€ 4.498
ausgegebene und umlaufende Anteile	374	414	420
NIW je Anteil	€ 10,75	€ 10,89	€ 10,71
<b>Class R GBP (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	£ 17.747	£ 15.040	£ 10.650
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.582	1.331	966
NIW je Anteil	£ 11,22	£ 11,30	£ 11,02
Ausschüttende Anteile	£ 276	£ 336	£ 470
ausgegebene und umlaufende Anteile	26	31	44
NIW je Anteil	£ 10,57	£ 10,75	£ 10,62
<b>Class T EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 324	€ 379	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	33	37	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,94	€ 10,11	k. A.
<b>Class Z AUD (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	AUD 11.723	AUD 12.451	AUD 9.539
ausgegebene und umlaufende Anteile	986	1.038	818
NIW je Anteil	AUD 11,88	AUD 11,99	AUD 11,66
<b>Nettovermögen</b>	<b>\$ 65.600.561</b>	<b>\$ 72.274.750</b>	<b>\$ 21.220.021</b>
<b>Income Fund</b>			
<b>Institutional Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 8.337.041	\$ 11.258.242	\$ 3.206.279
ausgegebene und umlaufende Anteile	588.414	787.801	240.895
NIW je Anteil	\$ 14,17	\$ 14,29	\$ 13,31
Ausschüttende Anteile	\$ 2.759.888	\$ 2.974.371	\$ 930.234
ausgegebene und umlaufende Anteile	242.834	254.535	82.294
NIW je Anteil	\$ 11,37	\$ 11,69	\$ 11,31

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Income Fund (Forts.)</b>			
<b>Institutional AUD (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	AUD 50.761	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.122	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD 9,91	k. A.	k. A.
<b>Institutional BRL (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 1.396.058	\$ 2.525.671	\$ 61.379
ausgegebene und umlaufende Anteile	98.237	154.747	4.250
NIW je Anteil	\$ 14,21	\$ 16,32	\$ 14,45
<b>Institutional CAD (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	CAD 160.628	CAD 119.027	CAD 67.405
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.270	10.446	6.322
NIW je Anteil	CAD 11,26	CAD 11,39	CAD 10,66
<b>Institutional CHF (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	CHF 198.217	CHF 179.249	CHF 61.593
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.866	15.784	5.686
NIW je Anteil	CHF 11,09	CHF 11,36	CHF 10,83
Ausschüttende Anteile	CHF 127.252	CHF 109.789	CHF 54.157
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.171	10.879	5.408
NIW je Anteil	CHF 9,66	CHF 10,09	CHF 10,02
<b>Institutional EUR (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 9.943.479	€ 10.086.073	€ 2.495.854
ausgegebene und umlaufende Anteile	740.329	735.022	191.505
NIW je Anteil	€ 13,43	€ 13,72	€ 13,04
Ausschüttende Anteile	€ 1.283.204	€ 1.293.969	€ 337.443
ausgegebene und umlaufende Anteile	119.710	115.782	30.570
NIW je Anteil	€ 10,72	€ 11,18	€ 11,04
Income II Shares	€ 49.898	€ 219.517	€ 216.366
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.164	21.782	21.723
NIW je Anteil	€ 9,66	€ 10,08	€ 9,96
<b>Institutional GBP (Hedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	£ 350.463	£ 187.209	£ 62.156
ausgegebene und umlaufende Anteile	33.797	17.420	5.909
NIW je Anteil	£ 10,37	£ 10,75	£ 10,52
<b>Institutional HKD (Unhedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	HKD 2.866.194	HKD 2.402.771	HKD 4.111
ausgegebene und umlaufende Anteile	274.699	224.833	401
NIW je Anteil	HKD 10,43	HKD 10,69	HKD 10,26
<b>Institutional JPY (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	JPY 998.128	JPY 1.018.284	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.014	1.014	k. A.
NIW je Anteil	JPY 985,00	JPY 1005,00	k. A.
<b>Institutional NOK (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	NOK 1.149.042	NOK 1.083.441	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.250	10.452	k. A.
NIW je Anteil	NOK 102,14	NOK 103,66	k. A.
<b>Institutional SGD (Hedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	SGD 91.755	SGD 73.260	SGD 9.026
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.800	6.809	866
NIW je Anteil	SGD 10,43	SGD 10,76	SGD 10,43

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
	Income Fund (Forts.)		
<b>Investor Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 1.057.316	\$ 780.931	\$ 50.979
ausgegebene und umlaufende Anteile	90.383	66.070	4.615
NIW je Anteil	\$ 11,70	\$ 11,82	\$ 11,05
Ausschüttende Anteile	\$ 823.618	\$ 746.059	\$ 357.577
ausgegebene und umlaufende Anteile	80.538	70.811	34.940
NIW je Anteil	\$ 10,23	\$ 10,54	\$ 10,24
<b>Investor AUD (Hedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	AUD 14	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD 9,98	k. A.	k. A.
<b>Investor EUR (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 524.579	€ 736.891	€ 43.520
ausgegebene und umlaufende Anteile	48.447	66.492	4.121
NIW je Anteil	€ 10,83	€ 11,08	€ 10,56
Ausschüttende Anteile	€ 47.371	€ 55.004	€ 28.251
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.957	5.508	2.851
NIW je Anteil	€ 9,56	€ 9,99	€ 9,91
Ausschüttende A-Anteile	€ 51.694	€ 178.938	€ 172.407
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.144	17.396	16.891
NIW je Anteil	€ 10,05	€ 10,29	€ 10,21
<b>Investor CNH (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	CNH 66	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CNH 99,82	k. A.	k. A.
<b>Investor SGD (Hedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	SGD 14	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,98	k. A.	k. A.
<b>Administrative Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 347.125	\$ 417.133	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	33.268	39.537	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,43	\$ 10,55	k. A.
Ausschüttende Anteile	\$ 3.040.813	\$ 3.482.136	\$ 1.501.683
ausgegebene und umlaufende Anteile	275.944	306.418	135.794
NIW je Anteil	\$ 11,02	\$ 11,36	\$ 11,06
<b>Administrative AUD (Hedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	AUD 230.501	AUD 232.558	AUD 27.626
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.467	21.988	2.701
NIW je Anteil	AUD 10,26	AUD 10,58	AUD 10,23
<b>Administrative EUR (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 107.612	€ 61.906	€ 6.597
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.933	5.579	623
NIW je Anteil	€ 10,83	€ 11,09	€ 10,59
Ausschüttende Anteile	€ 531.946	€ 285.030	€ 15.596
ausgegebene und umlaufende Anteile	54.739	28.062	1.547
NIW je Anteil	€ 9,72	€ 10,16	€ 10,08
<b>Administrative GBP (Hedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	£ 127.335	£ 128.386	£ 18.148
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.041	12.646	1.816
NIW je Anteil	£ 9,76	£ 10,15	£ 10,00

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
	Income Fund (Forts.)		
<b>Administrative HKD (Unhedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	HKD 5.893.390	HKD 6.080.431	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	596.871	599.122	k. A.
NIW je Anteil	HKD 9,87	HKD 10,15	k. A.
<b>Administrative SGD (Hedged) Class:</b>			
Ausschüttende Anteile	SGD 1.096.755	SGD 1.175.473	SGD 385.478
ausgegebene und umlaufende Anteile	99.029	102.518	34.478
NIW je Anteil	SGD 11,08	SGD 11,47	SGD 11,18
<b>Class E:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 4.504.430	\$ 4.807.444	\$ 2.123.688
ausgegebene und umlaufende Anteile	334.041	351.851	165.415
NIW je Anteil	\$ 13,48	\$ 13,66	\$ 12,84
Ausschüttende Anteile	\$ 7.360.415	\$ 8.032.025	\$ 3.459.480
ausgegebene und umlaufende Anteile	684.629	722.592	318.388
NIW je Anteil	\$ 10,75	\$ 11,12	\$ 10,87
<b>Class E AUD (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	AUD 251.786	AUD 198.166	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.469	19.396	k. A.
NIW je Anteil	AUD 9,89	AUD 10,22	k. A.
<b>Class E CHF (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	CHF 98.396	CHF 103.213	CHF 37.710
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.868	9.047	3.434
NIW je Anteil	CHF 11,10	CHF 11,41	CHF 10,98
Ausschüttende Anteile	CHF 113.419	CHF 102.236	CHF 32.255
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.193	10.466	3.294
NIW je Anteil	CHF 9,30	CHF 9,77	CHF 9,79
<b>Class E CNH (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	CNH 218.292	CNH 451.454	CNH 131.038
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.914	3.879	1.208
NIW je Anteil	CNH 114,07	CNH 116,39	CNH 108,47
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 5.176.692	€ 5.737.395	€ 2.238.063
ausgegebene und umlaufende Anteile	405.408	437.788	178.201
NIW je Anteil	€ 12,77	€ 13,11	€ 12,56
Ausschüttende Anteile	€ 5.909.056	€ 5.859.938	€ 1.884.888
ausgegebene und umlaufende Anteile	581.977	550.550	177.395
NIW je Anteil	€ 10,15	€ 10,64	€ 10,63
<b>Class E GBP (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	£ 136.937	£ 92.574	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.216	9.222	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,63	£ 10,04	k. A.
<b>Class E HKD (Unhedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	HKD 7.682.407	HKD 6.584.958	HKD 759.023
ausgegebene und umlaufende Anteile	755.993	629.074	74.816
NIW je Anteil	HKD 10,16	HKD 10,47	HKD 10,15
<b>Class E JPY (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	JPY 990.797	JPY 1.015.325	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.014	1.014	k. A.
NIW je Anteil	JPY 977,00	JPY 1002,00	k. A.

	Income Fund (Forts.)					
	Zum 30. Jun. 2018		Zum 31. Dez. 2017		Zum 31. Dez. 2016	
<b>Class E SGD (Hedged):</b>						
Ausschüttende Anteile	SGD	2.112.717	SGD	2.147.087	SGD	534.072
ausgegebene und umlaufende Anteile		210.502		206.019		52.354
NIW je Anteil	SGD	10,04	SGD	10,42	SGD	10,20
<b>Class G Institutional EUR (Hedged):</b>						
Ausschüttende Anteile	€	114.515	€	13.643	€	1.398
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.476		1.338		133
NIW je Anteil	€	9,98	€	10,20	€	10,50
<b>Class G Retail EUR (Hedged):</b>						
Ausschüttende Anteile	€	23.086	€	671	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.398		68	k. A.	
NIW je Anteil	€	9,63	€	9,88	k. A.	
<b>Class H Institutional:</b>						
Thesaurierende Anteile	\$	10		k. A.	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.	k. A.	
NIW je Anteil	\$	9,99		k. A.	k. A.	
Ausschüttende Anteile	\$	10		k. A.	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.	k. A.	
NIW je Anteil	\$	9,96		k. A.	k. A.	
<b>Class H Institutional EUR (Hedged):</b>						
Thesaurierende Anteile	€	3.802	€	2.838	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		384		280	k. A.	
NIW je Anteil	€	9,91	€	10,14	k. A.	
<b>Class R:</b>						
Ausschüttende Anteile	\$	31.050	\$	32.575	\$	18.012
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.081		3.139		1.788
NIW je Anteil	\$	10,08	\$	10,38	\$	10,08
<b>Class R EUR (Hedged):</b>						
Ausschüttende Anteile	€	7.386	€	6.182	€	844
ausgegebene und umlaufende Anteile		742		595		82
NIW je Anteil	€	9,96	€	10,39	€	10,27
<b>Class R GBP (Hedged):</b>						
Ausschüttende Anteile	£	51.600	£	59.056	£	45.765
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.701		5.183		4.092
NIW je Anteil	£	10,98	£	11,39	£	11,19
<b>Class T:</b>						
Thesaurierende Anteile	\$	161.637	\$	146.103	\$	56.842
ausgegebene und umlaufende Anteile		14.341		12.770		5.265
NIW je Anteil	\$	11,27	\$	11,44	\$	10,80
Ausschüttende Anteile	\$	82.378	\$	76.172	\$	35.949
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.507		7.592		3.649
NIW je Anteil	\$	9,68	\$	10,03	\$	9,85
<b>Class T EUR (Hedged):</b>						
Thesaurierende Anteile	€	359.889	€	383.272	€	72.956
ausgegebene und umlaufende Anteile		33.522		34.714		6.868
NIW je Anteil	€	10,74	€	11,04	€	10,62
Ausschüttende Anteile	€	291.691	€	271.169	€	60.399
ausgegebene und umlaufende Anteile		31.725		28.073		6.237
NIW je Anteil	€	9,19	€	9,66	€	9,69
<b>Class Z:</b>						
Thesaurierende Anteile	\$	273.966	\$	279.087	\$	249.809
ausgegebene und umlaufende Anteile		18.769		19.009		18.369
NIW je Anteil	\$	14,60	\$	14,68	\$	13,60

	Income Fund (Forts.)					
	Zum 30. Jun. 2018		Zum 31. Dez. 2017		Zum 31. Dez. 2016	
<b>Class Z AUD (Hedged):</b>						
Ausschüttende Anteile	AUD	352.950	AUD	263.333	AUD	13.895
ausgegebene und umlaufende Anteile		32.960		23.995		1.325
NIW je Anteil	AUD	10,71	AUD	10,97	AUD	10,49
<b>Inflation Strategy Fund</b>						
Nettvermögen	\$	90.234	\$	89.502	\$	62.437
<b>Institutional Class:</b>						
Thesaurierende Anteile	\$	33.469	\$	29.467	\$	32.895
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.597		3.102		3.603
NIW je Anteil	\$	9,30	\$	9,50	\$	9,13
<b>Institutional EUR (Partially Hedged) Class:</b>						
Thesaurierende Anteile	€	23.735	€	22.062	€	4.285
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.568		2.331		449
NIW je Anteil	€	9,24	€	9,46	€	9,55
<b>Institutional GBP (Partially Hedged) Class:</b>						
Thesaurierende Anteile	£	2.354	£	5.624	£	5.220
ausgegebene und umlaufende Anteile		241		564		527
NIW je Anteil	£	9,77	£	9,97	£	9,91
<b>Class E:</b>						
Thesaurierende Anteile	\$	5.594	\$	5.548	\$	4.767
ausgegebene und umlaufende Anteile		642		620		547
NIW je Anteil	\$	8,72	\$	8,96	\$	8,71
Ausschüttende Anteile	\$	1.483	\$	1.656	\$	1.787
ausgegebene und umlaufende Anteile		173		187		207
NIW je Anteil	\$	8,58	\$	8,84	\$	8,63
<b>Class E EUR (Partially Hedged):</b>						
Thesaurierende Anteile	€	9.928	€	9.576	€	7.331
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.153		1.080		810
NIW je Anteil	€	8,61	€	8,87	€	9,06
Ausschüttende Anteile	€	6.233	€	6.022	€	4.063
ausgegebene und umlaufende Anteile		736		688		453
NIW je Anteil	€	8,47	€	8,75	€	8,97
<b>Low Average Duration Fund</b>						
Nettvermögen	\$	1.428.283	\$	1.733.028	\$	1.528.812
<b>Institutional Class:</b>						
Thesaurierende Anteile	\$	691.682	\$	723.889	\$	713.533
ausgegebene und umlaufende Anteile		45.418		47.226		47.305
NIW je Anteil	\$	15,23	\$	15,33	\$	15,09
Ausschüttende Anteile	\$	240.447	\$	351.448	\$	205.411
ausgegebene und umlaufende Anteile		23.035		33.201		19.460
NIW je Anteil	\$	10,44	\$	10,59	\$	10,56
<b>Institutional AUD (Hedged) Class:</b>						
Thesaurierende Anteile	AUD	2	AUD	10.631	AUD	10.354
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1.005		1.000
NIW je Anteil	AUD	10,52	AUD	10,58	AUD	10,36

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Low Average Duration Fund (Forts.)</b>			
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 221.201	€ 234.106	€ 156.959
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.396	22.207	14.839
NIW je Anteil	€ 10,34	€ 10,54	€ 10,58
Ausschüttende Anteile	€ 9.051	€ 44.624	€ 78.933
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.112	5.338	9.290
NIW je Anteil	€ 8,14	€ 8,36	€ 8,50
Institutional GBP (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 5.364	£ 333	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	542	33	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,90	£ 10,05	k. A.
Ausschüttende Anteile	£ 9.478	£ 9.779	£ 19.006
ausgegebene und umlaufende Anteile	959	968	1.867
NIW je Anteil	£ 9,88	£ 10,10	£ 10,18
Institutional ILS (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	ILS 518	ILS 75	ILS 179
ausgegebene und umlaufende Anteile	45	6	15
NIW je Anteil	ILS 11,45	ILS 11,63	ILS 11,59
Institutional NOK (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	k. A.	NOK 52.359	NOK 81.725
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	5.090	8.020
NIW je Anteil	k. A.	NOK 10,29	NOK 10,19
Investor Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 67.864	\$ 94.030	\$ 66.038
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.679	6.429	4.572
NIW je Anteil	\$ 14,50	\$ 14,63	\$ 14,44
Ausschüttende Anteile	\$ 8.106	\$ 8.014	\$ 5.147
ausgegebene und umlaufende Anteile	783	763	492
NIW je Anteil	\$ 10,35	\$ 10,50	\$ 10,47
Administrative Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 21.334	\$ 26.034	\$ 16.791
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.500	1.814	1.183
NIW je Anteil	\$ 14,22	\$ 14,35	\$ 14,19
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 61.202	\$ 88.240	\$ 93.298
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.992	7.119	7.582
NIW je Anteil	\$ 12,26	\$ 12,40	\$ 12,31
Ausschüttende Anteile	\$ 10.780	\$ 25.506	\$ 42.273
ausgegebene und umlaufende Anteile	999	2.330	3.873
NIW je Anteil	\$ 10,80	\$ 10,95	\$ 10,92
Class E EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 26.236	€ 36.209	€ 72.412
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.009	4.054	8.005
NIW je Anteil	€ 8,72	€ 8,93	€ 9,05
Class H Institutional:			
Thesaurierende Anteile	\$ 10	\$ 10	\$ 10.788
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	941
NIW je Anteil	\$ 11,53	\$ 11,62	\$ 11,46
Class R:			
Thesaurierende Anteile	\$ 6.234	\$ 7.002	\$ 8.120
ausgegebene und umlaufende Anteile	603	672	789
NIW je Anteil	\$ 10,34	\$ 10,42	\$ 10,29
Class R EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 1.191	€ 1.596	€ 1.506
ausgegebene und umlaufende Anteile	122	159	150
NIW je Anteil	€ 9,80	€ 10,00	€ 10,07
Class R GBP (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	£ 25	£ 253	£ 95
ausgegebene und umlaufende Anteile	3	26	10
NIW je Anteil	£ 9,48	£ 9,69	£ 9,77

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 558.147	\$ 628.973	\$ 237.565
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 66.259	\$ 51.694	\$ 62.444
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.032	4.699	5.853
NIW je Anteil	\$ 10,98	\$ 11,00	\$ 10,67
Institutional CHF (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	CHF 956	CHF 1.419	CHF 1.169
ausgegebene und umlaufende Anteile	96	140	117
NIW je Anteil	CHF 9,93	CHF 10,10	CHF 10,03
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 343.760	€ 422.933	€ 151.486
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.932	39.927	14.457
NIW je Anteil	€ 10,44	€ 10,60	€ 10,48
Institutional GBP (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 638	£ 644	£ 629
ausgegebene und umlaufende Anteile	59	59	59
NIW je Anteil	£ 10,77	£ 10,88	£ 10,67
Institutional NOK (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	NOK 552.048	NOK 253.080	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.538	2.518	k. A.
NIW je Anteil	NOK 99,68	NOK 100,51	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 17.982	€ 30.108	€ 12.717
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.793	2.945	1.246
NIW je Anteil	€ 10,03	€ 10,23	€ 10,20
<b>Low Duration Income Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 356.118	k. A.	k. A.
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 5.035	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	502	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,01	k. A.	k. A.
Ausschüttende Anteile	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,00	k. A.	k. A.
Institutional CHF (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	CHF 217	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	22	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 9,99	k. A.	k. A.
Ausschüttende Anteile	CHF 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 9,98	k. A.	k. A.
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 300.005	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.016	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,99	k. A.	k. A.
Institutional GBP (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 180	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	18	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,00	k. A.	k. A.
Ausschüttende Anteile	£ 7	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,99	k. A.	k. A.
Investor EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,99	k. A.	k. A.
Ausschüttende Anteile	€ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,98	k. A.	k. A.

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Low Duration Income Fund (Fortsetzung)</b>			
<b>Class E:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,01	k. A.	k. A.
<b>Class E CHF (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	CHF 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 9,98	k. A.	k. A.
Ausschüttende Anteile	CHF 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 9,97	k. A.	k. A.
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,98	k. A.	k. A.
Ausschüttende Anteile	€ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,98	k. A.	k. A.
<b>Class E SGD (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	SGD 335	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	34	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,99	k. A.	k. A.
<b>Class G Retail EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,98	k. A.	k. A.
<b>Nettovermögen</b>	<b>\$ 260.026</b>	<b>\$ 379.335</b>	<b>\$ 132.001</b>
<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>			
<b>Institutional Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 64.767	\$ 41.057	\$ 9.588
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.891	5.144	1.143
NIW je Anteil	\$ 8,21	\$ 7,98	\$ 8,38
Ausschüttende Anteile	\$ 27.107	\$ 94.646	\$ 45.860
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.990	13.915	6.130
NIW je Anteil	\$ 6,79	\$ 6,80	\$ 7,48
<b>Institutional EUR (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 117.118	€ 47.974	€ 2.963
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.009	6.226	359
NIW je Anteil	€ 7,80	€ 7,71	€ 8,25
Ausschüttende Anteile	€ 2.335	€ 6.473	€ 4.610
ausgegebene und umlaufende Anteile	361	986	627
NIW je Anteil	€ 6,46	€ 6,57	€ 7,35
<b>Institutional GBP (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	£ 2.216	£ 104	£ 880
ausgegebene und umlaufende Anteile	281	13	107
NIW je Anteil	£ 7,88	£ 7,75	£ 8,22
Ausschüttende Anteile	£ 7.758	£ 79.297	£ 52.497
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.191	12.033	7.172
NIW je Anteil	£ 6,51	£ 6,59	£ 7,32
<b>Investor Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 7.054	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	681	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,36	k. A.	k. A.
Ausschüttende Anteile	\$ 11	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,36	k. A.	k. A.
<b>Investor EUR (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,46	k. A.	k. A.

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund (Forts.)</b>			
<b>Class E:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 1.209	\$ 957	\$ 134
ausgegebene und umlaufende Anteile	154	125	16
NIW je Anteil	\$ 7,85	\$ 7,69	\$ 8,18
Ausschüttende Anteile	\$ 4.769	\$ 4.702	\$ 20
ausgegebene und umlaufende Anteile	734	718	3
NIW je Anteil	\$ 6,50	\$ 6,55	\$ 7,29
Income II Shares	\$ 1.252	\$ 1.261	\$ 59
ausgegebene und umlaufende Anteile	193	193	8
NIW je Anteil	\$ 6,49	\$ 6,54	\$ 7,28
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 881	€ 19.870	€ 2.199
ausgegebene und umlaufende Anteile	118	2.681	274
NIW je Anteil	€ 7,45	€ 7,41	€ 8,03
Ausschüttende Anteile	€ 129	€ 32	€ 6
ausgegebene und umlaufende Anteile	21	5	1
NIW je Anteil	€ 6,16	€ 6,31	€ 7,15
<b>Class G Institutional EUR (Hedged):</b>			
Ausschüttende Anteile	€ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 11,09	k. A.	k. A.
<b>Class R GBP (Hedged):</b>			
Thesaurierende Anteile	£ 12	£ 12	£ 43
ausgegebene und umlaufende Anteile	2	2	5
NIW je Anteil	£ 7,81	£ 7,69	£ 8,18
Ausschüttende Anteile	£ 5	£ 5	£ 5
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	£ 6,44	£ 6,53	£ 7,28
<b>Class Z:</b>			
Thesaurierende Anteile	k. A.	\$ 40.001	\$ 11
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	3.963	1
NIW je Anteil	k. A.	\$ 10,09	\$ 10,51
<b>Nettovermögen</b>	<b>\$ 2.367.523</b>	<b>\$ 1.484.592</b>	<b>k. A.</b>
<b>Mortgage Opportunities Fund</b>			
<b>Nettovermögen</b>	<b>\$ 2.367.523</b>	<b>\$ 1.484.592</b>	<b>k. A.</b>
<b>Institutional Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 652.957	\$ 363.204	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	62.384	34.794	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,47	\$ 10,44	k. A.
Ausschüttende Anteile	\$ 178.510	\$ 288.682	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.833	28.423	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,01	\$ 10,16	k. A.
Income II Shares	\$ 196.567	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.947	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,85	k. A.	k. A.
<b>Institutional BRL (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	\$ 4.261	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	478	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,92	k. A.	k. A.
<b>Institutional CHF (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	CHF 39.965	CHF 15.437	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.959	1.511	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,09	CHF 10,22	k. A.
<b>Institutional EUR (Hedged) Class:</b>			
Thesaurierende Anteile	€ 355.059	€ 244.386	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	34.942	23.808	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,16	€ 10,26	k. A.
Ausschüttende Anteile	€ 20.539	€ 17.975	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.117	1.802	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,70	€ 9,97	k. A.

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016	
<b>Mortgage Opportunities Fund (Forts.)</b>				
Institutional GBP (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	£ 3.899	£ 2.368		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	379	229		k. A.
NIW je Anteil	£ 10,28	£ 10,33		k. A.
Ausschüttende Anteile	£ 11.917	£ 2.062		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.212	205		k. A.
NIW je Anteil	£ 9,83	£ 10,05		k. A.
Investor Class:				
Thesaurierende Anteile	\$ 16.005	\$ 12.548		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.568	1.231		k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,20	\$ 10,19		k. A.
Ausschüttende Anteile	\$ 5.806	\$ 19.835		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	580	1.954		k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,00	\$ 10,15		k. A.
Investor EUR (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	€ 4.065	€ 11.051		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	409	1.098		k. A.
NIW je Anteil	€ 9,95	€ 10,07		k. A.
Administrative Class:				
Ausschüttende Anteile	\$ 785	\$ 807		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	78	79		k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,01	\$ 10,16		k. A.
Administrative SGD (Hedged) Class:				
Ausschüttende Anteile	SGD 709	SGD 214		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	71	21		k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,94	SGD 10,12		k. A.
Class E:				
Thesaurierende Anteile	\$ 223.760	\$ 206.524		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.638	19.933		k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,34	\$ 10,36		k. A.
Ausschüttende Anteile	\$ 98.388	\$ 95.598		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.820	9.403		k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,02	\$ 10,17		k. A.
Class E CHF (Hedged):				
Ausschüttende Anteile	CHF 635	CHF 49		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	66	5		k. A.
NIW je Anteil	CHF 9,56	CHF 9,85		k. A.
Class E EUR (Hedged):				
Thesaurierende Anteile	€ 77.675	€ 74.547		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.744	7.324		k. A.
NIW je Anteil	€ 10,03	€ 10,18		k. A.
Ausschüttende Anteile	€ 2.244	€ 306		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	233	31		k. A.
NIW je Anteil	€ 9,63	€ 9,90		k. A.
Class E HKD (Unhedged):				
Thesaurierende Anteile	HKD 78	HKD 78		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	8	8		k. A.
NIW je Anteil	HKD 9,99	HKD 9,97		k. A.
Class E SGD (Hedged):				
Thesaurierende Anteile	SGD 2.271	SGD 189		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	227	19		k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,03	SGD 10,08		k. A.
Ausschüttende Anteile	SGD 9.674	SGD 8.710		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	974	861		k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,93	SGD 10,12		k. A.
Class G Institutional EUR (Hedged):				
Ausschüttende Anteile	€ 752	€ 319		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	77	32		k. A.
NIW je Anteil	€ 9,82	€ 9,92		k. A.

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016	
<b>Mortgage Opportunities Fund (Forts.)</b>				
Class M Retail HKD (Unhedged):				
Ausschüttende Anteile	HKD 78	HKD 78		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	8	8		k. A.
NIW je Anteil	HKD 9,80	HKD 9,91		k. A.
Class T EUR (Hedged):				
Thesaurierende Anteile	€ 291	€ 9		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	30	1		k. A.
NIW je Anteil	€ 9,74	€ 9,90		k. A.
Class Z EUR (Hedged):				
Thesaurierende Anteile	€ 69.604	€ 41.640		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.905	4.103		k. A.
NIW je Anteil	€ 10,08	€ 10,15		k. A.
Class Z GBP (Hedged):				
Thesaurierende Anteile	£ 227.489	£ 58		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.769	6		k. A.
NIW je Anteil	£ 9,99	£ 10,01		k. A.
<b>PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund</b>				
Nettovermögen	\$ 65.457	\$ 82.721	\$ 13.554	
Institutional Class:				
Thesaurierende Anteile	\$ 8.410	\$ 9.568	\$ 10.424	
ausgegebene und umlaufende Anteile	695	737	1.024	
NIW je Anteil	\$ 12,11	\$ 12,98	\$ 10,18	
Institutional EUR (Unhedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	€ 1.533	€ 7.956	€ 525	
ausgegebene und umlaufende Anteile	133	661	49	
NIW je Anteil	€ 11,55	€ 12,04	€ 10,75	
Institutional GBP (Unhedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	£ 162	£ 103	£ 80	
ausgegebene und umlaufende Anteile	11	7	6	
NIW je Anteil	£ 14,41	£ 15,08	£ 12,95	
Class E:				
Thesaurierende Anteile	\$ 1.738	\$ 2.094	\$ 792	
ausgegebene und umlaufende Anteile	147	165	79	
NIW je Anteil	\$ 11,80	\$ 12,71	\$ 10,05	
Class E EUR (Unhedged):				
Thesaurierende Anteile	€ 4.921	€ 4.022	€ 1.086	
ausgegebene und umlaufende Anteile	437	341	102	
NIW je Anteil	€ 11,26	€ 11,78	€ 10,61	
Class R GBP (Unhedged):				
Thesaurierende Anteile	£ 9	£ 401	£ 344	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	27	27	
NIW je Anteil	£ 14,36	£ 15,04	£ 12,92	
Class T:				
Thesaurierende Anteile	\$ 270	\$ 287	\$ 10	
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	23	1	
NIW je Anteil	\$ 11,66	\$ 12,58	\$ 9,99	
Class T EUR (Unhedged):				
Thesaurierende Anteile	€ 690	€ 380	€ 99	
ausgegebene und umlaufende Anteile	62	32	9	
NIW je Anteil	€ 11,12	€ 11,67	€ 10,55	
Class Z EUR (Unhedged):				
Thesaurierende Anteile	€ 39.803	€ 46.012	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.769	4.195	k. A.	
NIW je Anteil	€ 10,56	€ 10,97	k. A.	

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>PIMCO RAE Fundamental Europe Fund</b>			
Nettovermögen	€ 17.364	€ 13.813	€ 12.572
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 10.907	€ 8.273	€ 12.293
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.023	750	1.238
NIW je Anteil	€ 10,65	€ 11,04	€ 9,93
Institutional GBP (Unhedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 13	£ 11	£ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	£ 13,29	£ 13,82	£ 11,96
Institutional USD (Unhedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 4.010	\$ 3.500	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	359	294	1
NIW je Anteil	\$ 11,16	\$ 11,89	\$ 9,40
Class E:			
Thesaurierende Anteile	€ 2.799	€ 2.478	€ 225
ausgegebene und umlaufende Anteile	270	229	23
NIW je Anteil	€ 10,38	€ 10,81	€ 9,80
Class E USD (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	\$ 11	\$ 24	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	2	1
NIW je Anteil	\$ 10,89	\$ 11,65	\$ 9,28
Class R GBP (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	£ 9	£ 9	£ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	£ 13,19	£ 13,74	£ 11,92
Class T:			
Thesaurierende Anteile	€ 180	€ 95	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	18	9	1
NIW je Anteil	€ 10,26	€ 10,69	€ 9,74
Class T USD (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	\$ 11	\$ 12	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 10,75	\$ 11,53	\$ 9,22

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 71.626	\$ 103.100	\$ 29.614
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 3.029	\$ 7.502	\$ 11.436
ausgegebene und umlaufende Anteile	246	594	1.089
NIW je Anteil	\$ 12,32	\$ 12,62	\$ 10,50
Institutional EUR (Unhedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 44.288	€ 65.335	€ 7.206
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.763	5.575	650
NIW je Anteil	€ 11,76	€ 11,72	€ 11,09
Institutional GBP (Unhedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 488	£ 401	£ 557
ausgegebene und umlaufende Anteile	33	27	42
NIW je Anteil	£ 14,68	£ 14,67	£ 13,36
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 190	\$ 170	\$ 16
ausgegebene und umlaufende Anteile	16	14	2
NIW je Anteil	\$ 12,02	\$ 12,36	\$ 10,37
Class E EUR (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 13.489	€ 13.503	€ 9.331
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.177	1.178	852
NIW je Anteil	€ 11,46	€ 11,47	€ 10,95
Class R GBP (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	£ 9	£ 9	£ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	£ 14,57	£ 14,59	£ 13,32

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund (Forts.)</b>			
Class T:			
Thesaurierende Anteile	\$ 45	\$ 12	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	1	1
NIW je Anteil	\$ 11,87	\$ 12,23	\$ 10,30
Class T EUR (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 212	€ 160	€ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	19	14	1
NIW je Anteil	€ 11,33	€ 11,35	€ 10,88

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 50.397	\$ 83.679	\$ 60.943
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 10.613	\$ 17.212	\$ 1.673
ausgegebene und umlaufende Anteile	822	1.230	157
NIW je Anteil	\$ 12,91	\$ 13,99	\$ 10,62
Institutional EUR (Unhedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 16.378	€ 28.345	€ 22.668
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.126	1.850	1.711
NIW je Anteil	€ 14,54	€ 15,32	€ 13,25
Class E EUR (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 469	€ 26.517	€ 31.407
ausgegebene und umlaufende Anteile	32	1.936	2.617
NIW je Anteil	€ 12,91	€ 13,69	€ 12,00
Class G Institutional EUR (Unhedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 17.215	€ 476	€ 2.108
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.333	31	157
NIW je Anteil	€ 14,71	€ 15,49	€ 13,40
Class Z:			
Thesaurierende Anteile	\$ 15	\$ 16	\$ 12
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 14,57	\$ 15,70	\$ 11,79

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 250.902	\$ 421.968	\$ 547.973
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 12.838	\$ 12.282	\$ 5.988
ausgegebene und umlaufende Anteile	847	800	481
NIW je Anteil	\$ 15,15	\$ 15,36	\$ 12,45
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 56.375	€ 87.539	€ 91.630
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.464	6.832	8.412
NIW je Anteil	€ 12,63	€ 12,81	€ 10,89
Income II Shares	k. A.	€ 48.653	€ 115.474
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	4.522	10.838
NIW je Anteil	k. A.	€ 10,76	€ 10,65
Institutional EUR (Unhedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 329	€ 339	€ 111
ausgegebene und umlaufende Anteile	19	20	7
NIW je Anteil	€ 17,07	€ 16,82	€ 15,52
Income II Shares	k. A.	€ 13.552	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1.310	k. A.
NIW je Anteil	k. A.	€ 10,34	k. A.
Institutional GBP (Unhedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 27	£ 72	£ 92
ausgegebene und umlaufende Anteile	2	4	6
NIW je Anteil	£ 17,83	£ 17,64	£ 15,65
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 1.257	\$ 1.433	\$ 633
ausgegebene und umlaufende Anteile	95	107	57
NIW je Anteil	\$ 13,17	\$ 13,44	\$ 11,04

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (Forts.)</b>			
Class E EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 140.891	€ 185.336	€ 302.340
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.762	15.148	28.696
NIW je Anteil	€ 11,98	€ 12,23	€ 10,53
Class E EUR (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 4.757	€ 3.983	€ 3.327
ausgegebene und umlaufende Anteile	305	258	230
NIW je Anteil	€ 15,58	€ 15,45	€ 14,45
Class G Institutional EUR (Unhedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 441	€ 501	€ 262
ausgegebene und umlaufende Anteile	29	34	19
NIW je Anteil	€ 14,98	€ 14,76	€ 13,78

	PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund		
Nettovermögen	\$ 127.123	\$ 149.038	\$ 185.731
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 125.787	\$ 131.103	\$ 180.381
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.394	7.780	12.631
NIW je Anteil	\$ 17,01	\$ 16,85	\$ 14,28
Institutional EUR (Unhedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 356	€ 13.984	€ 4.940
ausgegebene und umlaufende Anteile	19	756	277
NIW je Anteil	€ 19,22	€ 18,51	€ 17,86
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 784	\$ 1.019	\$ 83
ausgegebene und umlaufende Anteile	55	72	7
NIW je Anteil	\$ 14,14	\$ 14,09	\$ 12,10
Class G Institutional EUR (Unhedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 104	€ 92	€ 43
ausgegebene und umlaufende Anteile	8	7	3
NIW je Anteil	€ 13,81	€ 13,30	€ 12,99
Class Z:			
Thesaurierende Anteile	\$ 14	\$ 14	\$ 11
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 13,86	\$ 13,67	\$ 11,49

	PIMCO RAE Fundamental US Fund		
Nettovermögen	\$ 13.806	\$ 14.083	\$ 20.352
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 12.793	\$ 12.713	\$ 14.796
ausgegebene und umlaufende Anteile	994	994	1.336
NIW je Anteil	\$ 12,87	\$ 12,79	\$ 11,07
Institutional EUR (Unhedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 11	€ 11	€ 4.950
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	423
NIW je Anteil	€ 12,33	€ 11,87	€ 11,69
Institutional GBP (Unhedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 87	£ 84	£ 83
ausgegebene und umlaufende Anteile	6	6	6
NIW je Anteil	£ 15,33	£ 14,87	£ 14,09
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 31	\$ 43	\$ 11
ausgegebene und umlaufende Anteile	2	3	1
NIW je Anteil	\$ 12,54	\$ 12,52	\$ 10,93
Class E EUR (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 408	€ 907	€ 179
ausgegebene und umlaufende Anteile	34	78	15
NIW je Anteil	€ 11,96	€ 11,62	€ 11,55

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>PIMCO RAE Fundamental US Fund (Forts.)</b>			
Class R GBP (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	£ 10	£ 10	£ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	£ 15,20	£ 14,76	£ 14,03
Class T:			
Thesaurierende Anteile	\$ 309	\$ 12	\$ 11
ausgegebene und umlaufende Anteile	25	1	1
NIW je Anteil	\$ 12,40	\$ 12,40	\$ 10,86
Class T EUR (Unhedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 48	€ 71	€ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	6	1
NIW je Anteil	€ 11,83	€ 11,50	€ 11,48

	Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund		
Nettovermögen	\$ 546.281	\$ 511.888	\$ 355.768
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 205.553	\$ 242.702	\$ 212.560
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.062	15.835	15.389
NIW je Anteil	\$ 14,62	\$ 15,32	\$ 13,82
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 206.932	€ 203.189	€ 134.206
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.566	17.150	12.322
NIW je Anteil	€ 11,14	€ 11,85	€ 10,89
Ausschüttende Anteile	€ 83.348	€ 18.143	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.059	1.817	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,20	€ 9,98	k. A.
Investor NOK (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	NOK 6.697	NOK 8.354	NOK 8.229
ausgegebene und umlaufende Anteile	58	68	73
NIW je Anteil	NOK 116,32	NOK 123,00	NOK 112,03
Investor SEK (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	SEK 8.855	SEK 19.563	SEK 6.334
ausgegebene und umlaufende Anteile	81	168	59
NIW je Anteil	SEK 109,64	SEK 116,83	SEK 107,86

	StocksPLUS™ Fund		
Nettovermögen	\$ 1.990.142	\$ 695.478	\$ 1.070.441
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 1.618.860	\$ 1.354.271	\$ 919.133
ausgegebene und umlaufende Anteile	50.075	42.763	35.448
NIW je Anteil	\$ 32,33	\$ 31,67	\$ 25,93
Ausschüttende Anteile	\$ 44.267	\$ 50.256	\$ 33.920
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.875	2.173	1.781
NIW je Anteil	\$ 23,61	\$ 23,13	\$ 19,05
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 113.118	€ 99.908	€ 19.785
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.522	4.910	1.165
NIW je Anteil	€ 20,49	€ 20,35	€ 16,99
Ausschüttende Anteile	€ 5.581	€ 24.717	€ 5.294
ausgegebene und umlaufende Anteile	311	1.387	354
NIW je Anteil	€ 17,94	€ 17,82	€ 14,96

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>StocksPLUS Fund (Forts.)</b>			
Investor Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 17.317	\$ 20.308	\$ 3.369
ausgegebene und umlaufende Anteile	572	684	138
NIW je Anteil	\$ 30,28	\$ 29,71	\$ 24,41
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 56.502	\$ 48.851	\$ 87.529
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.941	1.705	3.699
NIW je Anteil	\$ 29,11	\$ 28,65	\$ 23,66
Class E EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 97.787	€ 59.847	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.066	5.562	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,79	€ 10,76	k. A.
Class T:			
Thesaurierende Anteile	\$ 391	\$ 234	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	32	20	k. A.
NIW je Anteil	\$ 12,13	\$ 11,96	k. A.
Class Z:			
Ausschüttende Anteile	\$ 46	\$ 45	\$ 37
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	2	1
NIW je Anteil	\$ 31,37	\$ 30,66	\$ 25,23
<b>Strategic Income Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 919.921	\$ 785.534	\$ 389.129
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 29.806	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.008	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,91	k. A.	k. A.
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 470.094	€ 439.923	€ 268.658
ausgegebene und umlaufende Anteile	38.159	34.972	22.888
NIW je Anteil	€ 12,32	€ 12,58	€ 11,74
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 24.442	\$ 22.069	\$ 16.468
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.001	1.780	1.447
NIW je Anteil	\$ 12,21	\$ 12,40	\$ 11,38
Income II Shares	\$ 15.735	\$ 15.071	\$ 8.390
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.548	1.431	834
NIW je Anteil	\$ 10,17	\$ 10,53	\$ 10,06
Class E EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 140.998	€ 102.670	€ 47.953
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.939	8.476	4.200
NIW je Anteil	€ 11,81	€ 12,11	€ 11,42
Income II Shares	€ 82.312	€ 59.925	€ 26.466
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.374	5.822	2.624
NIW je Anteil	€ 9,83	€ 10,29	€ 10,09
Class G Institutional EUR (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	€ 373	€ 213	€ 18
ausgegebene und umlaufende Anteile	36	20	2
NIW je Anteil	€ 10,46	€ 10,68	€ 10,66
Class T EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 24.998	€ 15.341	€ 1.508
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.329	1.391	145
NIW je Anteil	€ 10,73	€ 11,03	€ 10,43
Ausschüttende Anteile	€ 9.192	€ 5.173	€ 760
ausgegebene und umlaufende Anteile	927	503	77
NIW je Anteil	€ 9,91	€ 10,29	€ 9,90
<b>Total Return Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 5.734.304	\$ 6.394.519	\$ 6.148.083
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 1.439.342	\$ 1.518.212	\$ 1.388.620
ausgegebene und umlaufende Anteile	50.069	51.782	49.698
NIW je Anteil	\$ 28,75	\$ 29,32	\$ 27,94

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>Total Return Bond Fund (Forts.)</b>			
Ausschüttende Anteile	\$ 216.340	\$ 227.554	\$ 195.386
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.273	13.522	11.910
NIW je Anteil	\$ 16,30	\$ 16,83	\$ 16,40
Institutional CAD (Hedged) Class:			
Ausschüttende Anteile	CAD 15.610	CAD 4.540	CAD 2.632
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.616	453	268
NIW je Anteil	CAD 9,66	CAD 10,01	CAD 9,81
Institutional CHF (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	CHF 11.467	CHF 26.653	CHF 13.045
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.055	2.370	1.187
NIW je Anteil	CHF 10,87	CHF 11,25	CHF 10,99
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 581.834	€ 598.839	€ 434.792
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.556	27.447	20.503
NIW je Anteil	€ 21,11	€ 21,82	€ 21,21
Ausschüttende Anteile	€ 154.885	€ 157.618	€ 140.044
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.855	10.559	9.438
NIW je Anteil	€ 14,27	€ 14,93	€ 14,84
Institutional EUR (Unhedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 18.190	€ 14.381	€ 27.405
ausgegebene und umlaufende Anteile	739	589	1.035
NIW je Anteil	€ 24,61	€ 24,41	€ 26,48
Institutional GBP (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 14.352	£ 14.563	£ 15.328
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.125	1.110	1.212
NIW je Anteil	£ 12,76	£ 13,12	£ 12,64
Ausschüttende Anteile	£ 46.372	£ 55.756	£ 59.135
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.843	5.595	6.018
NIW je Anteil	£ 9,57	£ 9,97	£ 9,83
Institutional ILS (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	ILS 3.428	ILS 4.192	ILS 2.322
ausgegebene und umlaufende Anteile	268	319	183
NIW je Anteil	ILS 12,78	ILS 13,15	ILS 12,69
Institutional JPY (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	JPY 1.815.920	JPY 1.751.987	JPY 1.589.413
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.772	1.657	1.550
NIW je Anteil	JPY 1.025,00	JPY 1.057,00	JPY 1.025,00
Institutional SGD (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	SGD 29.959	SGD 30.587	SGD 29.223
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.436	2.429	2.429
NIW je Anteil	SGD 12,30	SGD 12,59	SGD 12,03
Investor Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 485.003	\$ 544.684	\$ 481.394
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.086	19.880	18.373
NIW je Anteil	\$ 26,82	\$ 27,40	\$ 26,20
Ausschüttende Anteile	\$ 106.917	\$ 87.580	\$ 87.325
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.469	5.132	5.249
NIW je Anteil	\$ 16,53	\$ 17,06	\$ 16,63



	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)</b>			
Investor EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 37	€ 38	€ 37
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	4	4
NIW je Anteil	€ 9,67	€ 10,03	€ 9,70
Class E:			
Thesaurierende Anteile	\$ 6.784	\$ 6.320	\$ 1.031
ausgegebene und umlaufende Anteile	683	619	106
NIW je Anteil	\$ 9,93	\$ 10,20	\$ 9,75
Ausschüttende Anteile	\$ 316	\$ 334	\$ 382
ausgegebene und umlaufende Anteile	32	33	39
NIW je Anteil	\$ 9,92	\$ 10,19	\$ 9,74
Class E CHF (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	CHF 110	CHF 115	CHF 113
ausgegebene und umlaufende Anteile	12	12	12
NIW je Anteil	CHF 9,30	CHF 9,70	CHF 9,49
Class E EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 24.710	€ 30.690	€ 38.788
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.614	3.119	4.046
NIW je Anteil	€ 9,45	€ 9,84	€ 9,59
Ausschüttende Anteile	€ 218	€ 305	€ 272
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	31	28
NIW je Anteil	€ 9,44	€ 9,83	€ 9,58
Class E GBP (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	£ 53	£ 55	£ 53
ausgegebene und umlaufende Anteile	5	5	5
NIW je Anteil	£ 9,77	£ 10,13	£ 9,78
Class R:			
Thesaurierende Anteile	\$ 10	\$ 10	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 10,25	\$ 10,47	\$ 9,91
Class R EUR (Hedged):			
Thesaurierende Anteile	€ 37	€ 39	€ 37
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	4	4
NIW je Anteil	€ 9,75	€ 10,10	€ 9,74
Class R GBP (Hedged):			
Ausschüttende Anteile	£ 55	£ 56	£ 54
ausgegebene und umlaufende Anteile	6	5	5
NIW je Anteil	£ 9,88	£ 10,25	£ 9,86
Class Z:			
Thesaurierende Anteile	\$ 10	\$ 11	\$ 17.192
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1.738
NIW je Anteil	\$ 10,42	\$ 10,58	\$ 9,89
<b>UK Corporate Bond Fund</b>			
Nettovermögen	£ 434.300	£ 480.675	£ 298.523
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 276.108	£ 320.157	£ 295.278
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.948	15.898	15.483
NIW je Anteil	£ 19,80	£ 20,14	£ 19,08
Ausschüttende Anteile	£ 156.537	£ 159.218	£ 3.205
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.580	15.393	319
NIW je Anteil	£ 10,05	£ 10,34	£ 10,04
Class R:			
Thesaurierende Anteile	£ 1.647	£ 1.292	£ 33
ausgegebene und umlaufende Anteile	152	117	3
NIW je Anteil	£ 10,85	£ 11,06	£ 10,51
Ausschüttende Anteile	£ 8	£ 8	£ 7
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	£ 10,43	£ 10,74	£ 10,40

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016
<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>			
Nettovermögen	£ 426.076	£ 434.641	£ 462.914
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 320.173	£ 363.219	£ 323.416
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.936	15.475	14.757
NIW je Anteil	£ 22,97	£ 23,47	£ 21,92
Ausschüttende Anteile	£ 105.903	£ 71.422	£ 139.498
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.055	4.580	9.258
NIW je Anteil	£ 15,01	£ 15,59	£ 15,07
<b>Unconstrained Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 2.344.893	\$ 2.525.901	\$ 2.272.628
Institutional Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 625.984	\$ 779.728	\$ 768.889
ausgegebene und umlaufende Anteile	47.470	59.527	61.458
NIW je Anteil	\$ 13,19	\$ 13,10	\$ 12,51
Ausschüttende Anteile	\$ 21.809	\$ 5.120	\$ 49.674
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.974	459	4.530
NIW je Anteil	\$ 11,05	\$ 11,17	\$ 10,97
Institutional CHF (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	CHF 52.433	CHF 57.212	CHF 60.236
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.901	5.303	5.708
NIW je Anteil	CHF 10,70	CHF 10,79	CHF 10,55
Institutional EUR (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	€ 454.113	€ 518.887	€ 235.319
ausgegebene und umlaufende Anteile	36.090	40.985	19.083
NIW je Anteil	€ 12,58	€ 12,66	€ 12,33
Ausschüttende Anteile	€ 28.702	€ 27.428	€ 26.808
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.733	2.550	2.491
NIW je Anteil	€ 10,50	€ 10,76	€ 10,76
Institutional GBP (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	£ 345.706	£ 233.999	£ 351.162
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.234	19.091	29.665
NIW je Anteil	£ 12,24	£ 12,26	£ 11,84
Ausschüttende Anteile	£ 5.348	£ 5.666	£ 751
ausgegebene und umlaufende Anteile	542	563	75
NIW je Anteil	£ 9,87	£ 10,06	£ 9,99
Institutional NOK (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	NOK 267.646	NOK 353.896	NOK 384.029
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.006	29.113	32.851
NIW je Anteil	NOK 12,16	NOK 12,16	NOK 11,69
Institutional SEK (Hedged) Class:			
Thesaurierende Anteile	SEK 321.278	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.221	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SEK 99,75	k. A.	k. A.
Investor Class:			
Thesaurierende Anteile	\$ 42.889	\$ 41.821	\$ 47.870
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.787	3.711	4.431
NIW je Anteil	\$ 11,33	\$ 11,27	\$ 10,80

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2018			Zum 31. Dez. 2017			Zum 31. Dez. 2016		
	Unconstrained Bond Fund (Forts.)								
Ausschüttende Anteile	\$	2.596	\$	2.844	\$	12.515			
ausgegebene und umlaufende Anteile		263		285		1.276			
NIW je Anteil	\$	9,88	\$	9,99	\$	9,81			
Investor EUR (Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	€	5.605	€	5.284	€	5.875			
ausgegebene und umlaufende Anteile		516		482		549			
NIW je Anteil	€	10,86	€	10,95	€	10,70			
Administrative Class:									
Thesaurierende Anteile	\$	30.380	\$	31.704	\$	20.238			
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.404		2.519		1.675			
NIW je Anteil	\$	12,64	\$	12,59	\$	12,08			
Administrative EUR (Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	€	11.440	€	41.801	€	54.696			
ausgegebene und umlaufende Anteile		948		3.435		4.593			
NIW je Anteil	€	12,06	€	12,17	€	11,91			
Administrative SEK (Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	SEK	164.776	SEK	196.318	SEK	237.709			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.499		1.770		2.186			
NIW je Anteil	SEK	109,92	SEK	110,94	SEK	108,72			
Class E:									
Thesaurierende Anteile	\$	69.747	\$	68.849	\$	95.707			
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.257		6.190		8.925			
NIW je Anteil	\$	11,15	\$	11,12	\$	10,72			
Ausschüttende Anteile	\$	23.346	\$	51.833	\$	25.912			
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.313		5.080		2.587			
NIW je Anteil	\$	10,09	\$	10,20	\$	10,02			
Class E CHF (Hedged):									
Thesaurierende Anteile	CHF	17.789	CHF	21.407	CHF	28.748			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.787		2.124		2.889			
NIW je Anteil	CHF	9,95	CHF	10,08	CHF	9,95			
Class E EUR (Hedged):									
Thesaurierende Anteile	€	197.449	€	218.090	€	223.776			
ausgegebene und umlaufende Anteile		16.946		18.520		19.338			
NIW je Anteil	€	11,65	€	11,78	€	11,57			
Class E GBP (Hedged):									
Thesaurierende Anteile	£	5.246	£	5.624	£	6.003			
ausgegebene und umlaufende Anteile		470		501		549			
NIW je Anteil	£	11,15	£	11,22	£	10,93			
Class G Institutional EUR (Hedged):									
Ausschüttende Anteile	€	39	€	47	€	33			
ausgegebene und umlaufende Anteile		4		5		3			
NIW je Anteil	€	9,48	€	9,54	€	9,84			
Class G Retail EUR (Hedged):									
Ausschüttende Anteile	€	32.921	€	34.606	€	38.608			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.460		3.598		3.896			
NIW je Anteil	€	9,52	€	9,62	€	9,91			
Class R:									
Thesaurierende Anteile	\$	8.693	\$	9.125	\$	8.684			
ausgegebene und umlaufende Anteile		805		850		846			
NIW je Anteil	\$	10,80	\$	10,74	\$	10,27			
Ausschüttende Anteile	\$	407	\$	509	\$	557			
ausgegebene und umlaufende Anteile		42		53		59			
NIW je Anteil	\$	9,58	\$	9,68	\$	9,51			
Class Z AUD (Hedged):									
Ausschüttende Anteile	AUD	51.594	AUD	49.330	AUD	34.303			
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.997		4.722		3.363			
NIW je Anteil	AUD	10,32	AUD	10,45	AUD	10,20			

	Zum 30. Jun. 2018			Zum 31. Dez. 2017			Zum 31. Dez. 2016		
	US High Yield Bond Fund								
Nettovermögen	\$	2.782.873	\$	3.014.320	\$	2.655.336			
Institutional Class:									
Thesaurierende Anteile	\$	1.304.219	\$	1.230.344	\$	988.582			
ausgegebene und umlaufende Anteile		39.415		37.127		32.040			
NIW je Anteil	\$	33,09	\$	33,14	\$	30,86			
Ausschüttende Anteile	\$	148.490	\$	147.381	\$	121.757			
ausgegebene und umlaufende Anteile		15.124		14.563		12.235			
NIW je Anteil	\$	9,82	\$	10,12	\$	9,95			
Institutional EUR (Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	€	203.201	€	331.120	€	378.194			
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.324		11.764		14.154			
NIW je Anteil	€	27,75	€	28,14	€	26,73			
Ausschüttende Anteile	€	288.577	€	329.417	€	225.233			
ausgegebene und umlaufende Anteile		23.376		25.550		17.438			
NIW je Anteil	€	12,35	€	12,89	€	12,92			
Institutional GBP (Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	£	44.219	£	52.142	£	253.599			
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.146		2.507		12.950			
NIW je Anteil	£	20,61	£	20,80	£	19,59			
Ausschüttende Anteile	£	38.066	£	39.172	£	1.816			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.791		3.755		175			
NIW je Anteil	£	10,04	£	10,43	£	10,37			
Investor Class:									
Thesaurierende Anteile	\$	206.808	\$	188.731	\$	132.810			
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.891		6.269		4.721			
NIW je Anteil	\$	30,01	\$	30,10	\$	28,14			
Ausschüttende Anteile	\$	28.936	\$	36.393	\$	23.201			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.645		4.449		2.884			
NIW je Anteil	\$	7,94	\$	8,18	\$	8,05			
Investor EUR (Hedged) Class:									
Thesaurierende Anteile	€	2.343	€	3.654	€	4.511			
ausgegebene und umlaufende Anteile		92		141		183			
NIW je Anteil	€	25,43	€	25,84	€	24,62			
Class E:									
Thesaurierende Anteile	\$	130.884	\$	141.833	\$	109.971			
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.413		4.754		3.923			
NIW je Anteil	\$	29,66	\$	29,83	\$	28,04			
Ausschüttende Anteile	\$	80.598	\$	71.645	\$	77.163			
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.697		6.639		7.270			
NIW je Anteil	\$	10,47	\$	10,79	\$	10,62			
Class E EUR (Hedged):									
Thesaurierende Anteile	€	82.056	€	95.584	€	53.927			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.304		3.777		2.225			
NIW je Anteil	€	24,83	€	25,30	€	24,25			
Class H Institutional:									
Thesaurierende Anteile	\$	50.836	\$	117.922	\$	148.512			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.576		3.647		4.925			
NIW je Anteil	\$	32,25	\$	32,33	\$	30,17			
Class M Retail:									
Ausschüttende Anteile	\$	10.668	\$	12.677	\$	10.357			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.006		1.160		963			
NIW je Anteil	\$	10,60	\$	10,93	\$	10,76			
Class R:									
Thesaurierende Anteile	\$	14.150	\$	7.811	\$	7.194			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.069		588		581			
NIW je Anteil	\$	13,24	\$	13,27	\$	12,40			
Ausschüttende Anteile	\$	926	\$	1.023	\$	1.308			
ausgegebene und umlaufende Anteile		93		100		130			
NIW je Anteil	\$	9,92	\$	10,23	\$	10,06			

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016	
<b>US High Yield Bond Fund (Forts.)</b>				
Class R GBP (Hedged):				
Ausschüttende Anteile	£ 989	£ 1.190	£ 1.011	
ausgegebene und umlaufende Anteile	102	118	101	
NIW je Anteil	£ 9,67	£ 10,05	£ 9,99	
Class Z:				
Thesaurierende Anteile	\$ 23.696	\$ 21.086	\$ 19.525	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.036	1.814	1.814	
NIW je Anteil	\$ 11,64	\$ 11,62	\$ 10,77	
<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>				
Nettovermögen	\$ 177.718	\$ 159.790	\$ 136.046	
Institutional Class:				
Thesaurierende Anteile	\$ 76.521	\$ 64.316	\$ 15.064	
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.437	6.047	1.527	
NIW je Anteil	\$ 10,29	\$ 10,64	\$ 9,87	
Ausschüttende Anteile	\$ 20.667	\$ 68	\$ 10	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.133	7	1	
NIW je Anteil	\$ 9,69	\$ 10,21	\$ 9,78	
Institutional CHF (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	CHF 240	CHF 264	CHF 239	
ausgegebene und umlaufende Anteile	25	26	25	
NIW je Anteil	CHF 9,79	CHF 10,28	CHF 9,77	
Institutional EUR (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	€ 3.761	€ 157	€ 201	
ausgegebene und umlaufende Anteile	380	15	20	
NIW je Anteil	€ 9,90	€ 10,37	€ 9,83	
Ausschüttende Anteile	€ 455	€ 9	€ 9	
ausgegebene und umlaufende Anteile	49	1	1	
NIW je Anteil	€ 9,33	€ 9,96	€ 9,74	
Institutional GBP (Hedged) Class:				
Income II Shares	£ 55.971	£ 69.272	£ 97.508	
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.974	6.943	10.016	
NIW je Anteil	£ 9,37	£ 9,98	£ 9,74	
Class E:				
Ausschüttende Anteile	\$ 997	\$ 933	\$ 10	
ausgegebene und umlaufende Anteile	103	91	1	
NIW je Anteil	\$ 9,69	\$ 10,21	\$ 9,78	
Class E EUR (Hedged):				
Thesaurierende Anteile	€ 287	€ 118	€ 9	
ausgegebene und umlaufende Anteile	30	12	1	
NIW je Anteil	€ 9,62	€ 10,13	€ 9,68	
Ausschüttende Anteile	€ 101	€ 111	€ 9	
ausgegebene und umlaufende Anteile	11	11	1	
NIW je Anteil	€ 9,33	€ 9,97	€ 9,74	
Class H Institutional:				
Thesaurierende Anteile	\$ 10	\$ 10	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.	
NIW je Anteil	\$ 9,81	\$ 10,15	k. A.	
Ausschüttende Anteile	\$ 10	\$ 10	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.	
NIW je Anteil	\$ 9,51	\$ 10,02	k. A.	
<b>US Short-Term Fund</b>				
Nettovermögen	\$ 1.839.151	\$ 1.372.039	\$ 652.542	
Institutional Class:				
Thesaurierende Anteile	\$ 546.152	\$ 567.531	\$ 149.644	
ausgegebene und umlaufende Anteile	50.776	53.358	14.378	
NIW je Anteil	\$ 10,76	\$ 10,64	\$ 10,41	
Institutional EUR (Hedged) Class:				
Thesaurierende Anteile	€ 337.273	€ 77.213	€ 42.833	
ausgegebene und umlaufende Anteile	33.055	7.557	4.203	
NIW je Anteil	€ 10,20	€ 10,22	€ 10,19	

	Zum 30. Jun. 2018	Zum 31. Dez. 2017	Zum 31. Dez. 2016	
<b>US Short-Term Fund (Forts.)</b>				
Investor Class:				
Thesaurierende Anteile	\$ 26.593	\$ 21.281	\$ 23.143	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.507	2.025	2.244	
NIW je Anteil	\$ 10,61	\$ 10,51	\$ 10,32	
Class E:				
Thesaurierende Anteile	\$ 173.736	\$ 99.870	\$ 41.429	
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.396	9.513	4.018	
NIW je Anteil	\$ 10,60	\$ 10,50	\$ 10,31	
Class E EUR (Hedged):				
Thesaurierende Anteile	€ 1.985	€ 3.498	€ 4.485	
ausgegebene und umlaufende Anteile	198	348	446	
NIW je Anteil	€ 10,02	€ 10,05	€ 10,07	
Class Z:				
Ausschüttende Anteile	\$ 696.569	\$ 586.440	\$ 388.417	
ausgegebene und umlaufende Anteile	68.627	57.846	38.533	
NIW je Anteil	\$ 10,15	\$ 10,14	\$ 10,08	

## 16. VERGÜTUNG

Die Gesellschaft wendet eine Vergütungspolitik an, die den geltenden OGAW-Anforderungen entspricht und im Verkaufsprospekt zusammengefasst ist.

Nähere Einzelheiten zur Vergütung der Gesellschaft sowie entsprechende finanzielle Angaben werden im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018 bereitgestellt.

## 17. RECHTSSTREITIGKEITEN UND AUFSICHTSRECHTLICHE ANGELEGENHEITEN

Die Gesellschaft ist nicht als Beklagte an wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schiedsverfahren beteiligt und ihr sind etwaige solche gegen sie bestehenden oder drohenden wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schadensersatzforderungen nicht bekannt.

Die vorangehenden Ausführungen gelten lediglich zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts.

## 18. KREDITFAZILITÄT

Der US High Yield Bond Fund und der Global High Yield Bond Fund (die „Teilfonds“ und jeweils ein „Teilfonds“) haben am 29. September 2017 eine syndizierte geänderte und neu gefasste Kreditfazilität (die „Kreditvereinbarung“) zwischen u.a. den Teilfonds, bestimmten Kreditgebern, zu denen auch The Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ, Ltd. („BTUFJ“) (als Kreditgeber) zählt, und BTUFJ (als Agent und Lead Arranger) abgeschlossen. Jeder Teilfonds darf die Fazilität für temporäre Zwecke nutzen, um Rücknahmen durch Anteilinhaber zu finanzieren, sowie für andere kurzfristige Liquiditätszwecke, die gemäß seiner Anlagepolitik zulässig sind.

Der Gesamtbetrag, der für eine Nutzung durch die Teilfonds zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung auf USD 421.000.000. Die Teilfonds können zusammen mit den anderen Kreditnehmern (gemeinsam als die „Kreditnehmer“ bezeichnet) und vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung eine Erhöhung des insgesamt von den Kreditgebern gemäß der Kreditvereinbarung zugesagten Betrags um bis zu USD 125.000.000 beantragen. 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 Teilfonds selbst, welcher Zinssatz für das jeweilige Darlehen gilt. Hierbei wird der geltende Zinssatz durch Bezugnahme auf (i) die Alternate Base Rate (alternativer Basiszinssatz) oder (ii) die Adjusted Offered Rate (angepasster Briefkurs) bestimmt. Die Alternate Base Rate liegt 1,125 % über der am jeweiligen Feststellungstag geltenden Federal Funds Rate (US-Leitzins) (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung). Der durch Bezugnahme auf die Adjusted Offered Rate bestimmte Zinssatz entspricht der Summe aus der geltenden Marge (diese beträgt 1,125 %) und der geltenden Adjusted Offered Rate. Die für einen Zinszeitraum (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) geltende Adjusted Offered Rate ist ein jährlicher Zinssatz, der dem Quotienten entspricht, der sich ergibt, wenn (a) der LIBOR Offered Rate (LIBOR-Briefkurs) (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) durch (b) 1,00 abzüglich der Reserve Percentage (Reservesatz) (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) geteilt wird.

Ein Kredit, der auf Basis der Alternate Base Rate in Anspruch genommen wird, ist vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarungen innerhalb von 60 Tagen nach Inanspruchnahme zurückzuzahlen. Ein Kredit, der auf Basis der Adjusted Offer Rate in Anspruch genommen wird, ist vorbehaltlich der Bestimmungen der

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Kreditvereinbarungen am letzten Tag eines maßgeblichen Zinszeitraums (dieser kann nach Wahl eines Teilfonds einem Zeitraum von einer Woche, einem Monat oder zwei Monaten entsprechen) zurückzuzahlen.

Sämtliche Kredite werden auf unbesicherter Basis gewährt, und der Rückgriff der Kreditgeber gegenüber den Teilfonds ist auf die Vermögenswerte der Teilfonds beschränkt.

Zum 30. Juni 2018 und zum 31. Dezember 2017 hatte keiner der Teilfonds im Rahmen der Kreditvereinbarung Kredite in Anspruch genommen.

### 19. VORSCHRIFT ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN

Die Richtlinie über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions Regulation, „SFTR“) führt Melde- und Offenlegungspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions, „SFTs“) 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 Sell-Buyback-Geschäfte
- Lombardgeschäfte

#### (a) Globale Daten und Konzentration von SFT-Kontrahenten

Zum 30. Juni 2018 hielten die Teilfonds die folgenden Arten von SFTs und Total Return Swaps:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sell-Buyback-Finanzierungsgeschäfte
- Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg gestaltete sich zum 30. Juni 2018, jeweils gruppiert nach SFT und den zehn größten Kontrahenten, wie folgt: Wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt:

Fonds	Marktwert (000\$)	% des Nettvermögens
<b>PIMCO Capital Securities Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (90)	0,00
DUB	(381)	(0,01)
GST	(6.581)	(0,08)
JPM	(5.620)	(0,07)
<b>Summe</b>	<b>(12.672)</b>	<b>(0,16)</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	29.400	0,38
IND	140.000	1,81
JPS	116.100	1,50
NOM	86.500	1,12
RDR	66.900	0,86
SCX	900.000	11,62
TDM	98.300	1,27
<b>Summe</b>	<b>1.437.200</b>	<b>18,56</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(217.858)	(2,81)
FOB	(192.821)	(2,49)
GRE	(218.391)	(2,82)
RDR	(280.799)	(3,63)
<b>Summe</b>	<b>(909.869)</b>	<b>(11,75)</b>
<b>Commodity Real Return Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (191)	(0,03)
CBK	(716)	(0,10)
CIB	(96)	(0,01)
FBF	(48)	(0,01)
GST	(498)	(0,09)
JPM	(341)	(0,05)
MEI	(106)	(0,02)
SOG	(11)	0,00
<b>Summe</b>	<b>(2.007)</b>	<b>(0,31)</b>

Fonds	Marktwert (000\$)	% des Nettvermögens
<b>Commodity Real Return Fund (Forts.)</b>		
Pensionsgeschäfte		
DEU	\$ 12.500	1,96
RDR	7.900	1,24
SSB	145	0,02
<b>Summe</b>	<b>20.545</b>	<b>3,22</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(26.051)	(4,07)
BPS	(1.759)	(0,27)
GRE	(34.038)	(5,34)
IND	(1.364)	(0,21)
SCX	(15.604)	(2,45)
<b>Summe</b>	<b>(78.816)</b>	<b>(12,34)</b>
<b>PIMCO Credit Absolute Return Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
MBC	\$ 6.100	3,33
SSB	789	0,43
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(32.840)	(17,95)
<b>Diversified Income Fund</b>		
Total Return Swaps		
GST	\$ 122	0,00
MYC	5	0,00
<b>Summe</b>	<b>127</b>	<b>0,00</b>
Pensionsgeschäfte		
MBC	103.000	1,47
SSB	37.653	0,54
<b>Summe</b>	<b>140.653</b>	<b>2,01</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BCY	(15.241)	(0,22)
<b>Diversified Income Duration Hedged Fund</b>		
Total Return Swaps		
GST	\$ (6)	0,00
JPM	29	0,00
MYC	1	0,00
<b>Summe</b>	<b>24</b>	<b>0,00</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	53.200	4,02
SSB	10.496	0,79
<b>Summe</b>	<b>63.696</b>	<b>4,81</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BCY	(2.056)	(0,16)
<b>Dynamic Multi-Asset Fund</b>		
Total Return Swaps		
SOG	€ 0	0,00
Pensionsgeschäfte		
BPS	30.600	2,63
IND	214.300	18,39
SSB	2.903	0,25
<b>Summe</b>	<b>247.803</b>	<b>21,27</b>
<b>Emerging Asia Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 158	0,44
<b>Emerging Local Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
MBC	\$ 93.000	3,95
SSB	3.912	0,16
<b>Summe</b>	<b>96.912</b>	<b>4,11</b>
<b>Emerging Markets 2018 Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 507	0,76
TDM	4.500	6,79
<b>Summe</b>	<b>5.007</b>	<b>7,55</b>
<b>Emerging Markets Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 582	\$ 0,02
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(8.514)	\$ (0,32)

Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 127	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(1.182)	(0,59)
SCX	(6.634)	(3,33)
<b>Summe</b>	<b>(7.816)</b>	<b>(3,92)</b>
<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
MBC	\$ 10.900	19,17
SSB	652	1,14
<b>Summe</b>	<b>11.552</b>	<b>20,31</b>
<b>Euro Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
GST	€ (13)	0,00
JPM	98	0,01
MYC	3	0,00
MYI	25	0,00
<b>Summe</b>	<b>113</b>	<b>0,01</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	18.600	1,26
SSB	331	0,02
<b>Summe</b>	<b>18.931</b>	<b>1,28</b>
<b>Euro Credit Fund</b>		
Total Return Swaps		
GST	€ (3)	0,00
JPM	16	0,00
MYC	1	0,00
MYI	24	0,01
<b>Summe</b>	<b>38</b>	<b>0,01</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	8.000	1,15
SSB	188	0,03
<b>Summe</b>	<b>8.188</b>	<b>1,18</b>
<b>Euro Income Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
GST	€ (6)	0,00
JPM	31	0,00
MYC	1	0,00
MYI	46	0,01
<b>Summe</b>	<b>72</b>	<b>0,01</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	12.200	0,87
SSB	2.155	0,15
<b>Summe</b>	<b>14.355</b>	<b>1,02</b>
<b>Euro Long Average Duration Fund</b>		
Total Return Swaps		
GST	€ (2)	0,00
MYC	0	0,00
MYI	4	0,00
<b>Summe</b>	<b>2</b>	<b>0,00</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	3.200	1,36
SSB	207	0,09
<b>Summe</b>	<b>3.407</b>	<b>1,45</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SCX	(3.444)	(1,47)
<b>Euro Low Duration Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 8.300	1,23
SSB	622	0,09
<b>Summe</b>	<b>8.922</b>	<b>1,32</b>
<b>Euro Short-Term Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	€ 202	0,02

Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Global Advantage Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 1.092	0,15
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(18.387)	(2,46)
BPS	(7.999)	(1,07)
GRE	(14.907)	(2,00)
IND	(26.668)	(3,57)
<b>Summe</b>	<b>(67.961)</b>	<b>(9,10)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BCY	(11.508)	(1,54)
GSC	(13.050)	(1,75)
<b>Summe</b>	<b>(24.558)</b>	<b>(3,29)</b>
<b>Global Advantage Real Return Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 590	0,58
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(4.819)	(4,75)
BPS	(1.954)	(1,92)
GRE	(4.429)	(4,36)
IND	(8.087)	(7,98)
SCX	(9.979)	(9,84)
<b>Summe</b>	<b>(29.268)</b>	<b>(28,85)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
TDM	(622)	(0,61)
<b>Global Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 9.798	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BCY	(90.414)	(0,85)
BPS	(125.181)	(1,18)
SCX	(172.325)	(1,63)
<b>Summe</b>	<b>(387.920)</b>	<b>(3,66)</b>
<b>Global Bond ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 8.600	1,95
SSB	963	0,22
TDM	57.800	13,11
<b>Summe</b>	<b>67.363</b>	<b>15,28</b>
<b>Global Bond Ex-US Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 2.484	0,25
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(13.992)	(1,40)
BPS	(15.349)	(1,54)
GRE	(19.994)	(2,01)
IND	(31.622)	(3,17)
<b>Summe</b>	<b>(80.957)</b>	<b>(8,12)</b>
<b>Global High Yield Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ (387)	(0,01)
CBK	(333)	(0,01)
GST	(14)	0,00
<b>Summe</b>	<b>(734)</b>	<b>(0,02)</b>
Pensionsgeschäfte		
SSB	3.785	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BCY	(35.046)	(0,87)
CFR	(2.553)	(0,06)
<b>Summe</b>	<b>(37.599)</b>	<b>(0,93)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens	Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Global Investment Grade Credit Fund</b>			<b>Income Fund (Forts.)</b>		
Pensionsgeschäfte			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 8.597	0,05	BCY	\$ (46.027)	(0,07)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BOM	(3.082)	(0,01)
BCY	(9.327)	(0,04)	BOS	(513.960)	(0,78)
BOS	(18.182)	(0,10)	CIB	(367.565)	(0,56)
BRC	(9.286)	(0,05)	GRE	(601.357)	(0,92)
NXN	(720.507)	(3,79)	JPS	(800.624)	(1,22)
RCY	(177.528)	(0,94)	RBC	(259.946)	(0,40)
SCX	(26.036)	(0,14)	RCY	(2.036.648)	(3,10)
SGY	(5.340)	(0,03)	SCX	(316.706)	(0,48)
TDM	(8.177)	(0,04)	<b>Summe</b>	<b>(4.945.915)</b>	<b>(7,54)</b>
<b>Summe</b>	<b>(974.383)</b>	<b>(5,13)</b>	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			BPG	(4.856)	(0,01)
BCY	(42.959)	(0,22)	GSC	(192.352)	(0,29)
NOM	(1.221)	(0,01)	<b>Summe</b>	<b>(197.208)</b>	<b>(0,30)</b>
<b>Summe</b>	<b>(44.180)</b>	<b>(0,23)</b>	<b>Inflation Strategy Fund</b>		
<b>Global Libor Plus Bond Fund</b>			Total Return Swaps		
Pensionsgeschäfte			BNP	\$ (21)	(0,02)
BPS	\$ 40.100	6,00	BOA	5	0,00
NOM	67.300	10,08	BPS	(37)	(0,05)
SSB	1.437	0,22	CBK	(10)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>108.837</b>	<b>16,30</b>	DUB	(236)	(0,26)
<b>Global Low Duration Real Return Fund</b>			GST	(9)	(0,01)
Pensionsgeschäfte			JPM	(5)	0,00
SSB	\$ 1.453	0,09	MYI	98	0,11
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			<b>Summe</b>	<b>(215)</b>	<b>(0,24)</b>
BPG	(65.232)	(4,19)	Pensionsgeschäfte		
TDM	(325.302)	(20,89)	SSB	132	0,15
<b>Summe</b>	<b>(390.534)</b>	<b>(25,08)</b>	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
<b>Global Multi-Asset Fund</b>			GRE	(4.571)	(5,07)
Total Return Swaps			<b>Low Average Duration Fund</b>		
BNP	\$ 16	0,00	Pensionsgeschäfte		
BOA	81	0,01	SSB	\$ 3.282	0,23
BPS	(198)	(0,02)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GST	(9)	0,00	BOS	(35.059)	(2,46)
JPM	(10)	0,00	IND	(37.359)	(2,62)
MEI	(5.100)	(0,50)	SCX	(41.634)	(2,91)
MYI	5	0,00	<b>Summe</b>	<b>(114.052)</b>	<b>(7,99)</b>
<b>Summe</b>	<b>(5.215)</b>	<b>(0,51)</b>	<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
GRE	(29.106)	(2,83)	SSB	\$ 547	0,10
IND	(36.960)	(3,60)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	<b>(66.066)</b>	<b>(6,43)</b>	BOS	(3.204)	(0,58)
<b>Global Real Return Fund</b>			GRE	(51.788)	(9,28)
Pensionsgeschäfte			JPS	(18.226)	(3,26)
SSB	\$ 1.025	0,05	<b>Summe</b>	<b>(73.218)</b>	<b>(13,12)</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BOS	(241.417)	(10,84)	BPG	(40.052)	(7,18)
BPS	(17.550)	(0,79)	<b>Low Duration Income Fund</b>		
GRE	(160.337)	(7,19)	Pensionsgeschäfte		
IND	(118.366)	(5,31)	BOS	\$ 30.700	8,62
SCX	(58.064)	(2,60)	<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>		
<b>Summe</b>	<b>(595.734)</b>	<b>(26,73)</b>	Total Return Swaps		
<b>Income Fund</b>			BOA	\$ (621)	(0,24)
Total Return Swaps			BPS	11	0,00
BOA	\$ (872)	0,00	CBK	(204)	(0,07)
BPS	(149)	0,00	GST	171	0,07
FBF	(117)	0,00	MYI	(27)	(0,02)
GST	352	0,00	<b>Summe</b>	<b>(670)</b>	<b>(0,26)</b>
JPM	(519)	0,00	Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	<b>(1.305)</b>	<b>0,00</b>	SSB	1.601	0,62
Pensionsgeschäfte					
NOM	8.000	0,01			
SSB	38.170	0,06			
<b>Summe</b>	<b>46.170</b>	<b>0,07</b>			

Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettvermögens
<b>Mortgage Opportunities Fund</b>		
Total Return Swaps		
JPS	\$ 15	0,00
Pensionsgeschäfte		
RDR	13.300	0,56
SSB	24.122	1,02
<b>Summe</b>	<b>37.422</b>	<b>1,58</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(152.333)	(6,43)
NOM	(294.019)	(12,42)
SCX	(142.797)	(6,03)
<b>Summe</b>	<b>(589.149)</b>	<b>(24,88)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
NOM	(25.040)	(1,06)
<b>PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund</b>		
Total Return Swaps		
FBF	\$ (90)	(0,18)
JPM	(1.395)	(2,77)
MEI	(578)	(1,15)
<b>Summe</b>	<b>(2.063)</b>	<b>(4,10)</b>
Pensionsgeschäfte		
SSB	433	0,86
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(2.252)	(4,47)
<b>PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund</b>		
Total Return Swaps		
DUB	\$ (3.866)	(1,54)
SOG	(1.835)	(0,73)
<b>Summe</b>	<b>(5.701)</b>	<b>(2,27)</b>
Pensionsgeschäfte		
SSB	2.311	0,92
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(4.839)	(1,93)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BCY	(2.849)	(1,13)
BPG	(24.885)	(9,92)
MSC	(3.433)	(1,37)
TDM	(4.776)	(1,91)
<b>Summe</b>	<b>(35.943)</b>	<b>(14,33)</b>
<b>PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 222	0,18
CBK	(975)	(0,77)
DUB	(674)	(0,53)
<b>Summe</b>	<b>(1.427)</b>	<b>(1,12)</b>
Pensionsgeschäfte		
JPS	21.400	16,83
SSB	919	0,73
<b>Summe</b>	<b>22.319</b>	<b>17,56</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(2.857)	(2,25)
<b>Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 563	0,10
<b>StocksPLUS™ Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 3.011	0,15
CBK	(706)	(0,04)
DUB	(910)	(0,05)
FAR	3.778	0,19
GST	157	0,01
MYI	2.321	0,12
<b>Summe</b>	<b>7.651</b>	<b>0,38</b>

Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettvermögens
<b>StocksPLUS™ Fund (Forts.)</b>		
Pensionsgeschäfte		
BSN	\$ 138.100	6,94
MFK	150.000	7,54
SSB	14.953	0,75
<b>Summe</b>	<b>303.053</b>	<b>15,23</b>
<b>Strategic Income Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ (8)	0,00
BPS	(1)	0,00
FBF	(5)	0,00
GST	6	0,00
JPM	(2)	0,00
<b>Summe</b>	<b>(10)</b>	<b>0,00</b>
Pensionsgeschäfte		
SSB	2	0,00
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BCY	(2.183)	(0,24)
<b>Total Return Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
FBF	\$ (189)	0,00
Pensionsgeschäfte		
SSB	5.454	0,10
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BCY	(43.118)	(0,75)
BOS	(73.450)	(1,28)
BRC	(2.530)	(0,04)
GRE	(624.828)	(10,89)
IND	(438.147)	(7,65)
<b>Summe</b>	<b>(1.182.073)</b>	<b>(20,61)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
MSC	(17.683)	(0,31)
<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPG	\$ 23.000	18,73
SSB	1.100	0,90
<b>Summe</b>	<b>24.100</b>	<b>19,63</b>
<b>UK Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	£ 664	0,15
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
IND	(27.607)	(6,36)
<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	£ 786	0,18
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
IND	(21.299)	(5,00)
SCX	(83.944)	(19,70)
<b>Summe</b>	<b>(105.243)</b>	<b>(24,70)</b>
<b>Unconstrained Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
NOM	\$ 6.400	0,27
SSB	736	0,03
<b>Summe</b>	<b>7.136</b>	<b>0,30</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(44.071)	(1,88)
GRE	(29.903)	(1,27)
<b>Summe</b>	<b>(73.974)</b>	<b>(3,15)</b>
<b>US High Yield Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ (107)	0,00
CBK	(20)	0,00
GST	(246)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(373)</b>	<b>(0,01)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettvermögens
<b>US High Yield Bond Fund (Forts.)</b>		
Pensionsgeschäfte		
JPS	\$ 82.300	2,96
MFK	50.000	1,80
NOM	27.400	0,98
SSB	5.426	0,19
<b>Summe</b>	<b>165.126</b>	<b>5,93</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BCY	(34.201)	(1,23)
NOM	(3.432)	(0,12)
UBS	(5.748)	(0,21)
<b>Summe</b>	<b>(43.381)</b>	<b>(1,56)</b>
<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 433	0,24
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(18.235)	(10,25)
RCY	(2.092)	(1,18)
SCX	(5.684)	(3,21)
<b>Summe</b>	<b>(26.011)</b>	<b>(14,64)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(7.435)	(4,18)
<b>US Short-Term Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 301	0,02
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JPS	(44.862)	(2,44)

Zum 31. Dezember 2017 hielten die Teilfonds die folgenden Arten von SFTs und Total Return Swaps:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte
- Sell-Buyback-Finanzierungsgeschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg gestaltete sich zum 31. Dezember 2017, jeweils gruppiert nach SFT und den zehn größten Kontrahenten, wie folgt: Wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt:

Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettvermögens
<b>PIMCO Capital Securities Fund</b>		
Total Return Swaps		
DUB	\$ 90	0,00
GST	(6)	0,00
<b>Summe</b>	<b>84</b>	<b>0,00</b>
Pensionsgeschäfte		
RDR	415.700	4,76
SCX	410.000	4,70
SSB	9.649	0,11
<b>Summe</b>	<b>835.349</b>	<b>9,57</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(228.178)	(2,61)
BRC	(2.083)	(0,02)
FOB	(203.023)	(2,33)
<b>Summe</b>	<b>(433.284)</b>	<b>(4,96)</b>
<b>Commodity Real Return Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ (3)	0,00
BPS	2.453	0,47
CBK	7.111	1,37
CIB	282	0,05
FBF	137	0,03
GST	5.037	0,97
JPM	7.056	1,37
MEI	1.433	0,28
MYC	(2)	0,00
SOG	119	0,02
<b>Summe</b>	<b>23.623</b>	<b>4,56</b>

Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettvermögens
<b>Commodity Real Return Fund (Forts.)</b>		
Pensionsgeschäfte		
SAL	\$ 15.100	2,91
SSB	5.765	1,11
<b>Summe</b>	<b>20.865</b>	<b>4,02</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(6.636)	(1,28)
IND	(2.387)	(0,46)
MEI	(1.808)	(0,35)
SCX	(37.352)	(7,20)
<b>Summe</b>	<b>(48.183)</b>	<b>(9,29)</b>
<b>PIMCO Credit Absolute Return Fund</b>		
Total Return Swaps		
GST	\$ 16	0,01
Pensionsgeschäfte		
SSB	544	0,19
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(19.243)	(6,67)
GRE	(10.866)	(3,76)
<b>Summe</b>	<b>(30.109)</b>	<b>(10,43)</b>
<b>Diversified Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 51.783	0,65
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BCY	(7.476)	(0,10)
MEI	(1.179)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(8.655)</b>	<b>(0,11)</b>
<b>Diversified Income Duration Hedged Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
DEU	\$ 4.900	0,39
SSB	13.492	1,07
<b>Summe</b>	<b>18.392</b>	<b>1,46</b>
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>		
BCY	(1.082)	(0,09)
<b>Dynamic Multi-Asset Fund</b>		
Total Return Swaps		
SOG	€ 1.001	0,10
Pensionsgeschäfte		
SSB	3.225	0,31
<b>Emerging Asia Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 168	0,42
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JML	(424)	(1,06)
<b>Emerging Markets 2018 Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 547	0,75
<b>Emerging Markets Bond Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ (34.199)	(1,03)
BRC	(1.431)	(0,04)
NOM	(5.742)	(0,17)
<b>Summe</b>	<b>(41.372)</b>	<b>(1,24)</b>
<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 937	0,40
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(8.003)	(3,42)
BRC	(270)	(0,12)
SCX	(7.395)	(3,16)
<b>Summe</b>	<b>(15.668)</b>	<b>(6,70)</b>
<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SAL	\$ 5.300	11,81
SSB	469	1,04
<b>Summe</b>	<b>5.769</b>	<b>12,85</b>

Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettvermögens	Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettvermögens
<b>Euro Bond Fund</b>			<b>Global Bond Ex-US Fund</b>		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
SSB	€ 2.907	0,23	SSB	\$ 1.648	0,18
<b>Euro Credit Fund</b>			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			BOS	(13.735)	(1,47)
SSB	€ 466	0,06	IND	(59.113)	(6,35)
<b>Euro Income Bond Fund</b>			MEI	(15.129)	(1,63)
Pensionsgeschäfte			<b>Summe</b>	<b>(87.977)</b>	<b>(9,45)</b>
SSB	€ 873	0,08	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
<b>Euro Long Average Duration Fund</b>			TDM	(2.331)	(0,25)
Pensionsgeschäfte			<b>Global High Yield Bond Fund</b>		
SSB	€ 75	0,03	Total Return Swaps		
<b>Euro Short-Term Fund</b>			GST	\$ 71	0,00
Pensionsgeschäfte			JPM	81	0,00
SSB	€ 155	0,01	<b>Summe</b>	<b>152</b>	<b>0,00</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(10.278)	(0,71)	BCY	(30.041)	(0,56)
IND	(11.100)	(0,76)	CFR	(8.412)	(0,16)
MEI	(16.855)	(1,16)	JML	(1.956)	(0,04)
SOG	(7.292)	(0,50)	<b>Summe</b>	<b>(40.409)</b>	<b>(0,76)</b>
SCX	(6.202)	(0,42)	<b>Global Investment Grade Credit Fund</b>		
<b>Summe</b>	<b>(51.727)</b>	<b>(3,55)</b>	Total Return Swaps		
<b>Global Advantage Fund</b>			JPM	\$ (1)	0,00
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 2.774	0,35	BCY	197.100	0,95
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			SSB	2.021	0,01
BOS	(4.201)	(0,53)	<b>Summe</b>	<b>199.121</b>	<b>0,96</b>
BPS	(981)	(0,13)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(3.726)	(0,47)	BCY	(8.784)	(0,04)
IND	(52.488)	(6,65)	BRC	(9.550)	(0,05)
MEI	(8.121)	(1,03)	CIB	(197.028)	(0,95)
<b>Summe</b>	<b>(69.517)</b>	<b>(8,81)</b>	GRE	(394.729)	(1,89)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			IND	(246.331)	(1,19)
MSC	(4.155)	(0,53)	JML	(5.163)	(0,02)
TDM	(2.576)	(0,32)	JPS	(284.887)	(1,38)
<b>Summe</b>	<b>(6.731)</b>	<b>(0,85)</b>	MEI	(583)	0,00
<b>Global Advantage Real Return Fund</b>			NXN	(821.900)	(3,97)
Total Return Swaps			SCX	(147.151)	(0,71)
BOA	\$ (3)	0,00	<b>Summe</b>	<b>(2.116.106)</b>	<b>(10,20)</b>
GST	(8)	(0,01)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
JPM	(2)	0,00	BCY	(197.309)	(0,95)
<b>Summe</b>	<b>(13)</b>	<b>(0,01)</b>	<b>Global Libor Plus Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
SSB	759	0,60	BPG	\$ 14.200	2,63
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			NOM	53.600	9,91
BOS	(11.414)	(9,03)	SSB	1.794	0,33
BPS	(1.847)	(1,46)	<b>Summe</b>	<b>69.594</b>	<b>12,87</b>
GRE	(697)	(0,55)	<b>Global Low Duration Real Return Fund</b>		
IND	(11.148)	(8,82)	Total Return Swaps		
MEI	(130)	(0,10)	BOA	\$ (3)	0,00
SCX	(19.992)	(15,81)	GST	(5)	0,00
<b>Summe</b>	<b>(45.228)</b>	<b>(35,77)</b>	JPM	(2)	0,00
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			MYC	(2)	0,00
BCY	(396)	(0,31)	<b>Summe</b>	<b>(12)</b>	<b>0,00</b>
BPG	(1.968)	(1,56)	Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	<b>(2.364)</b>	<b>(1,87)</b>	SSB	1.125	0,05
<b>Global Bond ESG Fund</b>			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			JPS	(74.785)	(3,40)
SSB	\$ 2.203	0,77	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
<b>Global Bond Fund</b>			BPG	(66.477)	(3,03)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			TDM	(52.673)	(2,39)
BPS	\$ (3.112)	(0,03)	<b>Summe</b>	<b>(119.150)</b>	<b>(5,42)</b>
CFR	(9.352)	(0,09)			
SCX	(296.650)	(2,85)			
<b>Summe</b>	<b>(309.114)</b>	<b>(2,97)</b>			

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens	Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Global Multi-Asset Fund</b>			<b>Inflation Strategy Fund (Forts.)</b>		
Total Return Swaps			Pensionsgeschäfte		
BOA	\$ 13	0,00	SSB	\$ 725	0,81
BPS	(15)	0,00	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
FBF	(1)	0,00	BOS	(5.925)	(6,61)
GST	629	0,06	<b>Low Average Duration Fund</b>		
JPM	(64)	(0,01)	Pensionsgeschäfte		
MEI	2.493	0,23	SAL	\$ 18.500	1,07
MYC	(10)	0,00	SSB	1.716	0,10
MYI	(71)	(0,01)	<b>Summe</b>	<b>20.216</b>	<b>1,17</b>
<b>Summe</b>	<b>2.974</b>	<b>0,27</b>	<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BOS	(7.757)	(0,73)	SSB	\$ 5.340	0,85
IND	(44.952)	(4,19)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SCX	(71.361)	(6,68)	DEU	(18.922)	(3,01)
<b>Summe</b>	<b>(124.070)</b>	<b>(11,60)</b>	GRE	(28.096)	(4,47)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			<b>Summe</b>	<b>(47.018)</b>	<b>(7,48)</b>
BCY	(2.074)	(0,19)	<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>		
<b>Global Real Return Fund</b>			Total Return Swaps		
Total Return Swaps			BOA	\$ 2.247	0,57
BOA	\$ (11)	0,00	BPS	27	0,01
GST	(67)	(0,01)	CBK	269	0,09
JPM	(25)	0,00	GST	33	0,01
MYC	(6)	0,00	JPM	191	0,05
<b>Summe</b>	<b>(109)</b>	<b>(0,01)</b>	MYI	77	0,02
Pensionsgeschäfte			<b>Summe</b>	<b>2.844</b>	<b>0,75</b>
SSB	1.349	0,06	Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			SSB	1.932	0,51
BOS	(47.470)	(2,15)	<b>Mortgage Opportunities Fund</b>		
IND	(147.204)	(6,70)	Total Return Swaps		
MEI	(42.345)	(1,93)	JPS	\$ 8	0,00
GRE	(63.230)	(2,88)	Pensionsgeschäfte		
SCX	(451.575)	(20,56)	SSB	581	0,04
<b>Summe</b>	<b>(751.824)</b>	<b>(34,22)</b>	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			BOS	(267.433)	(18,02)
BPG	(1.665)	(0,08)	BPS	(3.376)	(0,23)
MSC	(3.419)	(0,15)	SCX	(10.696)	(0,72)
TDM	(16.293)	(0,74)	<b>Summe</b>	<b>(281.505)</b>	<b>(18,97)</b>
<b>Summe</b>	<b>(21.377)</b>	<b>(0,97)</b>	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
<b>Income Fund</b>			BCY	(19.308)	(1,30)
Total Return Swaps			<b>PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund</b>		
BOA	\$ 337	0,00	Total Return Swaps		
CBK	841	0,00	GST	\$ 17	0,02
GST	446	0,00	FBF	1.273	1,52
JPM	879	0,00	JPM	1.006	1,20
<b>Summe</b>	<b>2.503</b>	<b>0,00</b>	MEI	1.249	1,50
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			<b>Summe</b>	<b>3.545</b>	<b>4,24</b>
BOS	(132.585)	(0,18)	Pensionsgeschäfte		
BSN	(28.931)	(0,04)	JPS	7.700	9,20
BRC	(4.202)	(0,01)	SSB	1.519	1,82
NOM	(1.798)	0,00	<b>Summe</b>	<b>9.219</b>	<b>11,02</b>
SCX	(72.030)	(0,10)	<b>PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund</b>		
<b>Summe</b>	<b>(239.546)</b>	<b>(0,33)</b>	Total Return Swaps		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			GST	\$ 50	0,02
TDM	(7.529)	(0,01)	JPM	3.020	0,72
<b>Inflation Strategy Fund</b>			MEI	1.611	0,38
Total Return Swaps			SOG	(207)	(0,05)
BOA	\$ 130	0,14	<b>Summe</b>	<b>4.474</b>	<b>1,07</b>
BPS	89	0,10	Pensionsgeschäfte		
CBK	127	0,14	SSB	6.644	1,57
GST	128	0,15	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JPM	130	0,15	DEU	(4.555)	(1,08)
MYI	25	0,03	JPS	(66.188)	(15,69)
<b>Summe</b>	<b>629</b>	<b>0,71</b>	GRE	(46.710)	(11,06)
			<b>Summe</b>	<b>(117.453)</b>	<b>(27,83)</b>

Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens	Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (Forts.)</b>			<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b>		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			Total Return Swaps		
BCY	\$ (15.456)	(3,67)	GST	\$ (20)	(0,01)
NOM	(5.577)	(1,32)	Pensionsgeschäfte		
TDM	(1.058)	(0,25)	DEU	10.700	7,98
<b>Summe</b>	<b>(22.091)</b>	<b>(5,24)</b>	SSB	1.711	1,28
<b>PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund</b>			<b>Summe</b>	<b>12.411</b>	<b>9,26</b>
Total Return Swaps			<b>UK Corporate Bond Fund</b>		
BPS	\$ (76)	(0,05)	Pensionsgeschäfte		
CBK	135	0,09	SSB	£ 951	0,20
DUB	366	0,25	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GST	88	0,06	SCX	(27.374)	(5,70)
JPM	17	0,01	<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>		
<b>Summe</b>	<b>530</b>	<b>0,36</b>	Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			SSB	£ 1.495	0,34
SSB	158	0,11	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			IND	(1.384)	(0,32)
BCY	(3.857)	(2,59)	SCX	(81.487)	(18,75)
<b>Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund</b>			<b>Summe</b>	<b>(82.871)</b>	<b>(19,07)</b>
Pensionsgeschäfte			<b>Unconstrained Bond Fund</b>		
SSB	\$ 405	0,08	Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			SSB	\$ 2.554	0,10
NOM	(1.152)	(0,22)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(562)	(0,11)	BOS	(77.553)	(3,08)
<b>Summe</b>	<b>(1.714)</b>	<b>(0,33)</b>	DEU	(9.506)	(0,38)
<b>StocksPLUS™ Fund</b>			GRE	(258.654)	(10,24)
Total Return Swaps			NOM	(1.165)	(0,05)
BRC	\$ 6.765	0,40	<b>Summe</b>	<b>(346.878)</b>	<b>(13,75)</b>
FAR	8.401	0,49	<b>US High Yield Bond Fund</b>		
GST	2.419	0,15	Total Return Swaps		
MYI	5.527	0,33	CBK	\$ 136	0,01
<b>Summe</b>	<b>23.112</b>	<b>1,37</b>	GST	43	0,00
Pensionsgeschäfte			<b>Summe</b>	<b>179</b>	<b>0,01</b>
MFK	100.000	5,90	Pensionsgeschäfte		
SAL	22.500	1,33	BCY	18.300	0,61
SSB	7.053	0,41	BOS	236.300	7,84
<b>Summe</b>	<b>129.553</b>	<b>7,64</b>	JPS	4.900	0,16
<b>Strategic Income Fund</b>			MFK	100.000	3,32
Total Return Swaps			NOM	6.800	0,22
BOA	\$ 2	0,00	SAL	51.900	1,72
CBK	6	0,00	SSB	12.037	0,40
GST	2	0,00	<b>Summe</b>	<b>430.237</b>	<b>14,27</b>
JPM	3	0,00	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	<b>13</b>	<b>0,00</b>	BCY	(28.809)	(0,96)
Pensionsgeschäfte			NOM	(1.868)	(0,06)
SSB	1.734	0,22	RDR	(3.346)	(0,11)
<b>Total Return Bond Fund</b>			<b>Summe</b>	<b>(34.023)</b>	<b>(1,13)</b>
Total Return Swaps			<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>		
FBF	\$ (64)	0,00	Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			SSB	\$ 87	0,05
SSB	3.393	0,05	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BOS	(2.084)	(1,31)
BOS	(173.987)	(2,72)	SCX	(8.431)	(5,27)
CIB	(267.629)	(4,19)	<b>Summe</b>	<b>(10.515)</b>	<b>(6,58)</b>
GRE	(50.730)	(0,79)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
IND	(488.777)	(7,65)	TDM	(6.523)	(4,08)
JPS	(54.546)	(0,85)	<b>US Short-Term Fund</b>		
<b>Summe</b>	<b>(1.035.669)</b>	<b>(16,20)</b>	Pensionsgeschäfte		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			SSB	\$ 520	0,04
BCY	(29.482)	(0,46)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
TDM	(768)	(0,01)	BCY	(196)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(30.250)</b>	<b>(0,47)</b>			

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

### (b) Sicherheiten

#### i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Die zum 30. Juni 2018 und zum 31. Dezember 2017 erhaltenen Sicherheiten wurden im Depotbanknetz der State Street Bank and Trust als Beauftragte der Verwahrstelle gehalten.

#### ii) Konzentrationsdaten:

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2018 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
PIMCO Capital Securities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 1.464.851
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	20.906
PIMCO Credit Absolute Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	6.294
Diversified Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	144.719
Diversified Income Duration Hedged Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	64.982
Dynamic Multi-Asset Fund	Regierung Belgiens	€ 30.859
	Caisse d'Amortissement De La Dette Sociale	121.027
	Bank Nederlandse Gemeenten	92.630
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.964
Emerging Asia Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 164
Emerging Local Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	99.958
Emerging Markets 2018 Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	5.116
Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	595
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	130
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	11.914
Euro Bond Fund	Regierung Belgiens	€ 18.757
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	339
Euro Credit Fund	Regierung Belgiens	8.068
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	196
Euro Income Bond Fund	Regierung Belgiens	12.303
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.202
Euro Long Average Duration Fund	Regierung Belgiens	3.227
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	213
Euro Low Duration Fund	Regierung Belgiens	8.370
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	635
Euro Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	209
Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.118
Global Advantage Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	605
Global Bond ESG Fund	Ginnie Mae	8.900
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	60.003
Global Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	9.998
Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.536
Global High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.862
Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	8.773
Global Libor Plus Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	110.880
Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.483
Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.048
Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	47.082
Inflation Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	137
Low Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.348
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	561
Low Duration Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	31.337
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.637

Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
Mortgage Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 38.191
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	443
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.358
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	22.780
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	579
StocksPLUS™ Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	308.784
Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	5
Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	5.566
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	24.588
UK Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	£ 681
UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	804
Unconstrained Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 7.269
US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	168.349
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	443
US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	310

ISDA-Vereinbarungen decken eine Kombination von Swap-Kontrakten ab, und der Gesamtbetrag der Sicherheiten für diese Vereinbarungen ist in den obigen Angaben enthalten.

Ein Teil der angegebenen Sicherheiten bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2017 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Zum 31. Dez. 2017		
Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
PIMCO Capital Securities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 853.387
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	21.315
PIMCO Credit Absolute Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	555
Diversified Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	52.820
Diversified Income Duration Hedged Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.778
Dynamic Multi-Asset Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	€ 3.293
Emerging Asia Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 176
Emerging Markets 2018 Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	561
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	960
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	5.902
Euro Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	€ 2.968
Euro Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	476
Euro Income Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	893
Euro Long Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	79
Euro Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	160
Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 2.832
Global Advantage Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	779
Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.250
Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.684
Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	203.214
Global Libor Plus Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	73.066
Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.148
Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.381
Inflation Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	742

Zum 31. Dez. 2017			Zum 31. Dez. 2017		
Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)	Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
Low Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 20.662	StocksPLUS™ Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 132.585
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	5.448	Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.769
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.975	Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.463
Mortgage Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	596	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	12.701
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	9.424	UK Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	£ 971
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	6.781	UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.526
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	165	Unconstrained Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 2.606
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	416	US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	440.831
			US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	90
			US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	531

ISDA-Rahmenverträge decken eine Kombination von Swap-Kontrakten ab, und die Gesamtbeträge der Sicherheiten für diese Vereinbarungen sind in den obigen Angaben enthalten.

Ein Teil der angegebenen Sicherheiten bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

### iii) Aggregierte Transaktionsdaten:

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, sehen zum 30. Juni 2018 wie folgt aus:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Capital Securities Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 280	k. A.	k. A.	USD	Deutschland	FED, Bilateral
		Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	68.350	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	30.010	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	142.799	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		US Treasury Bonds	Treasury	479.966	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	436.793	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		US Treasury Bonds	Treasury	188.447	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Commodity Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	8.072	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		US Treasury Bonds	Treasury	12.684	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Deutschland	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	150	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Credit Absolute Return Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	6.294	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	60	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	106.312	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Diversified Income Duration Hedged Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	38.407	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	54.275	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		US Treasury Bonds	Treasury	10.707	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	60	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	106.312	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Pensionsgeschäfte	Kingdom of Belgium Government International Bond	Treasury	30.859	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Bank Nederlandse Gemeenten	Unternehmensanleihen	92.630	Aaa	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Caisse d'Amortissement De La Dette Sociale	Regionalregierung	121.027	Aa2	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	2.964	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Asia Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	164	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Local Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	99.958	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets 2018 Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	5.116	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	595	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	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
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	\$ 130	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	11.247	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	667	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	€ 837	k. A.	k. A.	EUR	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Kingdom of Belgium Government International Bond	Treasury	18.757	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	339	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Kingdom of Belgium Government International Bond	Treasury	8.068	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	196	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Kingdom of Belgium Government International Bond	Treasury	12.303	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	2.202	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Kingdom of Belgium Government International Bond	Treasury	3.227	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Low Duration Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	213	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Kingdom of Belgium Government International Bond	Treasury	8.370	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	635	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	209	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	1.118	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Advantage Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	605	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	Mortgage Pass Thru		8.900	BBB	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Ginnie Mae		60.003	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	2.536	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	9.998	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	9.998	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	20	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	20	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	3.862	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	8.773	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Libor Plus Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	40.910	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		US Treasury Bonds	Treasury	68.533	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	1.437	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Bonds	Treasury	1.483	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.330	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	1.048	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	62.790	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Income Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	8.147	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	38.935	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Inflation Strategy Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	520	k. A.	k. A.	USD	Deutschland	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	137	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	3.348	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	561	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Income Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	15.331	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	16.006	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	200	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	1.637	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Mortgage Opportunities Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	310	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	24.612	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	13.579	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	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
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	€ 443	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	6.550	k. A.	k. A.	USD	Deutschland	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	2.358	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	40	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	1.320	k. A.	k. A.	USD	Deutschland	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	940	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	21.840	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	579	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
StocksPLUS™ Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.790	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	11.180	k. A.	k. A.	USD	Deutschland	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	5.680	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	167.821	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	140.963	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	5	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	5.566	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	1.123	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	23.465	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	£ 681	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	804	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Unconstrained Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	\$ 6.517	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	752	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	84.294	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	84.055	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	443	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	310	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, sehen zum 31. Dezember 2017 wie folgt aus:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Capital Securities Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	\$ 71.128	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	347.506	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	9.843	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	424.910	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
Commodity Real Return Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	250	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.130	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	18.070	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	21.315	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Credit Absolute Return Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	555	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	52.820	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income Duration Hedged Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	5.015	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Deutschland	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	13.763	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	870	k. A.	k. A.	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	3.293	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Asia Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	176	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets 2018 Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	561	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	960	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	5.902	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	2.968	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	476	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	893	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	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
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	\$ 79	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	160	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	2.832	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Advantage Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	779	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	2.250	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	1.684	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	£ 9.670	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	203.214	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Libor Plus Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	\$ 14.497	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		US Treasury Bonds	Treasury	56.734	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	1.835	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	1.148	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.260	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	1.381	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Income Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	340	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Inflation Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	742	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	20.662	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	5.448	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	1.975	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	596	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.180	k. A.	k. A.	USD	Schweiz	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	710	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	9.424	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.250	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	4.070	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	6.781	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.300	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.030	k. A.	k. A.	USD	Deutschland	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	80	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	165	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	416	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
StocksPLUS™ Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	9.070	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	22.540	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	102.391	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	30.194	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	1.769	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	3.463	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	10.952	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Deutschland	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	1.749	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	£ 971	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	1.526	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Unconstrained Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	\$ 2.606	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US High Yield Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	60	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	US Treasury Bonds	Treasury	344.884	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	18.707	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		US Treasury Notes	Treasury	77.240	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	90	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	US Treasury Notes	Treasury	531	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Der Marktwert der Sicherheiten für Pensionsgeschäfte umfasst keine aufgelaufenen Zinsen.

Rahmenverträge für Termingeschäfte decken eine Kombination aus Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäften, Rückkauf-Finanzierungsgeschäften und sonstigen Finanzierungsgeschäften ab, die oben nicht enthalten sind. Der Gesamtbetrag der zum 30. Juni 2018 und zum 31. Dezember 2017 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.

**iv) Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten:**

Als Sicherheiten erhaltene Wertpapiere wurden zum 30. Juni 2018 und zum 31. Dezember 2017 nicht wiederverwendet.

Barsicherheiten gehen im Depotkonto der Fonds ein und werden somit nicht individuell verfolgt, um zu ermitteln, ob sie wiederverwendet werden. Somit kann nicht angemessen geprüft werden, in welchem Umfang Barsicherheiten wiederverwendet werden.

Die zum 30. Juni 2018 erhaltenen Sicherheiten wurden im Depotbanknetz der State Street Bank and Trust gehalten.

**v) Verwahrung gestellter Sicherheiten:**

Die von den Teilfonds zum 30. Juni 2018 und zum 31. Dezember 2017 verpfändeten Sicherheiten werden von den Kontrahenten in Konten gehalten, bei denen es sich nicht um getrennte oder Sammelkonten handelt.

**(c) Rendite/Kosten**

Die nachfolgenden Tabellen liefern detaillierte Angaben zu den Renditen und den Kosten jeder Art von SFT und Total Return Swap für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2018 und zum 30. Juni 2017. Die Beträge sind in der Basiswährung des Fonds ausgewiesen.

Fonds	30. Juni 2018							
	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 Capital Securities Fund	\$ 7.456	\$ 93	\$ 11	\$ 7.025	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Commodity Real Return Fund	32	-	4	469	-	-	-	60
PIMCO Credit Absolute Return Fund	17	-	-	250	-	-	-	68
Diversified Income Fund	1.340	225	49	23	-	-	-	-
Diversified Income Duration Hedged Fund	415	69	10	-	-	-	-	-
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 17	€ 329	€ -	€ -	€ -	€ -	€ -	€ -
Emerging Asia Bond Fund	\$ 1	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Emerging Local Bond Fund	353	-	-	1	-	-	-	-
Emerging Markets 2018 Fund	15	-	-	-	-	-	-	-
Emerging Markets Bond Fund	17	-	8	13	-	-	-	-
Emerging Markets Corporate Bond Fund	3	-	-	101	-	-	-	18
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	98	-	-	-	-	-	-	-
Euro Bond Fund	€ 6	€ 63	€ -	€ 1	€ -	€ -	€ -	€ -
Euro Credit Fund	3	16	-	-	-	-	-	-
Euro Income Bond Fund	5	77	-	-	-	-	-	-
Euro Long Average Duration Fund	1	16	4	-	-	-	-	-
Euro Low Duration Fund	2	31	34	-	-	-	1	-
Euro Short-Term Fund	-	39	73	-	-	-	-	-
Global Advantage Fund	\$ 6	\$ -	\$ 19	\$ 379	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 72
Global Advantage Real Return Fund	2	-	5	230	-	-	-	38
Global Bond ESG Fund	554	-	-	-	-	-	-	-
Global Bond Fund	71	63	301	695	-	-	-	10
Global Bond Ex-US Fund	5	-	35	281	-	-	-	28
Global High Yield Bond Fund	96	-	64	15	-	-	-	-
Global Investment Grade Credit Fund	740	-	41	10.876	-	-	203	456
Global Libor Plus Bond Fund	264	-	-	6	-	-	1	23
Global Low Duration Real Return Fund	11	-	-	222	-	-	-	3.410
Global Multi-Asset Fund	11	-	-	937	-	-	-	85
Global Real Return Fund	9	-	94	5.522	-	-	-	360
Income Fund	1.619	-	13	34.783	-	-	-	1.508
Inflation Strategy Fund	2	-	-	21	-	-	-	39
Low Average Duration Fund	444	-	-	249	-	-	-	23
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	6	-	-	292	-	-	-	289
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	16	-	-	-	-	-	-	-
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund	74	-	-	1	-	-	-	4
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund	42	-	-	529	-	-	-	254
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund	115	-	-	20	-	-	-	16
PIMCO RAE Fundamental US Fund	-	-	-	-	-	-	-	-
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund	4	-	1	-	-	-	-	-
StocksPLUS™ Fund	1.921	-	-	44	-	-	-	9
Strategic Income Fund	5	-	2	42	-	-	-	26
Total Return Bond Fund	83	-	-	8.675	-	-	6	467
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	193	-	13	-	-	-	-	-
UK Corporate Bond Fund	£ 10	£ -	£ -	£ 76	£ -	£ -	£ -	£ -
UK Long Term Corporate Bond Fund	5	-	-	259	-	-	-	-
Unconstrained Bond Fund	\$ 84	\$ -	\$ -	\$ 2.498	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 896
US High Yield Bond Fund	1.174	-	127	-	-	-	-	-
US Investment Grade Corporate Bond Fund	6	-	-	51	-	-	7	109
US Short-Term Fund	3	-	1	37	-	-	-	419

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

30. Juni 2017

Fonds	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Sale-Buyback-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Capital Securities Fund	\$ 802	\$ 969	\$ 187	\$ 35	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Commodity Real Return Fund	11	-	32	362	-	-	50	36
PIMCO Credit Absolute Return Fund	-	-	3	227	6	2	136	72
Diversified Income Fund	224	341	201	293	-	-	-	-
Diversified Income Duration Hedged Fund	43	93	14	-	-	-	-	-
Dynamic Multi-Asset Fund	€ -	€ 20	€ -	€ -	€ -	€ -	€ -	€ -
Emerging Asia Bond Fund	\$ -	\$ -	\$ 8	\$ 4	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Emerging Local Bond Fund	56	-	-	-	-	-	-	-
Emerging Markets 2018 Fund	1	-	5	-	-	-	-	-
Emerging Markets Bond Fund	-	-	98	25	-	-	-	-
Emerging Markets Corporate Bond Fund	-	-	15	83	-	-	39	17
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	27	-	-	-	-	-	-	-
Euro Bond Fund	€ -	€ 35	€ 24	€ -	€ -	€ -	€ -	€ -
Euro Credit Fund	-	19	-	-	-	-	-	-
Euro Income Bond Fund	-	21	32	11	-	-	-	-
Euro Long Average Duration Fund	-	12	8	-	-	-	-	-
Euro Low Duration Fund	-	-	4	-	-	-	-	-
Euro Short-Term Fund	1	19	-	-	-	-	-	-
Global Advantage Fund	\$ -	\$ -	\$ 10	\$ 171	\$ -	\$ -	\$ 37	\$ 31
Global Advantage Real Return Fund	-	-	34	137	1	3	79	50
Global Bond ESG Fund	8	-	-	-	-	-	-	-
Global Bond Fund	3	48	161	1.645	-	-	245	133
Global Bond Ex-US Fund	-	-	60	200	-	-	436	68
Global High Yield Bond Fund	916	-	335	88	-	-	-	-
Global Investment Grade Credit Fund	339	-	122	7.453	-	-	-	-
Global Libor Plus Bond Fund	21	-	-	-	-	-	-	-
Global Low Duration Real Return Fund	21	1	-	145	-	-	252	122
Global Multi-Asset Fund	-	-	2	285	-	-	-	-
Global Real Return Fund	-	-	-	-	-	-	492	224
Income Fund	1.043	1	104	6.941	-	-	-	-
Inflation Strategy Fund	-	-	-	8	-	-	-	-
Low Average Duration Fund	168	-	17	27	-	-	-	-
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	6	-	-	50	3	2	123	80
Mortgage Opportunities Fund	69	-	-	9	-	-	-	-
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund	121	-	-	-	-	-	-	-
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund	33	-	-	297	-	-	88	31
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund	14	-	-	-	-	-	17	13
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund	-	-	4	1	-	-	-	-
StocksPLUS™ Fund	1.018	-	-	-	-	-	-	-
Total Return Bond Fund	57	1	32	5.101	-	-	141	48
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	5	-	1	62	-	-	-	-
UK Corporate Bond Fund	£ -	£ -	£ 4	£ 34	£ -	£ -	£ -	£ -
UK Long Term Corporate Bond Fund	-	-	6	106	-	-	-	-
Unconstrained Bond Fund	\$ 434	\$ -	\$ 7	\$ 926	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
US High Yield Bond Fund	1.302	-	254	74	-	-	-	-
US Investment Grade Corporate Bond Fund	-	-	-	-	3	1	47	18
US Short-Term Fund	19	-	4	62	-	-	-	-

Alle Renditen aus SFT-Derivatgeschäften laufen zugunsten des Fonds auf und fallen nicht unter Ertragsteilungsvereinbarungen 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.

### 20. WESENTLICHE EREIGNISSE

John Bruton und Frances Ruane wurden mit Wirkung zum 28. Februar 2018 in den Verwaltungsrat bestellt.

Die Verwaltungsgesellschaft hat am 20. Februar 2018 Anteile des US Short-Term Fund, eines Teilfonds der Gesellschaft, im Wert von USD 5.000.000 gezeichnet.

Die Verwaltungsgesellschaft hat am 20. April 2018 Anteile des US Short-Term Fund, eines Teilfonds der Gesellschaft, im Wert von USD 2.000.000 zurückgegeben.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Berichtszeitraums keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

### 21. EREIGNISSE NACH ABSCHLUSS DES BERICHTSZEITRAUMS

Michael J. Meagher trat mit Wirkung zum 24. Juli 2018 aus dem Verwaltungsrat zurück.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren nach Abschluss des Berichtszeitraums keine Ereignisse zu verzeichnen.

### 22. GENEHMIGUNG VON FINANZABSCHLÜSSEN

Dieser Abschluss wurde am 23. August 2018 vom Verwaltungsrat genehmigt.

## Glossar: (möglicherweise im vorstehenden Abschluss verwendete Abkürzungen)

### Abkürzungen der Kontrahenten:

AZD	Australia and New Zealand Banking Group	GLM	Goldman Sachs Bank USA	RBC	Royal Bank of Canada
BCY	Barclays Capital, Inc.	GRE	RBS Securities, Inc.	RBS	RBS Securities, Inc.
BNP	BNP Capital Markets Ltd.	GSC	Goldman Sachs & Co.	RCY	Royal Bank of Canada
BOA	Bank of America N.A.	GST	Goldman Sachs International	RDR	RBC Capital Markets
BOM	Bank of Montreal	HUS	HSBC Bank USA N.A.	RYL	Royal Bank of Scotland Group PLC
BOS	Banc of America Securities LLC	IND	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	SAL	Citigroup Global Markets, Inc.
BPG	BNP Paribas Securities Corp.	JPM	JP Morgan Chase Bank N.A.	SCX	Standard Chartered Bank
BPS	BNP Paribas S.A.	JPS	JP Morgan Securities, Inc.	SGY	Societe Generale, New York
BRC	Barclays Bank PLC	MAC	Macquarie Bank Limited	SOG	Societe Generale
BSN	Bank of Nova Scotia	MBC	HSBC Bank Plc	SSB	State Street Bank and Trust Co.
CBK	Citibank N.A.	MEI	Merrill Lynch International	TDM	TD Securities (USA) LLC
CFR	Credit Suisse Securities (Europe) Ltd.	MTK	Millenium BCP	TOR	Toronto Dominion Bank
CIB	Canadian Imperial Bank of Commerce	MSB	Morgan Stanley Bank, N.A.	UAG	UBS AG Stamford
CKL	Citibank N.A. London	MSC	Morgan Stanley & Co., Inc.	UBS	UBS Securities LLC
DBL	Deutsche Bank AG London	MYC	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	WST	Westpac Banking Corp.
DEU	Deutsche Bank Securities, Inc.	MYI	Morgan Stanley & Co. International PLC		
DUB	Deutsche Bank AG	NAB	National Australia Bank Ltd.		
FAR	Wells Fargo Bank National Association	NGF	Nomura Global Financial Products, Inc.		
FBF	Credit Suisse International	NOM	Nomura Securities International Inc.		
FCT	Credit Suisse Capital LLC	NXN	Natixis New York		

### Währungskürzel:

AED	Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	GBP (oder £)	Britisches Pfund	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	RUB	Russischer Rubel
CAD	Kanadischer Dollar	ILS	Israelischer Shekel	SEK	Schwedische Krone
CHF	Schweizer Franken	INR	Indische Rupie	SGD	Singapur-Dollar
CLP	Chilenischer Peso	JPY (oder ¥)	Japanischer Yen	THB	Thailändischer Baht
CNH	Chinese Renminbi (Offshore)	KRW	Südkoreanischer Won	TRY	Türkische neue Lira
CNY	Chinese Renminbi (Mainland)	KZT	Kasachischer Tenge	TWD	Taiwanesischer Dollar
COP	Kolumbianischer Peso	MXN	Mexikanischer Peso	UAH	Ukrainische Hrywnia
CZK	Tschechische Krone	MYR	Malaysischer Ringgit	USD (oder \$)	US-Dollar
DKK	Dänische Krone	NGN	Nigerianische Naira	UYU	Uruguayischer Peso
DOP	Dominikanischer Peso	NOK	Norwegische Krone	VND	Vietnamesischer Dong
EGP	Ägyptisches Pfund	NZD	Neuseeländischer Dollar	ZAR	Südafrikanischer Rand
EUR (oder €)	Euro	PEN	Peruanischer neuer Sol		

### Börsenkürzel:

CBOE	Chicago Board Options Exchange	EUREX	Eurex Exchange	MSE	Montreal Stock Exchange
CBOT	Chicago Board of Trade	FTSE	Financial Times Stock Exchange	OTC	Over the Counter
CME	Chicago Mercantile Exchange	ICE	IntercontinentalExchange®		

### Index-Kürzel:

ABX.HE	Asset-Backed Securities Index - Home Equity	CPURNSA	Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index	JMABDEWU	J.P. Morgan JMABDEWU Commodity Index
ACS	Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures Index	DAX	Deutscher Aktien Index 30	MCDX	Municipal Bond Credit Derivative Index
AMZX	Alerian MLP Total Return Index	DWRTFT	Dow Jones Wilshire REIT Total Return Index	MTGEFNCL	FNMA 30-Year Coupon Index
BCOMF1T	Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return	EAFE	Europe, Australasia, and Far East Stock Index	PrimeX.ARM	Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage
BCOMTR	Bloomberg Commodity Index Total Return	ERAEMLT	eRAFI Emerging Markets Strategy Index	S&P 500	Standard & Poor's 500 Index
CAC	Cotation Assistée en Continu	ERAGDEV	Dow Jones Enhanced RAFI Global Developed Total Return Index	SPSIOPTR	S&P Oil & Gas Exploration & Production Select Industry Index
CDX.EM	Credit Derivatives Index - Emerging Markets	ERAUSLT	eRAFI U.S. Large Strategy Index	STOXX	Euro Stoxx 50 Index
CDX.HY	Credit Derivatives Index - High Yield	FRCPXTOB	France Consumer Price ex-Tobacco Index	TOPIX	Tokyo Price Index
CDX.IG	Credit Derivatives Index - Investment Grade	FTSE/MIB	Index der 40 italienischen Aktien mit der höchsten Liquidität/Marktkapitalisierung der Borsa Italiana	TRNGLU	FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD
CMBX	Commercial Mortgage-Backed Index	IBR	Indicador Bancario de Referencia	UKRPI	United Kingdom Retail Prices Index
CPALEMU	Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index	IOS.FN.350.13	2013 Fannie Mae 3.5 % Interest Only Synthetic Total Return Swap Index	USSW10	10 Year USSW Rate
CPI	Consumer Price Index	IOS.FN.600.08	2008 Fannie Mae 6.0 % Interest Only Synthetic Total Return Swap Index	VSTOXX	Euro Stoxx 50 Volatility Index
CPTFEMU	Eurozone HICP ex-Tobacco Index	ISDA	International Swaps and Derivatives Association, Inc.	WIG	Warsaw Stock Exchange Index

### Kommunalanleihen- oder Behördenkürzel:

AGM	Assured Guaranty Municipal	AMBAC	American Municipal Bond Assurance Corp.	GDR	Global Depositary Receipt
-----	----------------------------	-------	---	-----	---------------------------

## Glossar: (möglicherweise im vorstehenden Abschluss verwendete Abkürzungen) (Forts.)

### Sonstige Kürzel:

<b>ABS</b>	Asset-Backed Security (forderungsbesichertes Wertpapier)	<b>EURIBOR</b>	Euro Interbank Offered Rate	<b>REIT</b>	Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds)
<b>ADR</b>	American Depositary Receipt	<b>JIBAR</b>	Johannesburg Interbank Agreed Rate	<b>REMIC</b>	Real Estate Mortgage Investment Conduit
<b>AID</b>	Agency International Development	<b>JSC</b>	Joint Stock Company	<b>RMBS</b>	Residential Mortgage-Backed Security
<b>ALT</b>	Alternate Loan Trust	<b>JSE</b>	Johannesburg Stock Exchange	<b>SP - ADR</b>	Sponsored American Depositary Receipt
<b>BABs</b>	Build America Bonds	<b>KLIBOR</b>	Kuala Lumpur Interbank Offered Rate	<b>SP - GDR</b>	Sponsored Global Depositary Receipt
<b>BBR</b>	Bank Bill Rate	<b>KORIBOR</b>	Korea Interbank Offered Rate	<b>TBA</b>	To-Be-Announced
<b>BBSW</b>	Bank Bill Swap Reference Rate	<b>LIBOR</b>	London Interbank Offered Rate	<b>TBD</b>	To-Be-Determined
<b>BIST</b>	Borsa Istanbul	<b>LUNAR</b>	Monatliche Zahlung auf der Basis von Zeiträumen von jeweils 28 Tagen Ein Jahr besteht aus 13 Zeiträumen	<b>TBD%</b>	Bei Abrechnung eines Darlehens zu ermittelnder Zinssatz
<b>BTP</b>	Buoni del Tesoro Poliennali	<b>MBS</b>	Mortgage-Backed Security (hypothekenbesichertes Wertpapier)	<b>TELBOR</b>	Tel Aviv Interbank Offered Rate
<b>CBO</b>	Collateralised Bond Obligation	<b>MSCI</b>	Morgan Stanley Capital International	<b>THBFIX</b>	Thai Baht Floating-Rate Fix
<b>CDI</b>	Brazil Interbank Deposit Rate	<b>NCUA</b>	National Credit Union Administration	<b>TIIE</b>	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio „Gleichgewichtszinssatz im Interbankengeschäft“
<b>CDO</b>	Collateralised Debt Obligation (besicherte Schuldverschreibungen)	<b>NVDR</b>	Non-Voting Depositary Receipt (stimmrechtsloser Depositary Receipt)	<b>USSW</b>	USD Swap Spread (halbjährlicher Festzins vs. 3-Month LIBOR)
<b>CHILIBOR</b>	Chile Interbank Offered Rate	<b>OAT</b>	Obligations Assimilables du Trésor	<b>WIBOR</b>	Warsaw Interbank Offered Rate
<b>CLO</b>	Collateralised Loan Obligation (durch Kreditportfolio besicherte Wertpapiere)	<b>OIS</b>	Overnight Index Swap	<b>YOY</b>	Year-Over-Year (im Vorjahresvergleich)
<b>D&amp;I</b>	Down-and-In-Barriere-Option	<b>PIK</b>	Payment-in-Kind (Sachausschüttung)		
<b>DAC</b>	Designated Activity Company	<b>PRIBOR</b>	Prague Interbank Offered Rate		

## Allgemeine Informationen

---

### VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

PIMCO Global Advisors (Ireland) Ltd.,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin, D02 HD32,  
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,  
England.

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapur 018960.

PIMCO Deutschland GmbH,  
Seidlstraße 24-24a,  
80335 München  
Deutschland.

### ADMINISTRATOR

State Street Fund Services (Ireland) Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin D02 HD32,  
Irland.

### VERWAHRSTELLE

State Street Custodial Services (Ireland)  
Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin D02 HD32,  
Irland.

### VERTRIEBSSTELLEN

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
England.

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapur 018960.

PIMCO Asia Limited,  
22nd Floor, Unit 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,  
AMG/9991,  
Am Hof 2,  
1010 Wien,  
Österreich.

### REPRÄSENTANT IN SINGAPUR

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapur 018960.

### ITALIENISCHE KORRESPONDENZBANKEN

State Street Bank SpA,  
Via Ferrante Aporti, 10,  
20125 Mailand,  
Italien.

Allianz Bank Financial Advisors S.p.A.  
Piazzale Lodi, 3  
20137 Mailand,  
Italien.

BNP Paribas Securities Services,  
Piazza Lina Bo Bardi 3,  
20124 Mailand,  
Italien.

Société Générale Securities Services S.p.A.  
(„SGSS“)  
Via Benigno Crespi, 19/A - MAC 2,  
20159 Mailand,  
Italien.

Allfunds Bank S.A.,  
Via Santa Margherita 7,  
20121 Mailand,  
Italien.

Banca Sella Holding S.p.A.,  
Piazza Gaudenzio Sella, 1,  
13900 Biella,  
Italien.

Banca Monte dei Paschi di Siena,  
Piazza Salimbeni 3,  
53100 Siena,  
Italien.

### REPRÄSENTANT IN HONGKONG

PIMCO Asia Limited,  
22nd Floor, Unit 2201,  
Two International Finance Centre,  
8 Finance Street, Central,  
Hongkong.

### LUXEMBURGER ZAHLSTELLE UND VERTRETUNGSSTELLE

BNP Paribas Securities Services,  
23, avenue de la Porte-Neuve,  
L-2085, Luxemburg.

### SCHWEIZER ZAHLSTELLE UND VERTRETUNGSSTELLE

BNP Paribas Securities Services,  
Paris, succursale de Zurich,  
Selnaustrasse 16,  
8002 Zürich,  
Schweiz.

### BRITISCHER REPRÄSENTANT

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
England.

### BELGISCHE ZAHLSTELLE

Société Générale Private Banking NV,  
Kortrijksesteenweg 302,  
B-9000 Gent,  
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 Ergasias S.A.,  
22, Voukourestriou & 3, Valaoritou str.  
GR 10671 Athen,  
Griechenland.

### FRANZÖSISCHE ZENTRALISIERUNGS- UND FINANZSTELLE

Société Générale Securities Services,  
3, Rue d'Antin,  
75002 Paris,  
Frankreich.

### ZAHLSTELLE IN LIECHTENSTEIN

LGT Bank Ltd.,  
Herrengasse 12,  
FL-9490 Vaduz,  
Liechtenstein.

### RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT

Dillon Eustace,  
33 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin D02 XK09,  
Irland.

## Allgemeine Informationen (Forts.)

---

### 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 D01 X9R7,  
Irland.

### SEKRETÄR

State Street Fund Services (Ireland) Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin D02 HD32,  
Irland.

### BETREUENDER MAKLER

Dillon Eustace,  
33 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin D02 XK09,  
Irland.

### EINGETRAGENER GESCHÄFTSSITZ

PIMCO Funds: Global Investors  
Series plc,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin, D02 HD32,  
Irland.

### VERWALTUNGSRAT DER GESELLSCHAFT UND VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

V. Mangala Ananthanarayanan<sup>1</sup>  
Ryan P. Blute<sup>1</sup>  
John Bruton (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied)  
(am 28. Februar 2018 bestellt)  
Craig A. Dawson<sup>1</sup>  
David M. Kennedy (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied)  
Michael J. Meagher (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied)  
(am 24. Juli 2018 zurückgetreten)  
Frances Ruane (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied)  
(am 28. Februar 2018 bestellt)

Der Prospekt, Prospektergänzungen, die Gründungsurkunde und Satzung, die wesentlichen Anlegerinformationen sowie Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos vom Repräsentanten oder Agenten eines jeden Rechtsraums bezogen werden.

Eine Kopie der Liste der Portfolioveränderungen in dem am 30. Juni 2018 abgelaufenen Geschäftsjahr kann von den Anlegern 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.