



**ALLIANCEBERNSTEIN®**

HALBJAHRESBERICHT

# AB FCP I

Bestimmte Portefeuilles des Fonds sind nicht zum Angebot an nicht qualifizierte Anleger in der Schweiz zugelassen. Dementsprechend wurden alle Bezugnahmen auf diese Portefeuilles aus diesem verkürzten Halbjahresbericht entfernt. Die Anleger werden auf die Tatsache hingewiesen, dass bestimmte Zahlen in diesem verkürzten Halbjahresbericht auf konsolidierter Basis dargestellt sind und daher die Zahlen der Portefeuilles umfassen, die für das Angebot an nicht qualifizierte Anleger in der Schweiz nicht registriert sind.

## **Multi-Asset/Asset Allocation**

+ DYNAMIC DIVERSIFIED PORTFOLIO

## **Equity**

+ GLOBAL EQUITY BLEND PORTFOLIO

+ GLOBAL VALUE PORTFOLIO

+ EMERGING MARKETS GROWTH PORTFOLIO

+ SUSTAINABLE US THEMATIC PORTFOLIO

+ ASIA EX-JAPAN EQUITY PORTFOLIO

+ JAPAN STRATEGIC VALUE PORTFOLIO

+ CHINA LOW VOLATILITY EQUITY PORTFOLIO

## **Fixed Income**

+ SHORT DURATION BOND PORTFOLIO

+ GLOBAL HIGH YIELD PORTFOLIO

+ AMERICAN INCOME PORTFOLIO

+ EUROPEAN INCOME PORTFOLIO

+ EMERGING MARKETS DEBT PORTFOLIO

+ MORTGAGE INCOME PORTFOLIO

AB FCP I ist ein offener Investmentfonds (*fonds commun de placement*), der gemäß den Gesetzen des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde und außerhalb von Österreich, Deutschland und der Schweiz unter dem Namen AllianceBernstein geschäftstätig ist.

Auf Grundlage der Berichte können keine Zeichnungsaufträge eingereicht werden. Zeichnungen sind nur wirksam, wenn sie auf Grundlage des Dokuments mit wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) und des aktuellen Verkaufsprospekts in Verbindung mit dem Jahresbericht oder dem jüngsten Halbjahresbericht, falls dieser später herausgegeben wurde, erfolgen.

Das [A/B] Logo ist eine Dienstleistungsmarke von AllianceBernstein, und AllianceBernstein® ist ein eingetragenes Warenzeichen, das mit Erlaubnis des Inhabers, AllianceBernstein L.P., verwendet wird.

---

	<b>Seite</b>
Brief an die Anteilhaber . . . . .	1
Wertentwicklung der Anteile . . . . .	2
Verzeichnis der Anlagewerte . . . . .	12
Zusammensetzung des Fondsvermögens . . . . .	144
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens . . . . .	148
Umlaufende Anteile . . . . .	152
Statistische Informationen . . . . .	159
Anmerkungen zum Halbjahresabschluss . . . . .	175
Tabelle 1 – Gebührenstruktur . . . . .	196
Tabelle 2 – Portefeuilleumsatz . . . . .	207
Informationen für die Anteilhaber (ungeprüft) . . . . .	208

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

22. März 2021

Sehr geehrte Anteilinhaber,

der vorliegende Bericht bietet Ihnen eine aktuelle Übersicht über AB FCP I (der „Fonds“) für den Halbjahresberichtszeitraum zum 28. Februar 2021.

Unterstützt durch umfangreiche geld- und finanzpolitische Maßnahmen erholten sich die US-Aktien, internationalen Aktien und Schwellenlandaktien weiter von den durch die COVID-19-Pandemie verursachten Tiefständen und verzeichneten im Sechsmonatszeitraum zum 28. Februar 2021 positive Renditen. Die Aktienmärkte brachen zu Beginn des Berichtszeitraums ein, da Volatilität und Stilrotation, einschließlich eines breitangelegten Ausverkaufs von Mega-Cap-Technologieaktien, vorherrschten. Positive Nachrichten über die Wirksamkeit potenzieller Impfstoffe gegen das Coronavirus trugen dazu bei, die Marktvolatilität auszugleichen, die durch die weitere Ausbreitung des Virus in vielen Ländern, ein potenziell umstrittenes Ergebnis bei der US-Präsidentenwahl und das Ausbleiben zusätzlicher finanzpolitischer Impulse in den USA ausgelöst wurde. Im weiteren Verlauf des Berichtszeitraums wurden die globalen Aktienmärkte durch einen deutlichen Rückgang der Neuankünfte, die Beschleunigung der Impfstoffverteilung und positive Anzeichen für die Verabschiedung eines Hilfspakets in Höhe von 1,9 Billionen US-Dollar gestützt – trotz des Auftretens scheinbar ansteckenderer Virusvarianten.

Gegen Ende des Berichtszeitraums führte das Aufkommen von Inflationsbefürchtungen, insbesondere in den USA, zu einem starken Anstieg der Renditen langfristiger Staatsanleihen und einer damit einhergehenden Korrektur bei Aktien. Steigende längerfristige Zinsen drückten die Bewertungen vieler marktführender Technologie- und Wachstumswerte nach unten, insbesondere in den USA, und förderten eine Rotation in zyklische und wertorientierte Titel. Im Halbjahreszeitraum schnitten Small-Cap-Aktien auf relativer Basis deutlich besser ab als Large-Cap-Aktien, und in Zeiten der Marktrotation übertrafen Large-Cap- und Small-Cap-Substanzwerte die Large-Cap- und Small-Cap-Wachstumswerte.

Die Renditen an den verschiedenen Rentenmärkten weltweit waren uneinheitlich, mit einem hohen Maß an Volatilität und Streuung zwischen den Anleihesektoren während des Sechsmonatszeitraums. Die Staatsanleihen der Industrieländer lagen im negativen Bereich, und US-Staatsanleihen entwickelten sich schlechter als andere wichtige Märkte, da die längerfristigen US-Zinsen von einem Tiefstand im September 2020 wieder zulegten. Risikoanlagen begannen im November deutlich zu steigen, als positive Nachrichten in Bezug auf die Impfungen die Rally der Anleihen befeuerten. Hochverzinsliche Unternehmensanleihen aus Schwellen- und Industrieländern führten die Gewinne mit deutlich positiven Renditen an, da die Anleger in einer Zeit historisch niedriger Zinsen nach höheren Renditen suchten. Schwellenlandanleihen in Lokalwährung erzielten ebenfalls ein starkes positives Ergebnis. Weltweit erzielten Investment-Grade-Unternehmensanleihen aus Industrieländern positive Ergebnisse und übertrafen Staatsanleihen weltweit, wobei die Renditen in den USA leicht negativ waren. Auch verbrieft Vermögenwerte schnitten besser ab als Staatsanleihen und erzielten geringfügig negative Ergebnisse.

Der US-Dollar fiel gegenüber den meisten Währungen der Industrieländer und entwickelte sich gegenüber den Währungen der Schwellenländer unterschiedlich. Die Rohölpreise der Sorte Brent erholten sich aufgrund der besseren Konjunkturaussichten und der Produktionskürzungen durch die OPEC+ um 46%. Durch die gestiegene Nachfrage nach Infrastruktur und Initiativen für grüne Energie legte Kupfer fast 35% zu. Nach einem erheblichen Anstieg zu Beginn des Jahres fiel der Goldpreis um mehr als 12% aufgrund der besseren Wirtschaftslage 2020 und als unverzinsliche Anlage in einem Umfeld steigender Zinsen.

Wir danken Ihnen für Ihre Anlage in den Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l., die Verwaltungsgesellschaft des Fonds (die „Verwaltungsgesellschaft“)

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b><u>Dynamic Diversified Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	8.00%	13.75%	4.68%	46.67%
A EUR H .....	7.26%	11.27%	1.86%	29.00%
AX .....	8.03%	13.78%	4.74%	76.73%
BX .....	7.43%	12.64%	3.76%	50.27%
C .....	7.84%	13.42%	4.40%	43.13%
C EUR H .....	7.08%	10.91%	1.61%	26.00%
CX .....	7.82%	13.46%	4.48%	69.13%
I .....	8.34%	14.55%	5.47%	55.93%
I EUR H .....	7.64%	12.09%	2.63%	37.20%
IX .....	8.35%	14.55%	5.51%	96.33%
S1 EUR H .....	7.86%	12.50%	3.02%	44.60%
<b><u>Global Equity Blend Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	16.99%	33.45%	16.25%	156.10%
A EUR H .....	16.12%	29.81%	12.55%	54.13%
B .....	16.41%	32.15%	15.15%	115.00%
C .....	16.74%	32.89%	15.70%	99.50%
I .....	17.45%	34.52%	17.19%	195.40%
S .....	18.07%	36.02%	18.60%	135.98%
S1 .....	17.67%	35.09%	17.78%	183.20%
<b><u>Global Value Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	17.44%	21.34%	3.32%	93.90%
A SGD H .....	17.14%	19.57%	1.76%	30.73%
AD .....	17.55%	21.36%	3.32%	34.36%
AD AUD H .....	16.31%	15.28%	-1.93%	30.49%
AD CAD H .....	16.84%	17.72%	0.38%	26.42%
AD EUR H .....	16.60%	18.34%	0.34%	20.36%
AD GBP H .....	16.70%	17.60%	-0.16%	22.61%
AD SGD H .....	17.18%	19.55%	1.68%	30.61%
AD ZAR H .....	19.55%	22.65%	4.15%	80.08%
B .....	16.88%	20.14%	2.33%	59.30%
BD .....	16.87%	20.12%	2.31%	26.95%
BD AUD H .....	15.79%	14.28%	-2.81%	21.72%
BD EUR H .....	16.04%	17.17%	-0.80%	11.89%
BD ZAR H .....	18.97%	21.37%	3.03%	67.84%
C .....	17.27%	20.82%	2.82%	84.47%
I .....	17.93%	22.28%	4.14%	125.60%
S .....	18.49%	23.44%	5.17%	74.39%
S GBP H .....	17.72%	19.70%	1.62%	37.73%
S1 .....	18.08%	22.66%	4.42%	91.36%
SD .....	18.49%	23.45%	5.14%	53.62%
<b><u>Emerging Markets Growth Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	23.48%	41.22%	18.66%	490.60%
A AUD H .....	22.42%	35.18%	13.43%	73.67%
A PLN H .....	22.37%	37.54%	15.88%	32.60%
A SGD H .....	23.11%	39.43%	17.06%	34.60%
AD .....	23.43%	41.20%	18.64%	64.66%
B .....	22.85%	39.81%	17.47%	347.80%
C .....	23.21%	40.60%	18.11%	211.52%
C AUD H .....	22.16%	34.59%	12.90%	63.93%
ED .....	22.85%	39.75%	17.47%	17.76%
I .....	23.96%	42.36%	19.60%	302.19%
I AUD H .....	22.92%	36.23%	14.33%	87.00%
N .....	23.21%	40.64%	18.13%	94.27%
S .....	24.63%	43.94%	20.97%	161.61%
S1 .....	24.07%	42.62%	19.85%	263.54%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Sustainable US Thematic Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	13.44%	44.98%	30.14%	278.10%
A AUD H .....	12.85%	39.34%	24.63%	338.54%
A CAD H .....	13.08%	42.35%	27.84%	304.67%
A EUR H .....	12.63%	42.14%	27.03%	295.54%
A GBP H .....	13.13%	41.72%	26.49%	230.20%
A SGD H .....	13.20%	43.40%	28.63%	226.47%
AN .....	13.41%	44.96%	30.14%	385.80%
B .....	12.88%	43.54%	28.83%	211.20%
C .....	13.16%	44.34%	29.58%	259.40%
C EUR H .....	12.38%	41.46%	26.44%	280.07%
I .....	13.88%	46.09%	31.17%	344.70%
I EUR H .....	13.06%	43.15%	27.99%	327.74%
I GBP .....	9.28%	34.46%	–	37.33%
IN .....	13.86%	46.11%	31.17%	429.00%
S .....	14.33%	47.32%	32.31%	302.00%
S1 .....	13.98%	46.36%	31.45%	330.48%
S1 JPY H .....	13.51%	45.18%	29.63%	337.00%
<b>Asia Ex-Japan Equity Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	30.08%	31.46%	7.91%	81.07%
A AUD H .....	28.85%	26.64%	3.71%	82.53%
A SGD H .....	29.67%	29.75%	6.41%	80.53%
AD .....	30.10%	31.39%	7.83%	81.12%
AD AUD H .....	28.88%	26.62%	3.75%	82.93%
AD CAD H .....	29.42%	28.59%	5.61%	30.12%
AD EUR H .....	29.05%	28.42%	4.86%	33.30%
AD GBP H .....	29.22%	28.35%	4.96%	46.74%
AD NZD H .....	29.43%	28.22%	4.79%	72.02%
AD RMB H .....	30.70%	32.65%	8.45%	73.71%
AD SGD H .....	29.68%	29.81%	6.46%	40.57%
AD ZAR H .....	32.24%	35.22%	10.75%	131.88%
AY JPY .....	30.93%	29.94%	7.58%	108.59%
BD .....	29.41%	30.13%	6.82%	61.80%
BD AUD H .....	28.23%	25.36%	2.67%	65.28%
BD CAD H .....	28.78%	27.21%	4.51%	22.83%
BD GBP H .....	28.66%	27.35%	4.20%	35.05%
BD NZD H .....	28.84%	26.98%	3.64%	58.04%
BD ZAR H .....	31.64%	33.95%	9.68%	83.32%
BY JPY .....	30.63%	29.33%	7.07%	99.68%
C .....	29.75%	30.87%	7.51%	72.13%
C AUD H .....	28.63%	26.13%	3.25%	77.33%
ED .....	29.44%	30.14%	6.74%	9.58%
I .....	30.62%	32.55%	8.74%	98.20%
I AUD H .....	29.36%	27.68%	4.58%	102.67%
I GBP .....	25.37%	21.99%	-0.98%	59.80%
ID .....	30.59%	32.54%	8.77%	98.36%
ID AUD H .....	29.36%	27.61%	4.58%	102.58%
S .....	31.30%	33.97%	9.97%	124.00%
S1 .....	30.76%	32.82%	8.98%	102.07%
SD .....	31.32%	33.98%	9.97%	81.94%
<b>Japan Strategic Value Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	16.34%	18.13%	1.09%	11.01%
A AUD H .....	15.81%	15.38%	-1.00%	44.53%
A CZK H .....	15.56%	16.10%	0.24%	-9.29%
A EUR H .....	15.72%	16.29%	-0.36%	72.73%
A NZD H .....	16.04%	16.67%	0.10%	57.73%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Japan Strategic Value Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
A SGD H . . . . .	16.39%	17.33%	0.81%	6.07%
A USD H . . . . .	16.52%	18.00%	1.70%	109.73%
AD . . . . .	16.33%	18.11%	1.09%	37.70%
AD AUD H . . . . .	15.77%	15.35%	-1.03%	40.59%
AD NZD H . . . . .	16.03%	16.65%	0.03%	48.45%
AD USD H . . . . .	16.53%	18.02%	1.72%	32.60%
AD ZAR H . . . . .	19.14%	22.22%	4.24%	98.26%
B . . . . .	15.76%	16.96%	0.08%	-3.33%
BD . . . . .	15.77%	16.97%	0.08%	28.41%
BD AUD H . . . . .	15.22%	14.24%	-1.98%	30.58%
BD USD H . . . . .	15.95%	16.81%	0.63%	23.32%
BD ZAR H . . . . .	18.65%	21.07%	3.18%	85.63%
C . . . . .	16.06%	17.59%	0.64%	4.48%
C EUR H . . . . .	15.51%	15.84%	-0.75%	62.87%
I . . . . .	16.81%	19.09%	1.95%	25.51%
I EUR H . . . . .	16.19%	17.30%	0.50%	88.07%
I USD H . . . . .	16.98%	18.91%	2.51%	125.93%
S EUR H . . . . .	16.91%	18.66%	1.62%	85.27%
S1 . . . . .	17.10%	19.68%	2.40%	31.82%
S1 USD H . . . . .	17.29%	19.54%	3.03%	62.33%
SD . . . . .	17.48%	20.45%	3.07%	62.34%

**China Low Volatility Equity Portfolio**

<b>Klasse</b>				
A . . . . .	11.82%	28.67%	26.70%	650.90%
A PLN H . . . . .	11.39%	26.93%	24.65%	25.95%
AD . . . . .	11.87%	28.64%	26.64%	97.60%
AD AUD H . . . . .	11.41%	25.52%	22.77%	88.93%
AD CAD H . . . . .	11.54%	26.87%	24.74%	83.30%
AD EUR H . . . . .	11.27%	26.61%	23.62%	73.36%
AD GBP H . . . . .	11.55%	26.67%	23.89%	79.95%
AD NZD H . . . . .	11.60%	26.24%	23.58%	97.02%
AD RMB H . . . . .	12.53%	29.71%	27.25%	117.67%
AD SGD H . . . . .	11.71%	27.60%	25.33%	86.20%
AD ZAR H . . . . .	14.11%	33.64%	31.05%	160.03%
B . . . . .	11.29%	27.38%	25.43%	494.50%
BD . . . . .	11.27%	27.42%	25.41%	84.26%
BD AUD H . . . . .	10.83%	24.18%	21.50%	75.68%
BD EUR H . . . . .	10.71%	25.32%	22.46%	61.26%
BD NZD H . . . . .	11.07%	25.54%	22.85%	84.39%
BD ZAR H . . . . .	13.44%	32.23%	29.79%	138.30%
C . . . . .	11.57%	28.09%	26.13%	72.50%
I . . . . .	12.28%	29.68%	27.71%	801.90%
S . . . . .	12.85%	31.19%	29.49%	285.74%
S1 . . . . .	12.43%	30.18%	28.38%	230.20%

**Short Duration Bond Portfolio**

<b>Klasse</b>				
A . . . . .	-0.14%	-0.01%	1.02%	119.06%
A2 . . . . .	-0.16%	0.00%	1.04%	76.51%
A2 EUR H . . . . .	-0.62%	-1.22%	-0.95%	-3.27%
A2 SGD H . . . . .	-0.19%	-0.19%	0.65%	3.67%
AA . . . . .	-0.15%	-0.03%	1.05%	3.65%
AA AUD H . . . . .	-0.34%	-0.48%	0.22%	7.88%
AA CAD H . . . . .	-0.22%	-0.32%	0.59%	1.56%
AA GBP H . . . . .	-0.31%	-0.56%	-0.06%	-1.99%
AA NZD H . . . . .	-0.20%	-0.19%	0.47%	10.53%
AA SGD H . . . . .	-0.23%	-0.20%	0.62%	2.15%
AJ . . . . .	-0.06%	0.16%	1.23%	95.07%



	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
AR EUR H .....	-0.57%	-1.09%	-0.92%	-7.05%
AT .....	-0.27%	-0.01%	1.15%	58.74%
AT AUD H .....	-0.34%	-0.57%	0.18%	24.91%
AT CAD H .....	-0.24%	-0.37%	0.61%	7.58%
AT EUR H .....	-0.62%	-1.11%	-0.90%	-4.09%
AT GBP H .....	-0.31%	-0.49%	0.06%	1.03%
AT NZD H .....	-0.21%	-0.22%	0.49%	13.58%
AT SGD H .....	-0.19%	-0.24%	0.61%	1.21%
AX .....	-0.18%	0.14%	1.27%	186.09%
B .....	-0.64%	-1.02%	0.01%	71.20%
B2 .....	-0.69%	-0.96%	0.07%	45.80%
BA .....	-0.72%	-1.05%	0.02%	-3.52%
BT .....	-0.64%	-0.88%	0.14%	26.83%
BT AUD H .....	-0.84%	-1.57%	-0.90%	12.53%
BT GBP H .....	-0.89%	-1.50%	-0.92%	-7.90%
C .....	-0.36%	-0.46%	0.57%	57.64%
C2 .....	-0.39%	-0.39%	0.66%	53.69%
C2 EUR H .....	-0.79%	-1.50%	-1.28%	-8.00%
I .....	0.01%	0.54%	1.71%	145.05%
I2 .....	0.08%	0.61%	1.77%	43.35%
I2 AUD H .....	-0.10%	0.00%	0.76%	33.20%
I2 EUR H .....	-0.32%	-0.52%	-0.26%	2.60%
IT .....	0.09%	0.67%	1.69%	7.13%
IT AUD H .....	-0.07%	-0.05%	0.65%	13.96%
N2 .....	-0.41%	-0.47%	0.54%	-1.80%
NT .....	-0.40%	-0.40%	0.63%	-1.86%
S .....	0.34%	2.61%(1)	-	2.61%
S EUR H .....	-0.12%	-0.06%	0.18%	9.73%
S SGD H .....	0.34%	0.85%	1.72%	19.00%
S1 2 .....	0.18%	0.84%	1.95%	11.80%
S1 EUR H .....	-0.26%	-0.32%	0.00%	4.13%
SA .....	0.35%	1.07%	2.17%	13.38%

**Global High Yield Portfolio**

<b>Klasse</b>				
A .....	6.77%	3.37%	-0.93%	248.64%
A2 .....	6.65%	3.25%	-0.94%	280.36%
A2 CHF H .....	5.91%	1.00%	-3.85%	7.53%
A2 EUR H .....	6.02%	1.00%	-3.74%	61.93%
A2 PLN H .....	6.22%	0.91%	-2.99%	4.99%
A2 SGD H .....	6.51%	2.14%	-2.09%	46.20%
AA .....	6.57%	3.24%	-0.95%	27.64%
AA AUD H .....	6.27%	0.02%	-4.35%	27.76%
AA CAD H .....	6.46%	1.40%	-2.83%	17.65%
AA EUR H .....	5.98%	0.96%	-3.69%	9.00%
AA GBP H .....	6.25%	0.87%	-3.62%	13.75%
AA NZD H .....	6.36%	0.87%	-3.39%	27.43%
AA RMB H .....	7.39%	4.19%	-0.46%	39.53%
AA SGD H .....	6.51%	2.09%	-2.18%	22.30%
AA ZAR H .....	8.69%	4.79%	0.79%	74.75%
AK .....	6.62%	3.27%	-0.96%	32.20%
AK EUR H .....	6.02%	1.03%	-3.66%	16.54%
AR EUR H .....	5.94%	0.94%	-3.77%	10.61%
AT .....	6.54%	3.37%	-0.96%	325.02%
AT AUD H .....	6.19%	0.03%	-4.19%	96.83%
AT CAD H .....	6.37%	1.39%	-2.81%	46.87%
AT EUR H .....	5.96%	0.97%	-3.78%	61.11%
AT GBP H .....	6.33%	0.88%	-3.62%	49.53%
AT NZD H .....	6.34%	0.83%	-3.45%	47.67%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
AT RMB H .....	7.41%	4.21%	-0.45%	76.14%
AT SGD H .....	6.51%	2.08%	-2.19%	45.91%
B .....	6.25%	2.22%	-2.07%	171.81%
B2 .....	6.13%	2.23%	-1.93%	247.78%
B2 EUR H .....	5.54%	0.00%	-4.72%	44.80%
BA .....	6.10%	2.22%	-1.98%	18.87%
BA AUD H .....	5.74%	-1.02%	-5.37%	18.88%
BA ZAR H .....	8.20%	3.78%	-0.48%	61.87%
BT .....	5.95%	2.02%	-1.98%	168.92%
BT AUD H .....	5.75%	-0.94%	-5.19%	76.81%
BT CAD H .....	5.93%	0.41%	-3.81%	31.81%
BT EUR H .....	5.43%	-0.08%	-4.75%	44.15%
BT GBP H .....	5.72%	-0.17%	-4.66%	35.99%
BT NZD H .....	5.78%	-0.16%	-4.41%	36.67%
C .....	6.53%	2.85%	-1.44%	196.79%
C2 .....	6.36%	2.72%	-1.41%	137.60%
C2 EUR H .....	5.72%	0.47%	-4.16%	28.13%
CK .....	6.36%	2.72%	-1.49%	27.30%
CK EUR H .....	5.75%	0.50%	-4.23%	12.52%
CT .....	6.35%	2.76%	-1.39%	41.78%
EA .....	6.35%	2.70%	-1.39%	8.74%
EA AUD H .....	5.95%	-0.55%	-4.84%	2.99%
EA ZAR H .....	8.42%	4.34%	0.33%	12.65%
I .....	7.06%	4.00%	-0.29%	299.52%
I2 .....	6.87%	3.77%	-0.49%	115.66%
I2 AUD H .....	6.51%	0.66%	-3.61%	93.13%
I2 CHF H .....	6.13%	1.46%	-3.27%	10.87%
I2 EUR H .....	6.28%	1.46%	-3.32%	71.33%
I2 SGD H .....	6.77%	2.60%	-1.61%	26.20%
IA AUD H .....	6.53%	0.59%	-3.76%	32.81%
IQD .....	6.86%	3.75%	-0.45%	58.67%
IT .....	6.95%	3.76%	-0.44%	35.67%
IT AUD H .....	6.44%	0.44%	-3.71%	38.54%
IT CAD H .....	6.72%	1.95%	-2.31%	31.19%
IT EUR H .....	6.26%	1.48%	-3.20%	2.02%
IT GBP H .....	6.57%	1.43%	-3.07%	27.41%
IT NZD H .....	6.58%	1.39%	-2.87%	35.44%
IT RMB H .....	7.68%	4.75%	0.11%	50.95%
J .....	6.27%	2.26%	-1.99%	181.71%
N2 .....	6.35%	2.73%	-1.44%	30.60%
NT .....	6.29%	2.65%	-1.47%	30.67%
S EUR H .....	6.81%	2.56%	-2.12%	13.65%
S1 .....	6.93%	3.96%	-0.11%	92.33%
S1D .....	7.00%	3.98%	-0.12%	58.60%
SA .....	7.44%	4.91%	0.76%	41.54%
SHK .....	7.46%	4.94%	0.76%	40.49%
SK .....	7.11%	4.23%	0.11%	158.07%
SQ .....	7.14%	4.33%	0.14%	18.19%
W .....	6.86%	4.27%	-	6.55%
W2 .....	6.96%	3.88%	-0.19%	10.60%
W2 CHF H .....	6.17%	1.68%	-3.06%	0.93%
W2 EUR H .....	6.47%	1.71%	-	3.07%
WT .....	6.93%	3.97%	-0.17%	10.70%
WT AUD H .....	6.55%	0.68%	-3.50%	5.52%
WT CAD H .....	6.72%	2.09%	-	4.25%
WT EUR H .....	6.21%	1.61%	-2.99%	1.84%
WT GBP H .....	6.65%	1.56%	-	3.29%
WT RMB H .....	7.71%	4.91%	-	7.53%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>American Income Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	2.18%	1.82%	2.54%	405.96%
A2 .....	2.10%	1.71%	2.61%	260.90%
A2 CHF H .....	1.44%	-0.47%	-0.42%	12.73%
A2 DUR PH .....	3.97%	2.03%	0.34%	24.00%
A2 EUR H .....	1.57%	-0.20%	-0.10%	34.07%
A2 PLN H .....	1.84%	-0.10%	0.81%	7.73%
A2 SGD H .....	1.96%	0.88%	1.76%	45.40%
AA .....	2.08%	1.69%	2.65%	33.06%
AA AUD H .....	1.80%	-0.41%	0.26%	35.67%
AA CAD H .....	1.95%	0.47%	1.29%	23.48%
AA DUR PH .....	3.90%	1.95%	0.33%	22.99%
AA EUR H .....	1.53%	-0.27%	-0.12%	13.00%
AA GBP H .....	1.86%	-0.18%	0.24%	18.79%
AA NZD H .....	1.95%	0.19%	0.86%	33.69%
AA RMB H .....	2.87%	2.78%	3.28%	44.97%
AA SGD H .....	2.06%	0.94%	1.66%	27.51%
AA ZAR H .....	4.22%	4.76%	6.12%	85.10%
AK .....	2.12%	1.78%	2.69%	31.97%
AK EUR H .....	1.52%	-0.29%	-0.08%	16.67%
AR EUR .....	0.99%	-6.86%	-5.43%	17.85%
AR EUR H .....	1.60%	-0.25%	-0.12%	11.03%
AT .....	2.20%	1.84%	2.55%	178.35%
AT AUD H .....	1.85%	-0.44%	0.20%	78.86%
AT CAD H .....	2.00%	0.44%	1.24%	47.65%
AT DUR PH .....	3.94%	1.97%	0.32%	23.90%
AT EUR H .....	1.57%	-0.32%	-0.18%	35.92%
AT GBP H .....	1.84%	-0.01%	0.46%	35.07%
AT NZD H .....	1.89%	0.13%	0.89%	44.44%
AT RMB H .....	2.89%	2.84%	3.32%	65.82%
AT SGD H .....	2.00%	0.87%	1.65%	45.36%
B .....	1.83%	1.11%	1.83%	315.89%
B2 .....	1.75%	1.03%	1.90%	204.88%
BA .....	1.78%	1.07%	1.88%	26.65%
BA AUD H .....	1.47%	-1.06%	-0.45%	28.91%
BA ZAR H .....	3.89%	4.03%	5.33%	77.20%
BT .....	1.71%	1.02%	1.98%	146.98%
BT AUD H .....	1.49%	-1.04%	-0.41%	66.70%
BT CAD H .....	1.56%	-0.31%	0.58%	35.52%
BT EUR H .....	1.21%	-0.95%	-0.79%	26.15%
BT GBP H .....	1.48%	-0.77%	-0.29%	27.18%
BT NZD H .....	1.62%	-0.48%	0.14%	36.59%
C .....	1.95%	1.36%	2.08%	332.51%
C2 .....	1.87%	1.27%	2.15%	331.17%
C2 DUR PH .....	3.76%	1.58%	-0.11%	19.67%
C2 EUR H .....	1.37%	-0.67%	-0.58%	28.07%
CT .....	1.83%	1.23%	2.15%	33.45%
EA .....	1.88%	1.27%	2.06%	9.95%
EA AUD H .....	1.49%	-0.99%	-0.23%	5.39%
EA ZAR H .....	4.05%	4.33%	5.48%	16.01%
I .....	2.46%	2.39%	3.11%	288.27%
I2 .....	2.41%	2.30%	3.21%	127.20%
I2 AUD H .....	2.18%	0.06%	0.67%	12.60%
I2 CHF H .....	1.67%	0.11%	0.17%	17.93%
I2 DUR PH .....	4.24%	2.57%	0.88%	27.80%
I2 EUR H .....	1.83%	0.23%	0.38%	44.73%
I2 SGD H .....	2.26%	1.46%	2.26%	29.80%
IA .....	2.34%	2.25%	3.15%	33.47%
IA AUD H .....	2.11%	0.14%	0.79%	31.10%
IT .....	2.34%	2.26%	3.18%	37.96%
IT AUD H .....	2.09%	0.06%	0.75%	39.86%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>American Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
IT CAD H .....	2.17%	0.91%	1.76%	28.26%
IT EUR H .....	1.81%	0.19%	0.38%	18.78%
IT GBP H .....	2.17%	0.55%	0.99%	24.38%
IT JPY .....	3.03%	1.07%	2.89%	44.50%
IT JPY H .....	2.04%	0.72%	0.74%	19.90%
IT NZD H .....	2.17%	0.68%	1.44%	33.06%
IT RMB H .....	3.14%	3.75%	4.15%	11.12%
IT SGD H .....	2.28%	1.48%	2.32%	37.49%
J .....	1.84%	1.05%	1.86%	212.74%
L2 .....	2.19%	2.00%	–	5.60%
L2 AUD H .....	1.98%	-0.26%	–	2.87%
L2 SGD H .....	2.15%	1.23%	–	4.60%
LT .....	2.23%	1.95%	–	5.59%
LT AUD H .....	1.95%	-0.23%	–	2.87%
LT SGD H .....	2.10%	1.18%	–	4.57%
N2 .....	1.82%	1.17%	2.08%	26.73%
NT .....	1.78%	1.12%	2.05%	26.68%
S .....	2.71%	3.00%	3.98%	46.73%
S1 .....	2.49%	2.53%	3.44%	64.53%
S1D .....	2.53%	2.55%	3.42%	50.69%
S1D2 .....	2.48%	2.50%	–	2.52%
SA .....	2.75%	3.03%	3.96%	42.81%
SHK .....	2.74%	3.05%	3.96%	35.72%
W .....	2.45%	2.41%	3.32%	17.21%
W2 .....	2.44%	2.44%	3.37%	17.40%
W2 CHF H .....	1.77%	0.25%	0.32%	7.13%
W2 EUR H .....	1.94%	0.43%	0.63%	8.40%
WT .....	2.46%	2.50%	3.35%	17.40%
WT AUD H .....	2.17%	0.25%	0.97%	13.25%
WT EUR H .....	1.90%	0.39%	0.58%	5.47%
WT GBP H .....	2.25%	0.33%	0.65%	6.08%
WT SGD H .....	2.32%	1.62%	2.49%	14.65%
<b>European Income Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	2.99%	3.69%	-0.44%	119.30%
A2 .....	2.98%	3.62%	-0.52%	117.70%
A2 CHF H .....	2.77%	3.40%	-0.73%	11.40%
A2 PLN H .....	3.23%	3.79%	0.48%	8.70%
A2 SGD H .....	3.36%	4.57%	1.11%	25.13%
A2 USD H .....	3.46%	5.36%	1.95%	29.73%
AA .....	2.94%	3.60%	-0.42%	23.82%
AA AUD H .....	3.23%	3.10%	-0.47%	41.62%
AA HKD H .....	3.48%	5.38%	2.00%	30.99%
AA RMB H .....	4.53%	6.63%	2.53%	42.91%
AA SGD H .....	3.40%	4.63%	1.11%	33.71%
AA USD H .....	3.56%	5.42%	1.86%	38.30%
AK .....	2.93%	3.58%	-0.45%	29.44%
AR .....	2.96%	3.63%	-0.49%	15.88%
AT .....	2.99%	3.54%	-0.58%	113.20%
AT AUD H .....	3.26%	3.24%	-0.44%	96.25%
AT SGD H .....	3.40%	4.56%	1.05%	33.66%
AT USD H .....	3.46%	5.30%	1.88%	74.16%
B .....	2.63%	2.96%	-1.14%	87.63%
B2 .....	2.63%	2.91%	-1.19%	87.30%
BA .....	2.66%	2.91%	-1.18%	17.91%
BA AUD H .....	2.94%	2.43%	-1.21%	35.02%
BA USD H .....	3.13%	4.59%	1.19%	31.72%
BT .....	2.63%	2.81%	-1.28%	89.01%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>European Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
BT AUD H .....	2.82%	2.44%	-1.13%	82.84%
BT USD H .....	3.17%	4.62%	1.17%	62.04%
C .....	2.76%	3.21%	-0.90%	95.02%
C2 .....	2.74%	3.20%	-0.89%	106.40%
C2 USD H .....	3.27%	4.90%	1.46%	24.07%
CK .....	2.77%	3.18%	-0.98%	25.25%
CT USD H .....	3.30%	4.93%	1.43%	24.20%
I .....	3.27%	4.27%	0.11%	147.54%
I2 .....	3.26%	4.15%	0.00%	94.52%
I2 AUD H .....	3.49%	3.69%	0.10%	107.87%
I2 CHF H .....	3.11%	4.04%	-0.12%	15.00%
I2 USD H .....	3.79%	5.98%	2.50%	84.20%
IA .....	3.24%	4.12%	0.04%	20.72%
IA HKD H .....	3.75%	6.05%	2.66%	31.11%
IA SGD H .....	3.69%	5.14%	1.61%	30.89%
IA USD H .....	3.77%	5.95%	2.47%	34.67%
IT .....	3.25%	4.15%	0.01%	20.66%
IT SGD H .....	3.68%	5.23%	1.65%	31.00%
IT USD H .....	3.81%	5.96%	2.44%	37.28%
NT USD H .....	3.17%	4.69%	1.35%	16.79%
S .....	3.62%	4.95%	0.79%	18.40%
S1 .....	3.34%	4.43%	0.35%	72.96%
S1 USD H .....	3.90%	6.20%	2.72%	72.40%
S1D .....	3.33%	4.43%	0.32%	22.54%
SA USD H .....	4.14%	6.72%	3.19%	49.49%
SHK .....	3.64%	4.95%	0.78%	25.50%
W2 .....	3.30%	4.33%	-	4.40%
W2 CHF H .....	3.16%	4.21%	0.00%	8.80%
W2 USD H .....	3.88%	6.14%	-	7.13%
WA .....	3.32%	4.33%	-	4.38%
WA HKD H .....	3.85%	6.13%	-	7.18%
WA USD H .....	3.84%	6.13%	-	7.13%
WT .....	3.32%	4.34%	-	4.40%
WT SGD H .....	3.75%	5.36%	-	6.18%
WT USD H .....	3.91%	6.13%	-	7.15%

**Emerging Markets Debt Portfolio**

<b>Klasse</b>				
A .....	1.84%	3.16%	4.04%	130.67%
A2 .....	1.82%	3.12%	4.14%	131.67%
A2 CHF H .....	1.08%	0.95%	1.15%	6.07%
A2 EUR H .....	1.17%	1.03%	1.38%	43.53%
A2 PLN H .....	1.25%	0.74%	2.01%	6.17%
A2 SGD H .....	1.68%	1.92%	2.83%	45.07%
AA .....	1.85%	3.13%	4.16%	33.67%
AA AUD H .....	1.43%	-0.43%	0.40%	33.23%
AA CAD H .....	1.49%	1.29%	2.28%	19.29%
AA EUR H .....	1.18%	1.04%	1.41%	10.62%
AA GBP H .....	1.39%	0.53%	1.20%	15.35%
AA NZD H .....	1.57%	0.51%	1.26%	27.98%
AA RMB H .....	2.53%	4.31%	4.90%	44.96%
AA SGD H .....	1.65%	1.93%	2.87%	27.39%
AA ZAR H .....	3.78%	5.17%	6.44%	81.43%
AR EUR .....	0.68%	-5.68%	-4.18%	20.19%
AT .....	1.84%	3.12%	4.07%	131.58%
AT AUD H .....	1.38%	-0.47%	0.36%	81.17%
AT CAD H .....	1.54%	1.21%	2.19%	20.71%
AT EUR H .....	1.15%	1.02%	1.37%	43.88%
AT GBP H .....	1.38%	0.50%	1.15%	16.50%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
AT NZD H .....	1.52%	0.55%	1.29%	34.86%
AT RMB H .....	2.50%	4.28%	4.93%	67.41%
AT SGD H .....	1.69%	1.97%	2.88%	44.94%
B2 .....	1.32%	2.12%	3.06%	99.53%
BA .....	1.31%	2.10%	3.05%	24.52%
BA AUD H .....	0.85%	-1.17%	-0.38%	24.29%
BA ZAR H .....	3.28%	4.21%	5.56%	68.60%
BT .....	1.33%	2.12%	3.09%	99.44%
BT AUD H .....	0.94%	-1.28%	-0.51%	63.21%
BT CAD H .....	1.03%	0.25%	1.24%	11.49%
BT EUR H .....	0.71%	0.05%	0.42%	29.67%
BT GBP H .....	0.86%	-0.56%	0.11%	7.25%
BT NZD H .....	1.02%	-0.46%	0.30%	24.68%
C .....	1.61%	2.69%	3.57%	115.89%
C2 .....	1.56%	2.66%	3.62%	116.40%
C2 EUR H .....	0.98%	0.59%	0.94%	37.27%
CT .....	1.59%	2.60%	3.65%	21.68%
EA .....	1.55%	2.59%	-	4.21%
EA AUD H .....	1.08%	-0.78%	-	0.61%
EA ZAR H .....	3.59%	4.95%	-	8.09%
I .....	2.04%	3.68%	4.70%	150.00%
I2 .....	2.08%	3.69%	4.69%	151.33%
I2 CHF H .....	1.34%	1.53%	1.73%	11.00%
I2 EUR H .....	1.50%	1.64%	1.93%	53.00%
IT .....	2.05%	3.62%	4.71%	31.66%
IT AUD H .....	1.75%	0.15%	0.87%	33.41%
IT EUR H .....	1.49%	1.63%	1.98%	14.05%
IT SGD H .....	1.95%	2.52%	3.45%	27.23%
N2 .....	1.52%	2.57%	3.55%	19.93%
NT .....	1.60%	2.59%	3.48%	19.99%
S .....	2.46%	4.42%	5.43%	77.03%
S EUR H .....	1.86%	2.39%	2.71%	56.80%
S GBP H .....	2.10%	1.89%	2.44%	65.20%
S1 2 .....	2.16%	3.83%	4.83%	133.07%
S1 EUR H .....	1.65%	1.89%	2.15%	47.73%
S1 GBP H .....	1.83%	1.30%	1.90%	55.73%
S1QD EUR H .....	1.59%	1.82%	-	3.40%
SA .....	2.45%	4.41%	5.41%	43.10%

**Mortgage Income Portfolio**

<b>Klasse</b>				
A .....	5.62%	-4.48%	-7.41%	19.47%
A2 .....	5.58%	-4.62%	-7.45%	19.87%
A2X .....	5.58%	-4.53%	-7.37%	35.33%
AA .....	5.52%	-4.58%	-7.42%	19.84%
AA AUD H .....	5.28%	-6.62%	-9.57%	22.03%
AA RMB H .....	6.39%	-3.82%	-7.07%	28.26%
AA SGD H .....	5.44%	-5.49%	-8.34%	17.22%
AA ZAR H .....	7.87%	-2.03%	-4.78%	70.43%
AR EUR H .....	5.06%	-6.59%	-10.13%	2.79%
AT .....	5.54%	-4.59%	-7.44%	19.72%
AT AUD H .....	5.26%	-6.61%	-9.59%	21.99%
AT GBP H .....	5.34%	-6.38%	-9.58%	-2.19%
AT SGD H .....	5.56%	-5.38%	-8.40%	17.12%
AX .....	5.77%	-4.36%	-7.37%	75.44%
B2X .....	5.35%	-4.91%	-7.80%	28.02%
BA .....	5.05%	-5.48%	-8.31%	11.67%
BA AUD H .....	4.78%	-7.48%	-10.47%	13.68%
BA ZAR H .....	7.44%	-2.86%	-5.54%	59.40%
BX .....	5.52%	-4.85%	-7.83%	55.58%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b><u>Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)</u></b>				
<b>Klasse</b>				
C .....	5.36%	-4.96%	-7.87%	15.74%
C2 .....	5.39%	-4.97%	-7.87%	16.00%
C2X .....	5.38%	-4.91%	-7.78%	14.87%
CX .....	5.52%	-4.85%	-7.83%	55.45%
I .....	5.84%	-4.01%	-6.90%	24.31%
I2 .....	5.84%	-4.06%	-6.91%	24.53%
I2 EUR H .....	5.31%	-6.02%	-9.49%	-2.20%
I2X .....	5.90%	-4.01%	-6.87%	24.62%
IT EUR H .....	5.35%	-5.95%	-9.47%	-2.79%
IX .....	6.08%	-3.76%	-6.80%	70.74%
N2 .....	5.35%	-5.07%	-7.99%	1.13%
NT .....	5.31%	-5.05%	-7.92%	1.24%
S .....	6.26%	-3.37%	-6.29%	30.97%
S1 .....	5.98%	-3.88%	-6.77%	26.58%
S1 EUR H .....	5.42%	-5.81%	-	-4.27%
S1 JPY .....	6.64%	-5.01%	-7.05%	-2.55%
S1X .....	6.22%	-3.48%	-6.54%	36.43%
SA .....	6.23%	-3.38%	-6.28%	28.15%

Die Wertentwicklung der Anteilklassen der einzelnen Portefeuilles basiert auf dem Nettoinventarwert zum 28. Februar 2021, wobei die Auswirkungen der von der Verwaltungsgesellschaft rückerstatteten bzw. erlassenen Aufwendungen einberechnet wurden. Verkaufsgebühren, die beim Kauf oder bei der Rücknahme von Anteilen erhoben werden können, wurden nicht berücksichtigt. Die Wertentwicklung der ausschüttenden Anteilklassen umfasst die während des Geschäftsjahres ausgeschütteten und wieder angelegten Beträge. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie für aktuelle oder zukünftige Ergebnisse. Die Wertentwicklungszahlen berücksichtigen nicht die Provisionen und Kosten im Zusammenhang mit der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen. Anlagerenditen und der Wert des angelegten Kapitals unterliegen Schwankungen, so dass die Anteile eines Anlegers bei Rücknahme mehr oder weniger als die ursprünglichen Anschaffungskosten wert sein können.

\* Sechsmonatszeitraum zum 28. Februar 2021.

Rendite berechnet ab Auflegungsdatum am:

(1) 1. April 2020



	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>			
<b>DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Charter Communications, Inc. - Class A	110	\$ 67,476	0.2%
Comcast Corp. - Class A	5,462	287,957	0.7
Telenor ASA	625	10,102	0.0
		<u>365,535</u>	<u>0.9</u>
<b>UNTERHALTUNG</b>			
Electronic Arts, Inc.	366	49,033	0.1
Netflix, Inc.	188	101,304	0.3
Nintendo Co., Ltd.	258	157,786	0.3
Roku, Inc.	19	7,514	0.0
Walt Disney Co. (The)	1,123	212,292	0.5
		<u>527,929</u>	<u>1.2</u>
<b>INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Alphabet, Inc. - Class A	49	99,074	0.2
Alphabet, Inc. - Class C	187	380,892	0.9
Facebook, Inc. - Class A	1,616	416,314	0.9
IAC/InterActiveCorp	128	31,338	0.1
Tencent Holdings Ltd.	2,400	208,793	0.5
		<u>1,136,411</u>	<u>2.6</u>
<b>DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
SoftBank Corp.	2,200	29,749	0.1
		<u>2,059,624</u>	<u>4.8</u>
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>			
Aisin Seiki Co., Ltd.	2,000	68,735	0.2
Aptiv PLC	1,838	275,406	0.6
Faurecia SE	1,960	101,397	0.2
JTEKT Corp.	2,600	27,615	0.1
Magna International, Inc. - Class A (United States)	254	21,394	0.0
		<u>494,547</u>	<u>1.1</u>
<b>KRAFTFAHRZEUGE</b>			
Ford Motor Co.	1,198	14,017	0.0
General Motors Co.	278	14,270	0.0
Stellantis NV	6,635	107,465	0.3
Tesla, Inc.	127	85,788	0.2
		<u>221,540</u>	<u>0.5</u>
<b>DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE</b>			
Service Corp. International/US	2,709	129,382	0.3
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
Chipotle Mexican Grill, Inc. - Class A	41	59,122	0.1
Compass Group PLC	3,545	71,988	0.2
Entain PLC	5,870	116,127	0.3
Galaxy Entertainment Group Ltd.	5,500	50,175	0.1
Starbucks Corp.	409	44,184	0.1
		<u>341,596</u>	<u>0.8</u>
<b>HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER</b>			
Electrolux AB - Class B	2,237	52,812	0.1
PulteGroup, Inc.	1,590	71,725	0.2
		<u>124,537</u>	<u>0.3</u>
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
Alibaba Group Holding Ltd. (ADR)	1,042	247,746	0.6
Amazon.com, Inc.	127	392,802	0.9
HelloFresh SE	224	17,404	0.0
Just Eat Takeaway.com NV	296	28,483	0.1
Naspers Ltd. - Class N	911	214,976	0.5
Prosus NV	713	85,001	0.2
Rakuten, Inc.	600	6,744	0.0
Zalando SE	553	56,852	0.1
		<u>1,050,008</u>	<u>2.4</u>
<b>MULTILINE-EINZELHANDEL</b>			
Dollar General Corp.	286	54,051	0.1
Next PLC	529	56,034	0.2
Target Corp.	267	48,979	0.1
		<u>159,064</u>	<u>0.4</u>



	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>			
AutoZone, Inc. ....	58	\$ 67,276	0.2%
Best Buy Co., Inc. ....	137	13,748	0.0
Foot Locker, Inc. ....	1,570	75,501	0.2
Home Depot, Inc. (The) ....	27	6,975	0.0
O'Reilly Automotive, Inc. ....	136	60,837	0.1
TJX Cos., Inc. (The) ....	3,211	211,894	0.5
		<u>436,231</u>	<u>1.0</u>
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
adidas AG ....	102	35,556	0.1
EssilorLuxottica SA ....	240	39,152	0.1
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE ....	100	63,362	0.2
NIKE, Inc. - Class B ....	900	121,302	0.3
Pandora A/S ....	1,001	97,182	0.2
Tapestry, Inc. ....	1,400	58,996	0.1
		<u>415,550</u>	<u>1.0</u>
		<u>3,372,455</u>	<u>7.8</u>
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>			
<b>GETRÄNKE</b>			
Asahi Group Holdings Ltd. ....	2,654	115,866	0.3
Coca-Cola Co. (The) ....	3,113	152,506	0.4
Kirin Holdings Co., Ltd. ....	900	17,731	0.0
PepsiCo, Inc. ....	580	74,930	0.2
Treasury Wine Estates Ltd. ....	16,818	141,221	0.3
		<u>502,254</u>	<u>1.2</u>
<b>LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL</b>			
Costco Wholesale Corp. ....	109	36,079	0.1
Koninklijke Ahold Delhaize NV ....	2,000	52,809	0.1
Walmart, Inc. ....	90	11,693	0.0
		<u>100,581</u>	<u>0.2</u>
<b>LEBENSMITTELPRODUKTE</b>			
Archer-Daniels-Midland Co. ....	1,035	58,560	0.1
Bunge Ltd. ....	901	68,999	0.2
Danone SA ....	1,612	109,617	0.2
General Mills, Inc. ....	210	11,552	0.0
Hain Celestial Group, Inc. (The) ....	1,640	69,175	0.2
Ingredion, Inc. ....	788	71,078	0.2
Nestle SA (REG) ....	1,559	162,711	0.4
Nichirei Corp. ....	1,500	38,981	0.1
Salmar ASA ....	840	55,091	0.1
WH Group Ltd. ....	53,500	47,985	0.1
		<u>693,749</u>	<u>1.6</u>
<b>KÖRPERPFLEGEPRODUKTE</b>			
Unilever PLC ....	637	33,205	0.1
<b>TABAK</b>			
Philip Morris International, Inc. ....	1,400	117,628	0.3
		<u>1,447,417</u>	<u>3.4</u>
<b>ENERGIE</b>			
<b>ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE</b>			
Baker Hughes Co. - Class A ....	2,057	50,355	0.1
<b>ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE</b>			
Cheniere Energy, Inc. ....	515	34,706	0.1
ENEOS Holdings, Inc. ....	800	3,538	0.0
Equinor ASA ....	1,833	34,762	0.1
Exxon Mobil Corp. ....	424	23,053	0.1
Galp Energia SGPS SA ....	1,371	15,326	0.0
Idemitsu Kosan Co., Ltd. ....	900	23,673	0.1
Inpex Corp. ....	3,600	26,768	0.1
LUKOIL PJSC (Sponsored ADR) ....	774	57,663	0.1
Neste Oyj ....	528	34,874	0.1
Parkland Corp./Canada ....	1,031	32,762	0.1
Repsol SA ....	6,565	82,639	0.1
Royal Dutch Shell PLC - Class A ....	5,040	104,013	0.2
Valero Energy Corp. ....	555	42,724	0.1
		<u>516,501</u>	<u>1.2</u>
		<u>566,856</u>	<u>1.3</u>
<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BANKEN</b>			
ABN AMRO Bank NV (GDR) ....	3,720	42,774	0.1
Bank Hapoalim BM ....	7,270	51,220	0.1

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Bank Leumi Le-Israel BM	8,000	\$ 48,521	0.1%
Bank of America Corp.	2,480	86,081	0.2
Bank of Ireland Group PLC	24,600	101,234	0.2
Citizens Financial Group, Inc.	252	10,947	0.0
East West Bancorp, Inc.	78	5,629	0.0
Fifth Third Bancorp	887	30,770	0.1
JPMorgan Chase & Co.	577	84,917	0.2
Jyske Bank A/S	2,312	99,598	0.2
KB Financial Group, Inc.	1,710	66,187	0.2
Mebuki Financial Group, Inc.	2,700	5,767	0.0
Societe Generale SA	1,005	24,870	0.1
SVB Financial Group	142	71,761	0.2
Wells Fargo & Co.	8,794	318,079	0.8
Westpac Banking Corp.	5,000	91,661	0.2
		<u>1,140,016</u>	<u>2.7</u>
<b>KAPITALMÄRKTE</b>			
BlackRock, Inc. - Class A	117	81,256	0.2
Charles Schwab Corp. (The)	6,027	371,986	0.9
CME Group, Inc. - Class A	325	64,903	0.1
Daiwa Securities Group, Inc.	14,000	68,514	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	398	127,153	0.3
IG Group Holdings PLC	4,043	44,098	0.1
Julius Baer Group Ltd.	3,287	202,326	0.5
Moody's Corp.	439	120,677	0.3
Morgan Stanley	901	69,260	0.2
Nomura Holdings, Inc.	4,500	26,285	0.1
Raymond James Financial, Inc.	553	64,557	0.1
Singapore Exchange Ltd.	8,300	61,795	0.1
T. Rowe Price Group, Inc.	42	6,810	0.0
		<u>1,309,620</u>	<u>3.0</u>
<b>FINANZWESEN – VERBRAUCHER</b>			
Ally Financial, Inc.	911	37,806	0.1
American Express Co.	780	105,503	0.2
Capital One Financial Corp.	203	24,399	0.1
		<u>167,708</u>	<u>0.4</u>
<b>DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN</b>			
AMP Ltd.	6,044	6,992	0.0
Groupe Bruxelles Lambert SA	525	51,930	0.1
Kinnevik AB - Class B	1,331	61,763	0.2
M&G PLC	20,956	53,975	0.1
		<u>174,660</u>	<u>0.4</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>			
AIA Group Ltd.	10,000	126,114	0.3
Athene Holding Ltd. - Class A	594	27,080	0.1
Aviva PLC	1,888	9,565	0.0
CNP Assurances	3,810	68,562	0.1
Everest Re Group Ltd.	187	45,218	0.1
Gjensidige Forsikring ASA	1,709	39,198	0.1
iA Financial Corp., Inc.	658	33,810	0.1
Manulife Financial Corp.	2,370	47,247	0.1
MetLife, Inc.	1,364	78,566	0.2
PICC Property & Casualty Co., Ltd. - Class H	56,000	42,368	0.1
Progressive Corp. (The)	470	40,397	0.1
Prudential Financial, Inc.	826	71,631	0.2
Reinsurance Group of America, Inc. - Class A	390	47,670	0.1
Suncorp Group Ltd.	12,600	96,533	0.2
		<u>773,959</u>	<u>1.8</u>
		<u>3,565,963</u>	<u>8.3</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
<b>BIOTECHNOLOGIE</b>			
AbbVie, Inc.	540	58,179	0.1
Amgen, Inc.	113	25,416	0.1
Exact Sciences Corp.	149	20,282	0.1
Genmab A/S	552	185,133	0.4
Moderna, Inc.	174	26,937	0.1
Seagen, Inc.	133	20,098	0.0
		<u>336,045</u>	<u>0.8</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF</b>			
Abbott Laboratories	1,760	210,813	0.5
Align Technology, Inc.	9	5,104	0.0
Coloplast A/S - Class B	21	3,199	0.0

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Hologic, Inc. ....	371	\$ 26,745	0.1%
IDEXX Laboratories, Inc. ....	30	15,605	0.0
Koninklijke Philips NV ....	3,316	181,044	0.4
Medtronic PLC ....	2,518	294,530	0.7
Novocure Ltd. ....	378	56,360	0.1
STERIS PLC ....	163	28,492	0.1
		<u>821,892</u>	<u>1.9</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Anthem, Inc. ....	969	293,791	0.7
HCA Healthcare, Inc. ....	390	67,092	0.1
Henry Schein, Inc. ....	1,080	66,798	0.1
Humana, Inc. ....	88	33,409	0.1
McKesson Corp. ....	252	42,719	0.1
UnitedHealth Group, Inc. ....	208	69,102	0.2
		<u>572,911</u>	<u>1.3</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE</b>			
Cerner Corp. ....	700	48,398	0.1
Change Healthcare, Inc. ....	3,010	68,839	0.1
Veeva Systems, Inc. - Class A ....	247	69,187	0.2
		<u>186,424</u>	<u>0.4</u>
<b>LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A ....	18	10,521	0.0
Eurofins Scientific SE ....	1,450	128,711	0.3
IQVIA Holdings, Inc. ....	1,037	199,923	0.4
QIAGEN NV ....	481	23,794	0.1
Thermo Fisher Scientific, Inc. ....	89	40,058	0.1
		<u>403,007</u>	<u>0.9</u>
<b>PHARMAZEUTIKA</b>			
Bristol-Myers Squibb Co. ....	1,078	66,114	0.2
Eli Lilly & Co. ....	344	70,482	0.2
GlaxoSmithKline PLC ....	5,120	85,431	0.2
Johnson & Johnson ....	475	75,269	0.2
Novo Nordisk A/S - Class B ....	168	11,985	0.0
Pfizer, Inc. ....	1,422	47,623	0.1
Roche Holding AG ....	788	258,510	0.6
Sanofi ....	1,252	114,897	0.3
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd. ....	600	20,219	0.0
Zoetis, Inc. ....	1,193	185,201	0.4
		<u>935,731</u>	<u>2.2</u>
		<u>3,256,010</u>	<u>7.5</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG</b>			
Airbus SE ....	721	83,762	0.2
<b>LUFTFRACHT UND LOGISTIK</b>			
Kuehne & Nagel International AG ....	282	66,916	0.2
United Parcel Service, Inc. - Class B ....	22	3,472	0.0
XPO Logistics, Inc. ....	42	4,897	0.0
		<u>75,285</u>	<u>0.2</u>
<b>BAUPRODUKTE</b>			
Carrier Global Corp. ....	1,605	58,631	0.1
Cie de Saint-Gobain ....	758	40,762	0.1
Otis Worldwide Corp. ....	2,862	182,338	0.4
Xinyi Glass Holdings Ltd. ....	10,000	27,981	0.1
		<u>309,712</u>	<u>0.7</u>
<b>GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF</b>			
Cintas Corp. ....	57	18,487	0.1
Secom Co., Ltd. ....	1,565	136,273	0.3
Stericycle, Inc. ....	2,102	136,357	0.3
		<u>291,117</u>	<u>0.7</u>
<b>BAU- UND INGENIEURWESEN</b>			
AECOM ....	1,040	60,205	0.1
Shimizu Corp. ....	5,000	37,983	0.1
		<u>98,188</u>	<u>0.2</u>
<b>ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG</b>			
Generac Holdings, Inc. ....	208	68,549	0.2
Nidec Corp. ....	2,000	255,030	0.6
Prysmian SpA ....	592	19,016	0.0
Regal Beloit Corp. ....	490	66,968	0.1
Rockwell Automation, Inc. ....	139	33,816	0.1

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Vertiv Holdings Co. ....	1,451	\$ 30,369	0.1%
Vestas Wind Systems A/S .....	268	50,257	0.1
		<u>524,005</u>	<u>1.2</u>
<b>INDUSTRIEKONZERNE</b>			
3M Co. ....	960	168,058	0.4
<b>MASCHINEN</b>			
Alstom SA .....	5,520	275,144	0.6
CNH Industrial NV .....	1,627	24,016	0.1
Cummins, Inc. ....	15	3,798	0.0
Deere & Co. ....	255	89,025	0.2
Dover Corp. ....	586	72,230	0.2
Kawasaki Heavy Industries Ltd. ....	600	13,597	0.0
Mitsubishi Heavy Industries Ltd. ....	200	5,802	0.0
Oshkosh Corp. ....	922	97,732	0.2
Snap-on, Inc. ....	363	73,729	0.2
Techtronic Industries Co., Ltd. ....	3,500	53,270	0.1
Volvo AB .....	6,122	156,726	0.4
		<u>865,069</u>	<u>2.0</u>
<b>SCHIFFFAHRT</b>			
Nippon Yusen KK .....	200	5,785	0.0
<b>PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Recruit Holdings Co., Ltd. ....	4,200	209,872	0.5
RELX PLC .....	1,893	44,538	0.1
Robert Half International, Inc. ....	2,025	157,525	0.4
Verisk Analytics, Inc. - Class A .....	1,103	180,726	0.4
		<u>592,661</u>	<u>1.4</u>
<b>STRASSE UND SCHIENE</b>			
Knight-Swift Transportation Holdings, Inc. ....	1,780	76,896	0.2
Union Pacific Corp. ....	44	9,062	0.0
		<u>85,958</u>	<u>0.2</u>
<b>HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER</b>			
AerCap Holdings NV .....	1,811	87,254	0.2
Ashtead Group PLC .....	3,953	214,773	0.5
Ferguson PLC .....	153	18,102	0.0
United Rentals, Inc. ....	230	68,397	0.2
WW Grainger, Inc. ....	43	16,026	0.0
		<u>404,552</u>	<u>0.9</u>
		<u>3,504,152</u>	<u>8.1</u>
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG</b>			
Juniper Networks, Inc. ....	3,150	73,332	0.1
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
Amphenol Corp. - Class A .....	1,313	165,018	0.4
Arrow Electronics, Inc. ....	666	66,773	0.2
IPG Photonics Corp. ....	216	49,108	0.1
Keyence Corp. ....	300	143,058	0.3
Murata Manufacturing Co., Ltd. ....	2,100	180,022	0.4
Zebra Technologies Corp. - Class A .....	174	86,901	0.2
		<u>690,880</u>	<u>1.6</u>
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
21Vianet Group, Inc. (ADR) .....	1,380	50,287	0.1
Accenture PLC - Class A .....	308	77,277	0.2
Automatic Data Processing, Inc. ....	1,782	310,104	0.8
Booz Allen Hamilton Holding Corp. ....	747	57,624	0.1
Capgemini SE .....	1,329	213,437	0.5
Cognizant Technology Solutions Corp. - Class A .....	2,440	179,291	0.4
EPAM Systems, Inc. ....	168	62,766	0.1
Mastercard, Inc. - Class A .....	788	278,834	0.6
Visa, Inc. - Class A .....	515	109,381	0.3
		<u>1,339,001</u>	<u>3.1</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
Applied Materials, Inc. ....	1,152	136,155	0.3
ASML Holding NV .....	566	320,991	0.7
Intel Corp. ....	1,693	102,901	0.2
KLA Corp. ....	79	24,587	0.1
NVIDIA Corp. ....	112	61,441	0.2
NXP Semiconductors NV .....	300	54,765	0.1
QUALCOMM, Inc. ....	550	74,904	0.2
STMicroelectronics NV .....	839	32,584	0.1
		<u>808,328</u>	<u>1.9</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>SOFTWARE</b>			
Adobe, Inc. ....	80	\$ 36,774	0.1%
Avast PLC ....	11,650	75,182	0.2
Cadence Design Systems, Inc. ....	501	70,686	0.2
Citrix Systems, Inc. ....	570	76,141	0.2
CommVault Systems, Inc. ....	1,491	95,021	0.2
Constellation Software, Inc./Canada ....	34	44,022	0.1
Fair Isaac Corp. ....	116	53,076	0.1
Intuit, Inc. ....	67	26,139	0.1
Microsoft Corp. ....	3,828	889,551	2.1
Oracle Corp. ....	2,961	191,014	0.4
SAP SE ....	2,557	316,267	0.7
ServiceNow, Inc. ....	16	8,535	0.0
Trade Desk, Inc. (The) - Class A ....	81	65,237	0.1
Trend Micro, Inc./Japan ....	2,570	124,241	0.3
VMware, Inc. - Class A ....	656	90,666	0.2
		<u>2,162,552</u>	<u>5.0</u>
<b>TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE</b>			
Apple, Inc. ....	2,471	299,633	0.7
NCR Corp. ....	1,750	60,830	0.1
NetApp, Inc. ....	866	54,212	0.1
Samsung Electronics Co., Ltd. ....	4,382	321,138	0.8
Western Digital Corp. ....	1,790	122,669	0.3
		<u>858,482</u>	<u>2.0</u>
		<u>5,932,575</u>	<u>13.7</u>
<b>GRUNDSTOFFE</b>			
<b>CHEMIKALIEN</b>			
Celanese Corp. - Class A ....	392	54,453	0.1
Daicel Corp. ....	1,000	7,366	0.0
International Flavors & Fragrances, Inc. ....	1,405	190,391	0.5
LANXESS AG ....	177	13,138	0.0
Linde PLC ....	205	50,075	0.1
LyondellBasell Industries NV - Class A ....	550	56,700	0.1
Mitsubishi Chemical Holdings Corp. ....	2,200	15,384	0.0
Mitsui Chemicals, Inc. ....	700	21,685	0.1
Sika AG ....	141	37,286	0.1
Tosoh Corp. ....	4,900	90,076	0.2
		<u>536,554</u>	<u>1.2</u>
<b>METALL UND BERGBAU</b>			
Agnico Eagle Mines Ltd. ....	648	36,173	0.1
Antofagasta PLC ....	1,402	34,991	0.1
BHP Group Ltd. ....	485	18,333	0.0
BHP Group PLC ....	2,014	63,966	0.2
Evraz PLC ....	5,463	43,857	0.1
Fortescue Metals Group Ltd. ....	3,941	72,783	0.2
Glencore PLC ....	5,068	20,625	0.0
Northern Star Resources Ltd. ....	4,430	34,313	0.1
		<u>325,041</u>	<u>0.8</u>
		<u>861,595</u>	<u>2.0</u>
<b>IMMOBILIEN</b>			
<b>AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)</b>			
American Tower Corp. ....	561	121,249	0.3
Americold Realty Trust ....	2,350	82,344	0.2
MGM Growth Properties LLC - Class A ....	1,840	60,757	0.1
Orix JREIT, Inc. ....	31	53,096	0.1
Scentre Group ....	8,024	17,768	0.1
VICI Properties, Inc. ....	597	17,014	0.0
		<u>352,228</u>	<u>0.8</u>
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG</b>			
Aroundtown SA ....	8,250	59,990	0.2
CBRE Group, Inc. - Class A ....	1,316	99,714	0.2
		<u>159,704</u>	<u>0.4</u>
		<u>511,932</u>	<u>1.2</u>
<b>VERSORGUNG</b>			
<b>STROMVERSORGUNGSBETRIEBE</b>			
EDP - Energias de Portugal SA ....	15,781	90,452	0.2
Electricite de France SA ....	691	8,245	0.0
Enel SpA ....	14,417	135,936	0.3
Evergy, Inc. ....	1,231	66,018	0.1
Iberdrola SA ....	2,571	32,220	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %	
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA .....			3,148	\$ 21,838	0.1%	
				<u>354,709</u>	<u>0.8</u>	
<b>GASVERSORGUNGSBETRIEBE</b>						
China Resources Gas Group Ltd. ....			9,500	47,494	0.1	
Kunlun Energy Co., Ltd. ....			52,000	47,763	0.1	
UGI Corp. ....			902	34,556	0.1	
				<u>129,813</u>	<u>0.3</u>	
<b>UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN</b>						
Brookfield Renewable Corp. ....			637	29,497	0.1	
				<u>514,019</u>	<u>1.2</u>	
				<u>25,592,598</u>	<u>59.3</u>	
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>						
<b>AUSTRALIEN</b>						
Australia Government Bond, Series 142 .....	4.25%	04/21/2026	AUD	260	234,291	0.5
Australia Government Bond, Series 144 .....	3.75%	04/21/2037		120	110,598	0.3
Australia Government Bond, Series 145 .....	2.75%	06/21/2035		140	115,746	0.3
Australia Government Bond, Series 149 .....	2.25%	05/21/2028		330	270,343	0.6
Australia Government Bond, Series 150 .....	3.00%	03/21/2047		140	113,802	0.3
Australia Government Bond, Series 161 .....	0.25%	11/21/2025		59	44,346	0.1
Australia Government Bond, Series 162 .....	1.75%	06/21/2051		30	18,249	0.0
				<u>907,375</u>	<u>2.1</u>	
<b>ÖSTERREICH</b>						
Republic of Austria Government Bond .....	0.50%	02/20/2029	EUR	40	51,029	0.1
Republic of Austria Government Bond .....	0.75%	02/20/2028		50	64,779	0.2
				<u>115,808</u>	<u>0.3</u>	
<b>KOLUMBIEN</b>						
Colombian TES, Series B .....	5.75%	11/03/2027	COP	951,200	267,507	0.6
<b>FINNLAND</b>						
Finland Government Bond .....	0.50%	09/15/2027	EUR	37	47,189	0.1
<b>FRANKREICH</b>						
French Republic Government Bond OAT .....	1.25%	05/25/2036		75	103,569	0.2
French Republic Government Bond OAT .....	1.50%	05/25/2050		45	66,047	0.2
				<u>169,616</u>	<u>0.4</u>	
<b>DEUTSCHLAND</b>						
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe .....	0.00%	08/15/2050		146	166,013	0.4
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007 .....	4.25%	07/04/2039		55	118,663	0.3
				<u>284,676</u>	<u>0.7</u>	
<b>ITALIEN</b>						
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro .....	0.95%	09/15/2027		495	619,601	1.4
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro .....	1.80%	03/01/2041		194	250,127	0.6
				<u>869,728</u>	<u>2.0</u>	
<b>JAPAN</b>						
Japan Government Ten Year Bond, Series 318 .....	1.00%	09/20/2021	JPY	24,000	226,548	0.5
Japan Government Ten Year Bond, Series 323 .....	0.90%	06/20/2022		27,050	257,118	0.6
Japan Government Ten Year Bond, Series 358 .....	0.10%	03/20/2030		46,900	439,177	1.0
Japan Government Ten Year Bond, Series 359 .....	0.10%	06/20/2030		31,700	296,516	0.7
Japan Government Thirty Year Bond, Series 62 .....	0.50%	03/20/2049		13,950	123,460	0.3
Japan Government Thirty Year Bond, Series 65 .....	0.40%	12/20/2049		11,350	97,203	0.2
Japan Government Thirty Year Bond, Series 68 .....	0.60%	09/20/2050		13,350	120,418	0.3
Japan Government Twenty Year Bond, Series 171 .....	0.30%	12/20/2039		10,350	93,069	0.2
				<u>1,653,509</u>	<u>3.8</u>	
<b>MALAYSIA</b>						
Malaysia Government Bond, Series 0310 .....	4.50%	04/15/2030	MYR	245	66,795	0.2
<b>MEXIKO</b>						
Mexican Bonos, Series M .....	8.00%	11/07/2047	MXN	335	17,539	0.0
<b>SPANIEN</b>						
Spain Government Bond .....	1.20%	10/31/2040	EUR	110	137,957	0.3
<b>THAILAND</b>						
Thailand Government Bond .....	1.59%	12/17/2035	THB	1,100	33,916	0.1
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>						
United Kingdom Gilt .....	1.25%	10/22/2041	GBP	80	109,598	0.3
United Kingdom Gilt .....	1.75%	09/07/2037		152	228,046	0.5
				<u>337,644</u>	<u>0.8</u>	
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>						
U.S. Treasury Bonds .....	1.13%	05/15/2040	USD	180	152,578	0.4
U.S. Treasury Bonds .....	1.13%	08/15/2040		375	316,524	0.7
U.S. Treasury Notes .....	0.25%	05/31/2025		347	341,470	0.8
U.S. Treasury Notes .....	2.13%	05/31/2026		535	570,527	1.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
U.S. Treasury Notes .....	2.88%	11/30/2025	USD 120	\$ 132,056	0.3%
				1,513,155	3.5
				6,422,414	14.9
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.....	1.13%	11/21/2029	EUR 100	122,819	0.3
Banco de Credito del Peru .....	3.13%	07/01/2030	USD 40	40,820	0.1
Bank of America Corp. ....	1.38%	02/07/2025	EUR 100	125,312	0.3
BNP Paribas SA.....	0.50%	07/15/2025	100	122,128	0.2
Citigroup, Inc. ....	3.98%	03/20/2030	USD 25	28,155	0.1
Citigroup, Inc. ....	4.45%	09/29/2027	25	28,673	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The).....	2.60%	02/07/2030	28	29,053	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The).....	3.38%	03/27/2025	EUR 45	61,293	0.1
ING Groep NV.....	1.13%	02/14/2025	100	125,484	0.3
JPMorgan Chase & Co. ....	1.09%	03/11/2027	100	125,774	0.3
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. ....	0.87%	09/07/2024	100	124,032	0.3
Morgan Stanley, Series G.....	1.38%	10/27/2026	100	127,979	0.3
US Bancorp, Series J(a).....	5.30%	04/15/2027	USD 27	29,931	0.1
Wells Fargo & Co. ....	0.63%	08/14/2030	EUR 100	119,535	0.2
				1,210,988	2.8
<b>MAKLER</b>					
SURA Asset Management SA .....	4.88%	04/17/2024	USD 100	109,500	0.3
<b>FINANZEN</b>					
Air Lease Corp. ....	3.63%	04/01/2027	9	9,664	0.0
Aviation Capital Group LLC .....	1.95%	01/30/2026	5	4,903	0.0
Aviation Capital Group LLC .....	4.13%	08/01/2025	13	13,902	0.0
GE Capital European Funding Unlimited Co.....	4.63%	02/22/2027	EUR 50	74,789	0.2
Synchrony Financial .....	3.95%	12/01/2027	USD 10	10,966	0.0
Synchrony Financial .....	4.50%	07/23/2025	25	27,885	0.1
				142,109	0.3
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Alleghany Corp.....	3.63%	05/15/2030	37	41,100	0.1
Chubb INA Holdings, Inc.....	0.30%	12/15/2024	EUR 100	121,692	0.3
Voya Financial, Inc.....	5.65%	05/15/2053	USD 19	20,274	0.0
				183,066	0.4
				1,645,663	3.8
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Westinghouse Air Brake Technologies Corp. ....	4.40%	03/15/2024	18	19,638	0.0
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital .....	5.38%	05/01/2047	20	23,166	0.1
Fox Corp. ....	4.71%	01/25/2029	50	58,420	0.1
ViacomCBS, Inc.....	3.70%	06/01/2028	3	3,311	0.0
ViacomCBS, Inc.....	4.20%	05/19/2032	8	9,162	0.0
ViacomCBS, Inc.....	4.95%	01/15/2031	5	5,990	0.0
ViacomCBS, Inc.....	5.50%	05/15/2033	25	30,856	0.1
				130,905	0.3
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
AT&T, Inc. ....	1.60%	05/19/2028	EUR 100	128,561	0.3
AT&T, Inc.....	3.50%	09/15/2053	USD 35	31,723	0.1
British Telecommunications PLC .....	9.63%	12/15/2030	35	54,892	0.1
Corning, Inc. ....	5.45%	11/15/2079	20	25,720	0.1
				240,896	0.6
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
Daimler International Finance BV.....	0.25%	11/06/2023	EUR 35	42,456	0.1
Daimler International Finance BV.....	0.85%	02/28/2025	15	18,602	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.....	3.35%	06/08/2025	USD 43	45,521	0.1
Lear Corp. ....	3.50%	05/30/2030	2	2,123	0.0
Lear Corp. ....	4.25%	05/15/2029	3	3,345	0.0
Volkswagen Bank GmbH.....	1.25%	12/15/2025	EUR 35	43,894	0.1
Volkswagen Leasing GmbH.....	2.63%	01/15/2024	30	38,706	0.1
				194,647	0.5
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
CK Hutchison Finance 16 II Ltd.....	0.88%	10/03/2024	100	123,747	0.3
Ralph Lauren Corp.....	2.95%	06/15/2030	USD 31	32,696	0.1
Ross Stores, Inc.....	4.70%	04/15/2027	9	10,356	0.0
				166,799	0.4



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Altria Group, Inc.	3.13%	06/15/2031	EUR 100	\$ 140,361	0.1%
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	5.55%	01/23/2049	USD 30	38,686	0.1
Banner Health	2.34%	01/01/2030	31	31,743	0.1
BAT Capital Corp.	4.91%	04/02/2030	40	46,203	0.1
Baylor Scott & White Holdings, Series 2021	1.78%	11/15/2030	38	37,295	0.1
Biogen, Inc.	3.15%	05/01/2050	33	31,149	0.1
Bon Secours Mercy Health, Inc., Series 20-2	2.10%	06/01/2031	23	22,914	0.1
CVS Health Corp.	5.05%	03/25/2048	34	42,472	0.1
Gilead Sciences, Inc.	4.80%	04/01/2044	20	24,560	0.1
Sutter Health, Series 20A	2.29%	08/15/2030	27	27,295	0.1
				<u>442,678</u>	<u>1.0</u>
<b>ENERGIE</b>					
BP Capital Markets America, Inc.	2.77%	11/10/2050	35	30,605	0.1
Cenovus Energy, Inc.	5.38%	07/15/2025	10	11,304	0.0
Chevron USA, Inc.	5.25%	11/15/2043	45	60,158	0.2
Enbridge Energy Partners LP	7.38%	10/15/2045	26	37,810	0.1
Energy Transfer Operating LP	3.75%	05/15/2030	9	9,447	0.0
Energy Transfer Operating LP	5.50%	06/01/2027	30	34,980	0.1
Eni SpA	1.25%	05/18/2026	EUR 100	127,270	0.3
Exxon Mobil Corp.	0.84%	06/26/2032	100	119,735	0.3
Husky Energy, Inc.	4.40%	04/15/2029	USD 33	36,258	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.80%	09/15/2030	8	8,257	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.55%	12/15/2029	4	4,085	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	7	7,734	0.0
Valero Energy Corp.	6.63%	06/15/2037	9	11,819	0.0
				<u>499,462</u>	<u>1.2</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	3.50%	01/15/2028	11	11,757	0.0
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	3.88%	01/15/2027	17	18,568	0.1
Broadcom, Inc.	3.50%	02/15/2041	22	21,710	0.1
Broadcom, Inc.	3.75%	02/15/2051	8	7,811	0.0
Fidelity National Information Services, Inc.	0.63%	12/03/2025	EUR 100	122,948	0.3
Oracle Corp.	3.60%	04/01/2050	USD 15	15,474	0.0
Oracle Corp.	3.85%	04/01/2060	17	18,168	0.0
				<u>216,436</u>	<u>0.5</u>
<b>TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN</b>					
Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust, Series 44378	6.15%	08/01/2022	17	18,052	0.0
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Heathrow Funding Ltd.	6.75%	12/03/2026	GBP 50	87,442	0.2
				<u>2,016,955</u>	<u>4.7</u>
<b>VERSORGENSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Enel Americas SA	4.00%	10/25/2026	USD 35	38,637	0.1
Enel Generacion Chile SA	4.25%	04/15/2024	35	37,669	0.1
				<u>76,306</u>	<u>0.2</u>
				<u>3,738,924</u>	<u>8.7</u>
<b>HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAHLUNGEN</b>					
<b>FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT</b>					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2018	4.50%	11/01/2048	47	52,054	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	02/01/2042	7	7,376	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	11/01/2042	76	82,609	0.2
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	01/01/2043	12	13,060	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2013	3.50%	04/01/2043	46	50,210	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2018	4.00%	09/01/2048	36	39,318	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2018	4.50%	09/01/2048	65	71,736	0.2
Federal National Mortgage Association, Series 2020	2.50%	10/01/2050	56	58,213	0.1
Government National Mortgage Association, Series 2021	3.00%	03/01/2051	282	293,368	0.7
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2020, TBA	3.50%	03/01/2051	147	155,618	0.3
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2021, TBA	1.50%	03/01/2051	77	75,334	0.2
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2021, TBA	2.00%	03/01/2051	294	295,514	0.7
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2021, TBA	2.50%	03/01/2051	323	333,598	0.8
				<u>1,528,008</u>	<u>3.5</u>
<b>REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN</b>					
<b>FRANKREICH</b>					
Dexia Credit Local SA	0.50%	01/17/2025	EUR 200	248,534	0.6
<b>DEUTSCHLAND</b>					
Landwirtschaftliche Rentenbank	0.25%	07/15/2024	405	500,991	1.2
<b>INDONESIEN</b>					
Indonesia Government International Bond	2.15%	07/18/2024	100	127,216	0.3



		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MEXIKO	Mexico Government International Bond . . . . .	3.38%	02/23/2031	EUR	110 \$ 155,324	0.3%
PANAMA	Panama Government International Bond . . . . .	8.88%	09/30/2027	USD	25 34,586	0.1
PERU	Peruvian Government International Bond . . . . .	2.39%	01/23/2026		60 62,269	0.1
					1,128,920	2.6
<b>REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN</b>						
KANADA	Canada Housing Trust No. 1 . . . . .	1.80%	12/15/2024	CAD	445 361,532	0.8
	Canada Housing Trust No. 1 . . . . .	1.95%	12/15/2025		40 32,581	0.1
					394,113	0.9
FRANKREICH	Societe Nationale SNCF SA . . . . .	0.63%	04/17/2030	EUR	100 124,736	0.3
JAPAN	Development Bank of Japan, Inc. . . . .	2.30%	03/19/2026	JPY	30,000 312,480	0.7
	Development Bank of Japan, Inc., Series G . . . . .	0.01%	10/15/2024	EUR	100 121,744	0.3
					434,224	1.0
					953,073	2.2
<b>INVESTMENTGESELLSCHAFTEN</b>						
<b>FONDS UND INVESTMENTTRUSTS</b>						
	AB SICAV I - Low Volatility Equity Portfolio - Class S1 . . . . .				24,157 854,180	2.0
<b>GEDECKTE ANLEIHEN</b>						
	BPCE SFH SA . . . . .	1.75%	06/27/2024	EUR	100 129,363	0.3
	Commonwealth Bank of Australia . . . . .	0.38%	04/24/2023		100 122,745	0.3
	DNB Boligkreditt AS . . . . .	0.38%	11/14/2023		100 123,270	0.3
	Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj . . . . .	0.25%	02/28/2023		100 122,492	0.2
	Toronto-Dominion Bank (The) . . . . .	0.25%	03/26/2024		100 123,020	0.3
					620,890	1.4
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>						
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>						
	Connecticut Avenue Securities Trust, Series 2020-R02, Class 2M1(b) . . . . .	0.86%	01/25/2040	USD	9 8,907	0.0
	Eagle RE Ltd., Series 2018-1, Class M1(b) . . . . .	1.81%	11/25/2028		52 51,864	0.1
	Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities Series 2014-C03, Class 2M2(b) . . . . .	3.03%	07/25/2024		11 10,751	0.0
	Series 2014-C04, Class 1M2(b) . . . . .	5.01%	11/25/2024		36 37,425	0.1
	Series 2014-C04, Class 2M2(b) . . . . .	5.11%	11/25/2024		15 15,748	0.0
	Series 2015-C01, Class 2M2(b) . . . . .	4.68%	02/25/2025		4 3,946	0.0
	Series 2015-C03, Class 2M2(b) . . . . .	5.13%	07/25/2025		4 3,613	0.0
	Series 2016-C01, Class 1M2(b) . . . . .	6.86%	08/25/2028		17 18,505	0.1
	Series 2016-C02, Class 1M2(b) . . . . .	6.11%	09/25/2028		44 46,417	0.1
	Series 2016-C03, Class 1M2(b) . . . . .	5.41%	10/25/2028		24 25,504	0.1
	Series 2016-C04, Class 1M2(b) . . . . .	4.36%	01/25/2029		40 41,582	0.1
	Series 2016-C06, Class 1M2(b) . . . . .	4.36%	04/25/2029		93 96,504	0.2
	Series 2017-C01, Class 1M2(b) . . . . .	3.66%	07/25/2029		27 28,365	0.1
	PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-1R, Class A(b) . . . . .	2.13%	03/27/2024		53 50,765	0.1
					439,896	1.0
<b>INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE</b>						
<b>DEUTSCHLAND</b>						
	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond . . . . .	0.10%	04/15/2026	EUR	232 303,683	0.7
<b>QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE</b>						
<b>QUASI-STAATSANLEIHEN</b>						
CHINA	State Grid Overseas Investment 2016 Ltd. . . . .	1.25%	05/19/2022		100 122,201	0.2
MEXIKO	Petroleos Mexicanos . . . . .	6.75%	09/21/2047	USD	25 21,881	0.1
					144,082	0.3
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>						
<b>NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS</b>						
	GS Mortgage Securities Corp. II, Series 2013-GC10, Class C . . . . .	4.29%	02/10/2046		75 77,751	0.2
	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-CBX, Class C . . . . .	5.13%	06/15/2045		55 47,990	0.1
					125,741	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN</b>					
KANADA					
Province of Ontario Canada . . . . .	6.50%	03/08/2029	CAD 115	\$ 121,599	0.3%
<b>GEMEINDEVERWALTUNG – REGIONALANLEIHEN</b>					
JAPAN					
Japan Finance Organization for Municipalities, Series GMTN . . . . .	0.01%	02/02/2028	EUR 100	120,565	0.3
<b>ABS-ANLEIHEN</b>					
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Flagship Credit Auto Trust, Series 2018-3, Class D . . . . .	4.15%	12/16/2024	USD 39	41,130	0.1
<b>Gesamtanlagen</b>				\$ 42,135,703	97.6%
(Kosten \$35,305,413) . . . . .					
<b>Termineinlagen</b>					
Barclays, London(c) . . . . .	0.00 %	–		40,305	0.1
BBH, Grand Cayman(c) . . . . .	(1.37)%	–		2,840	0.0
BBH, Grand Cayman(c) . . . . .	(0.71)%	–		637	0.0
BBH, Grand Cayman(c) . . . . .	(0.56)%	–		1,961	0.0
BBH, Grand Cayman(c) . . . . .	(0.30)%	–		17,708	0.0
BBH, Grand Cayman(c) . . . . .	(0.29)%	–		1,427	0.0
BBH, Grand Cayman(c) . . . . .	(0.06)%	–		3,193	0.0
BBH, Grand Cayman(c) . . . . .	0.00 %	–		12,341	0.0
BBH, Grand Cayman(c) . . . . .	0.01 %	–		3,504	0.0
BBH, Grand Cayman(c) . . . . .	0.07 %	–		1,496	0.0
BBH, Grand Cayman(c) . . . . .	2.80 %	–		563	0.0
BNP Paribas, Paris(c) . . . . .	(0.71)%	–		223,698	0.5
Sumitomo Trust Bank, London(c) . . . . .	0.00 %	–		1,184,809	2.8
<b>Termineinlagen insgesamt</b> . . . . .				1,494,482	3.4
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> . . . . .				(443,052)	(1.0)
<b>Nettovermögen</b> . . . . .				\$ 43,187,133	100.0%

**TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Long</b>					
10 Yr Australian Bond Futures . . . . .	03/15/2021	7	\$ 788,424	\$ 738,284	\$ (50,140)
10 Yr Canadian Bond Futures . . . . .	06/21/2021	2	223,558	219,676	(3,882)
10 Yr Mini Japan Government Bond Futures . . . . .	03/12/2021	5	713,326	707,350	(5,976)
E-Mini Russell 2000 Index Futures . . . . .	03/19/2021	1	95,085	109,960	14,875
Euro-Bund Futures . . . . .	03/08/2021	2	427,565	418,431	(9,134)
Korea 3 Yr Bond Futures . . . . .	03/16/2021	5	496,547	495,951	(596)
MSCI Emerging Markets Index Futures . . . . .	03/19/2021	5	328,946	334,525	5,579
MSCI Singapore IX ETS Futures . . . . .	03/30/2021	5	125,061	126,060	999
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures . . . . .	06/30/2021	2	441,891	441,532	(359)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures . . . . .	06/30/2021	5	621,797	619,844	(1,953)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures . . . . .	06/21/2021	5	671,211	663,594	(7,617)
<b>Short</b>					
Euro Buxl 30 Yr Bond Futures . . . . .	03/08/2021	1	269,181	253,158	16,023
EURO STOXX 50 Index Futures . . . . .	03/19/2021	10	435,962	438,573	(2,611)
Euro-BOBL Futures . . . . .	03/08/2021	8	1,302,254	1,295,449	6,805
Euro-Schatz Futures . . . . .	03/08/2021	4	541,832	541,355	477
FTSE 100 Index Futures . . . . .	03/19/2021	5	454,771	451,028	3,743
Long Gilt Futures . . . . .	06/28/2021	4	720,173	712,037	8,136
Omx30 Ind Future . . . . .	03/19/2021	2	47,745	47,472	273
S&P 500 E-Mini Futures . . . . .	03/19/2021	11	2,051,816	2,095,087	(43,271)
S&P/TSX 60 Index Futures . . . . .	03/18/2021	1	171,664	168,443	3,221
SPI 200 Futures . . . . .	03/18/2021	1	130,507	127,650	2,857
TOPIX Index Futures . . . . .	03/11/2021	1	179,793	177,043	2,750
					\$ (59,801)
				Wertsteigerung	\$ 65,738
				Wertminderung	\$ (125,539)

**DEWISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Barclays Bank PLC	USD 27	RUB 2,036	03/24/2021	\$ (282)
Barclays Bank PLC	USD 154	RUB 11,685	03/24/2021	1,875
Barclays Bank PLC	KRW 12,300	USD 11	04/22/2021	337
BNP Paribas SA	COP 1,108,832	USD 323	03/18/2021	18,709
BNP Paribas SA	USD 42	CLP 29,654	03/18/2021	(708)
BNP Paribas SA	GBP 472	USD 642	04/09/2021	(14,616)
BNP Paribas SA	CAD 880	USD 693	04/22/2021	1,790
Brown Brothers Harriman & Co.	NZD 117	USD 86	03/05/2021	1,777
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 93	NZD 128	03/05/2021	(73)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 109	NZD 152	03/05/2021	1,011
Brown Brothers Harriman & Co.	SGD 104	USD 78	03/11/2021	250
Brown Brothers Harriman & Co.	THB 1,102	USD 37	03/11/2021	208
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 97	SGD 128	03/11/2021	(1,051)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 147	USD 176	03/17/2021	(1,089)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 3,013	USD 3,669	03/17/2021	32,608
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 1,101	EUR 904	03/17/2021	(9,226)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 103	EUR 86	03/17/2021	310
Brown Brothers Harriman & Co.	PLN 288	USD 77	03/24/2021	219
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 78	PLN 287	03/24/2021	(1,510)
Brown Brothers Harriman & Co.	ILS 313	USD 96	03/25/2021	1,302
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 26	TRY 200	03/26/2021	418
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD 433	USD 337	03/30/2021	3,612
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 140	AUD 180	03/30/2021	(1,815)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 97	AUD 126	03/30/2021	333
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 599	USD 820	04/09/2021	(16,018)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 159	GBP 113	04/09/2021	(1,494)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 399	GBP 290	04/09/2021	5,895
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK 725	USD 85	04/15/2021	1,648
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK 2,493	USD 300	04/15/2021	4,957
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 221	NOK 1,873	04/15/2021	(4,645)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 323	SEK 2,717	04/15/2021	(2,227)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 155	MXN 3,195	04/16/2021	(2,739)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD 453	USD 359	04/22/2021	3,141
Brown Brothers Harriman & Co.	CNH 615	USD 94	04/22/2021	29
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 535	CAD 679	04/22/2021	(2,491)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF 341	USD 384	05/06/2021	8,108
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY 24,220	USD 228	05/20/2021	1,197
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 446	JPY 47,226	05/20/2021	(2,710)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 4,962	EUR 4,122	03/05/2021	13,774
Citibank, NA	USD 37	CLP 27,186	03/18/2021	485
Citibank, NA	KRW 178,853	USD 164	04/22/2021	5,353
Citibank, NA	USD 70	KRW 76,716	04/22/2021	(2,296)
Deutsche Bank AG	USD 116	INR 8,641	04/15/2021	(120)
Goldman Sachs Bank USA	USD 67	KRW 73,602	04/22/2021	(1,513)
HSBC Bank USA	USD 39	IDR 547,922	04/15/2021	(1,329)
JPMorgan Chase Bank, NA	IDR 542,673	USD 38	04/15/2021	1,031
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR 525	USD 636	03/17/2021	2,232
Morgan Stanley Capital Services LLC	MYR 278	USD 67	03/25/2021	(1,567)
Morgan Stanley Capital Services LLC	AUD 1,506	USD 1,168	03/30/2021	9,760
Morgan Stanley Capital Services LLC	KRW 9,140	USD 8	04/22/2021	324
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 78	CNH 506	04/22/2021	(154)
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY 245,137	USD 2,314	05/20/2021	11,944
Standard Chartered Bank	KRW 35,545	USD 32	04/22/2021	376
Standard Chartered Bank	USD 8	KRW 8,633	04/22/2021	(145)
UBS AG	EUR 3,614	USD 4,415	03/17/2021	52,578
UBS AG	KRW 23,454	USD 21	04/22/2021	258
				\$ 118,031
			Wertsteigerung	\$ 187,849
			Wertminderung	\$ (69,818)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Credit Suisse Securities (USA) LLC/(LCH Group)	EUR 100	11/10/2050	6 Month EURIBOR	(0.043)%	\$ (14,174)
Credit Suisse Securities (USA) LLC/(LCH Group)	100	09/30/2050	6 Month EURIBOR	(0.017)%	(13,218)
Credit Suisse Securities (USA) LLC/(LCH Group)	100	09/30/2050	0.122%	6 Month EURIBOR	8,382
Credit Suisse Securities (USA) LLC/(LCH Group)	100	11/10/2050	0.022%	6 Month EURIBOR	11,121
Credit Suisse Securities (USA) LLC/(LCH Group)	CAD 860	05/22/2024	3 Month CDOR	1.980%	21,751
					<u>\$ 13,862</u>
				Wertsteigerung	\$ 41,254
				Wertminderung	\$ (27,392)

TOTAL-RETURN-SWAPS

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahler/ Erhaltener Zinssatz	Nominal- betrag (000)	Fälligkeits- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Gesamtrendite auf Referenz-Obligation zahlen</b>					
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Bloomberg Commodity Index .....	7,316	0.120%	USD 1,272	03/15/2021	\$ 169,973
UBS AG					
FTSE EPRA/NAREIT Developed Real Estate Index .....	248	3 Month LIBOR Plus 0.23%	1,380	09/15/2021	(8,505)
<b>Gesamtrendite auf Referenz-Obligation erhalten</b>					
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Swiss Market Index Future .....	10	0.00%	CHF 107	03/19/2021	3,164
Insgesamt					<u>\$ 164,632</u>
				Wertsteigerung	\$ 173,137
				Wertminderung	\$ (8,505)
Swaps insgesamt					<u>\$ 178,494</u>

- (a) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.  
 (b) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2021.  
 (c) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- CAD – Canadian Dollar
- CHF – Swiss Franc
- CLP – Chilean Peso
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- COP – Colombian Peso
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- IDR – Indonesian Rupiah
- ILS – Israeli Shekel
- INR – Indian Rupee
- JPY – Japanese Yen
- KRW – South Korean Won
- MXN – Mexican Peso
- MYR – Malaysian Ringgit
- NOK – Norwegian Krone
- NZD – New Zealand Dollar
- PLN – Polish Zloty
- RUB – Russian Ruble
- SEK – Swedish Krona
- SGD – Singapore Dollar
- THB – Thailand Baht
- TRY – Turkish Lira
- USD – United States Dollar

Glossar:

ADR	– American Depositary Receipt
BOBL	– Bundesobligationen
CBT	– Chicago Board of Trade
CDOR	– Canadian Dealer Offered Rate
CMBS	– Commercial Mortgage-Backed Securities
EPRA	– European Public Real Estate Association
ETS	– Emission Trading Scheme
EURIBOR	– Euro Interbank Offered Rate
FTSE	– Financial Times Stock Exchange
GDR	– Global Depositary Receipt
LCH	– London Clearing House
LIBOR	– London Interbank Offered Rate
MSCI	– Morgan Stanley Capital International
NAREIT	– National Association of Real Estate Investment Trusts
OAT	– Obligations Assimilables du Trésor
PJSC	– Public Joint Stock Company
REG	– Registered Shares
REIT	– Real Estate Investment Trust
SPI	– Share Price Index
TOPIX	– Tokyo Price Index
TSX	– Toronto Stock Exchange

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG</b>			
Calix, Inc. ....	26,951	\$ 1,064,826	0.9%
Juniper Networks, Inc. ....	25,873	602,333	0.5
Lumentum Holdings, Inc. ....	10,686	961,732	0.8
Motorola Solutions, Inc. ....	4,999	877,168	0.8
NetScout Systems, Inc. ....	7,413	209,182	0.2
		<u>3,715,241</u>	<u>3.2</u>
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
Arrow Electronics, Inc. ....	2,915	292,302	0.3
Flex Ltd. ....	79,131	1,439,391	1.2
Hitachi Ltd. ....	6,792	313,274	0.3
Keyence Corp. ....	1,838	876,582	0.7
		<u>2,921,549</u>	<u>2.5</u>
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
21 Vianet Group, Inc. (ADR) ....	7,624	277,824	0.2
Adyen NV ....	401	936,053	0.8
Amdocs Ltd. ....	4,483	339,836	0.3
Square, Inc. - Class A ....	3,539	813,992	0.7
Twilio, Inc. - Class A ....	1,689	663,722	0.6
Visa, Inc. - Class A ....	3,962	841,512	0.7
		<u>3,872,939</u>	<u>3.3</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
Infineon Technologies AG ....	27,791	1,209,214	1.0
NXP Semiconductors NV ....	8,540	1,559,009	1.4
		<u>2,768,223</u>	<u>2.4</u>
<b>SOFTWARE</b>			
Adobe, Inc. ....	1,826	839,175	0.7
Avast PLC ....	89,502	577,595	0.5
Citrix Systems, Inc. ....	4,692	626,812	0.5
CommVault Systems, Inc. ....	8,153	519,569	0.4
Dassault Systemes SE ....	4,839	1,004,977	0.9
Microsoft Corp. ....	12,306	2,859,466	2.5
Open Text Corp. ....	5,933	264,263	0.2
Oracle Corp. ....	20,723	1,336,859	1.1
Proofpoint, Inc. ....	6,669	806,359	0.7
Zendesk, Inc. ....	6,494	949,002	0.8
		<u>9,784,077</u>	<u>8.3</u>
<b>TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE</b>			
Apple, Inc. ....	20,216	2,451,431	2.1
NCR Corp. ....	11,448	397,934	0.3
Samsung Electronics Co., Ltd. ....	8,154	597,548	0.5
Western Digital Corp. ....	9,496	650,748	0.6
		<u>4,097,661</u>	<u>3.5</u>
		<u>27,159,690</u>	<u>23.2</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG</b>			
Airbus SE ....	4,833	561,488	0.5
Hexcel Corp. ....	19,897	1,069,642	0.9
L3Harris Technologies, Inc. ....	1,732	315,097	0.3
		<u>1,946,227</u>	<u>1.7</u>
<b>BAUPRODUKTE</b>			
Masco Corp. ....	8,394	446,729	0.4
Trex Co., Inc. ....	13,024	1,193,564	1.0
		<u>1,640,293</u>	<u>1.4</u>
<b>GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF</b>			
Tetra Tech, Inc. ....	5,699	788,638	0.7
TOMRA Systems ASA ....	21,847	932,309	0.8
Waste Management, Inc. ....	8,110	899,326	0.7
		<u>2,620,273</u>	<u>2.2</u>
<b>BAU- UND INGENIEURWESEN</b>			
AECOM ....	9,216	533,502	0.4
<b>ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG</b>			
Prysmian SpA ....	8,921	286,568	0.2
Regal Beloit Corp. ....	4,808	657,066	0.6
Rockwell Automation, Inc. ....	4,493	1,093,082	0.9

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Schneider Electric SE	9,433	\$ 1,394,912	1.2%
Vestas Wind Systems A/S	5,907	1,107,718	1.0
		<u>4,539,346</u>	<u>3.9</u>
<b>MASCHINEN</b>			
Alstom SA	8,859	441,590	0.4
Oshkosh Corp.	8,408	891,275	0.7
SMC Corp.	923	547,245	0.5
Xylem, Inc./NY	12,013	1,195,980	1.0
		<u>3,076,090</u>	<u>2.6</u>
<b>PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Recruit Holdings Co., Ltd.	18,297	914,306	0.8
Robert Half International, Inc.	10,435	811,716	0.7
		<u>1,726,022</u>	<u>1.5</u>
<b>STRASSE UND SCHIENE</b>			
Knight-Swift Transportation Holdings, Inc.	16,890	729,640	0.6
<b>HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER</b>			
AerCap Holdings NV	18,471	889,921	0.8
United Rentals, Inc.	2,079	618,374	0.5
		<u>1,508,295</u>	<u>1.3</u>
		<u>18,319,688</u>	<u>15.6</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
<b>BIOTECHNOLOGIE</b>			
Abcam PLC	35,550	839,993	0.7
<b>GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF</b>			
Alcon, Inc.	12,458	858,039	0.7
Danaher Corp.	4,338	952,936	0.8
Koninklijke Philips NV	26,050	1,422,277	1.2
Medtronic PLC	7,830	915,881	0.8
STERIS PLC	5,467	955,649	0.8
		<u>5,104,782</u>	<u>4.3</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	35,144	1,462,022	1.2
HCA Healthcare, Inc.	4,206	723,499	0.6
Laboratory Corp. of America Holdings	5,233	1,255,521	1.1
UnitedHealth Group, Inc.	2,333	775,058	0.7
		<u>4,216,100</u>	<u>3.6</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE</b>			
Change Healthcare, Inc.	24,203	553,531	0.5
<b>LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A	2,045	1,195,332	1.0
Bruker Corp.	19,571	1,193,423	1.0
Gerresheimer AG	5,923	611,776	0.5
ICON PLC	2,740	494,986	0.5
		<u>3,495,517</u>	<u>3.0</u>
<b>PHARMAZEUTIKA</b>			
GlaxoSmithKline PLC	35,571	593,527	0.5
Johnson & Johnson	1,865	295,455	0.3
Novo Nordisk A/S - Class B	5,339	380,872	0.3
Roche Holding AG	2,959	970,803	0.8
Sanofi	4,107	376,891	0.3
		<u>2,617,548</u>	<u>2.2</u>
		<u>16,827,471</u>	<u>14.3</u>
<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BANKEN</b>			
Bank Hapoalim BM	40,669	286,533	0.2
Bank Leumi Le-Israel BM	49,604	300,859	0.2
Bank of America Corp.	28,989	1,006,211	0.9
Bank of Ireland Group PLC	120,092	491,584	0.4
Erste Group Bank AG	35,484	1,165,183	1.0
HDFC Bank Ltd.	55,505	1,164,234	1.0
KB Financial Group, Inc.	8,939	345,982	0.3
SVB Financial Group	3,047	1,539,609	1.3
Wells Fargo & Co.	24,983	903,635	0.8
Westpac Banking Corp.	37,213	682,205	0.6
		<u>7,886,035</u>	<u>6.7</u>
<b>KAPITALMÄRKTE</b>			
Credit Suisse Group AG (REG)	21,123	305,577	0.2
IG Group Holdings PLC	29,326	319,861	0.3
Morgan Stanley	10,117	777,693	0.7

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MSCI, Inc. - Class A	2,693	\$ 1,116,301	0.9%
Partners Group Holding AG	854	1,022,716	0.9
		<u>3,542,148</u>	<u>3.0</u>
<b>FINANZWESEN – VERBRAUCHER</b>			
Synchrony Financial	15,685	606,702	0.5
<b>VERSICHERUNGEN</b>			
AIA Group Ltd.	67,007	845,052	0.7
Everest Re Group Ltd.	1,379	333,408	0.3
Intact Financial Corp.	0*	11	0.0
Reinsurance Group of America, Inc. - Class A	2,318	283,292	0.3
Suncorp Group Ltd.	73,942	566,494	0.5
		<u>2,028,257</u>	<u>1.8</u>
<b>SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG</b>			
BankUnited, Inc.	10,458	420,312	0.4
Essent Group Ltd.	8,742	360,443	0.3
		<u>780,755</u>	<u>0.7</u>
		<u>14,843,897</u>	<u>12.7</u>
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>			
Aptiv PLC	9,274	1,389,640	1.2
Faurecia SE	11,363	587,865	0.5
Toyo Tire Corp.	19,267	338,206	0.3
		<u>2,315,711</u>	<u>2.0</u>
<b>KRAFTFAHRZEUGE</b>			
Stellantis NV	40,558	656,903	0.6
Suzuki Motor Corp.	5,947	259,408	0.2
		<u>916,311</u>	<u>0.8</u>
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
Entain PLC	53,946	1,067,230	0.9
Papa John's International, Inc.	2,874	259,169	0.2
		<u>1,326,399</u>	<u>1.1</u>
<b>HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER</b>			
PulteGroup, Inc.	16,469	742,928	0.6
Sony Corp.	3,992	421,540	0.4
TopBuild Corp.	5,519	1,050,788	0.9
		<u>2,215,256</u>	<u>1.9</u>
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
Alibaba Group Holding Ltd.	8,289	249,081	0.2
MercadoLibre, Inc.	314	513,937	0.4
		<u>763,018</u>	<u>0.6</u>
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>			
AutoZone, Inc.	454	526,801	0.5
Foot Locker, Inc.	12,874	619,090	0.5
		<u>1,145,891</u>	<u>1.0</u>
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
NIKE, Inc. - Class B	8,480	1,142,922	1.0
Pandora A/S	5,522	536,138	0.5
Tapestry, Inc.	11,644	490,698	0.4
		<u>2,169,758</u>	<u>1.9</u>
		<u>10,852,344</u>	<u>9.3</u>
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>			
<b>GETRÄNKE</b>			
Carlsberg AS - Class B	1,871	293,744	0.3
Coca-Cola Co. (The)	11,843	580,191	0.5
Molson Coors Beverage Co. - Class B	6,160	273,803	0.2
		<u>1,147,738</u>	<u>1.0</u>
<b>LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL</b>			
Koninklijke Ahold Delhaize NV	13,211	348,824	0.3
Walmart, Inc.	4,850	630,144	0.5
		<u>978,968</u>	<u>0.8</u>
<b>LEBENSMITTELPRODUKTE</b>			
Hain Celestial Group, Inc. (The)	12,248	516,635	0.4
Kerry Group PLC - Class A	6,301	760,632	0.7
Nichirei Corp.	9,185	238,701	0.2
Nomad Foods Ltd.	9,304	219,769	0.2
Salmar ASA	4,345	284,977	0.2
WH Group Ltd.	337,216	302,452	0.3
		<u>2,323,166</u>	<u>2.0</u>



	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>HAUSHALTSPRODUKTE</b>			
Procter & Gamble Co. (The) .....	4,866	\$ 601,108	0.5%
<b>TABAK</b>			
Philip Morris International, Inc. ....	8,226	691,181	0.6
		<u>5,742,161</u>	<u>4.9</u>
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>			
<b>DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Charter Communications, Inc. - Class A .....	895	549,073	0.5
Comcast Corp. - Class A .....	21,974	1,158,458	1.0
Nippon Telegraph & Telephone Corp. ....	15,448	400,178	0.3
		<u>2,107,709</u>	<u>1.8</u>
<b>UNTERHALTUNG</b>			
Nintendo Co., Ltd. ....	845	516,904	0.5
<b>INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Alphabet, Inc. - Class A .....	443	895,642	0.7
Facebook, Inc. - Class A .....	1,415	364,652	0.3
Tencent Holdings Ltd. ....	12,040	1,047,406	0.9
Z Holdings Corp. ....	51,201	312,597	0.3
		<u>2,620,297</u>	<u>2.2</u>
		<u>5,244,910</u>	<u>4.5</u>
<b>GRUNDSTOFFE</b>			
<b>CHEMIKALIEN</b>			
Chr Hansen Holding A/S .....	11,470	983,562	0.9
Koninklijke DSM NV .....	5,908	974,185	0.8
LyondellBasell Industries NV - Class A .....	4,728	487,415	0.4
Tosoh Corp. ....	36,140	664,359	0.6
Trinseo SA .....	4,096	265,058	0.2
Westlake Chemical Corp. ....	2,782	238,115	0.2
		<u>3,612,694</u>	<u>3.1</u>
<b>METALL UND BERGBAU</b>			
Agnico Eagle Mines Ltd. ....	4,529	252,808	0.2
Northern Star Resources Ltd. ....	28,300	219,203	0.2
Reliance Steel & Aluminum Co. ....	2,117	279,879	0.3
South32 Ltd. ....	239,660	509,260	0.4
		<u>1,261,150</u>	<u>1.1</u>
		<u>4,873,844</u>	<u>4.2</u>
<b>VERSORGUNG</b>			
<b>STROMVERSORGUNGSBETRIEBE</b>			
EDP - Energias de Portugal SA .....	97,879	561,013	0.5
Enel SpA .....	105,746	997,071	0.9
NextEra Energy, Inc. ....	18,562	1,363,932	1.1
Power Grid Corp. of India Ltd. ....	81,338	237,416	0.2
		<u>3,159,432</u>	<u>2.7</u>
<b>GASVERSORGUNGSBETRIEBE</b>			
China Resources Gas Group Ltd. ....	59,673	298,327	0.3
Kunlun Energy Co., Ltd. ....	388,998	357,304	0.3
		<u>655,631</u>	<u>0.6</u>
<b>WASSERVERSORGER</b>			
American Water Works Co., Inc. ....	4,475	634,891	0.5
		<u>4,449,954</u>	<u>3.8</u>
<b>IMMOBILIEN</b>			
<b>AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)</b>			
Americold Realty Trust .....	14,556	510,037	0.4
Medical Properties Trust, Inc. ....	13,603	293,682	0.3
MGM Growth Properties LLC - Class A .....	11,683	385,778	0.3
Mid-America Apartment Communities, Inc. ....	2,759	371,669	0.3
Omega Healthcare Investors, Inc. ....	4,398	163,346	0.1
		<u>1,724,512</u>	<u>1.4</u>
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG</b>			
Aroundtown SA .....	53,155	386,521	0.3
Vonovia SE .....	4,677	297,889	0.3
		<u>684,410</u>	<u>0.6</u>
		<u>2,408,922</u>	<u>2.0</u>
<b>ENERGIE</b>			
<b>ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE</b>			
ENEOS Holdings, Inc. ....	88,309	390,499	0.3
Repsol SA .....	34,952	439,972	0.4

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
Royal Dutch Shell PLC - Class A (a) . . . . .			48,813	\$ 1,007,377	0.8%
Royal Dutch Shell PLC - Class A (London) (a) . . . . .			5,121	104,748	0.1
				<u>1,942,596</u>	<u>1.6</u>
<b>Gesamtanlagen</b>				\$ <u>112,665,477</u>	<u>96.1%</u>
(Kosten \$91,878,446) . . . . .					
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(b) . . . . .	0.00 %	–		2,654,362	2.3
Bank of Nova Scotia, Toronto(b) . . . . .	0.00 %	–		5,815	0.0
BBH, Grand Cayman(b) . . . . .	(0.56)%	–		11,555	0.0
BBH, Grand Cayman(b) . . . . .	(0.29)%	–		218	0.0
BBH, Grand Cayman(b) . . . . .	0.00 %	–		448	0.0
BNP Paribas, Paris(b) . . . . .	(1.37)%	–		11,604	0.1
BNP Paribas, Paris(b) . . . . .	(0.06)%	–		9,260	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b) . . . . .	0.00 %	–		11,575	0.0
HSBC Continental Europe, Paris(b) . . . . .	(0.71)%	–		5,943	0.0
MUFG, Tokyo(b) . . . . .	(0.30)%	–		5,809	0.0
National Australia Bank, London(b) . . . . .	(0.06)%	–		5,904	0.0
SEB, Stockholm(b) . . . . .	(0.29)%	–		4,741	0.0
SEB, Stockholm(b) . . . . .	0.00 %	–		11,209	0.0
Sumitomo Trust Bank, London(b) . . . . .	(0.30)%	–		5,716	0.0
Sumitomo Trust Bank, London(b) . . . . .	0.00 %	–		5,844	0.0
<b>Termineinlagen insgesamt</b> . . . . .				<u>2,750,003</u>	<u>2.4</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> . . . . .				<u>1,779,003</u>	<u>1.5</u>
<b>Nettovermögen</b> . . . . .				\$ <u>117,194,483</u>	<u>100.0%</u>

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA . . . . .	USD 477	EUR 391	03/15/2021	\$ (5,183)
Bank of America, NA . . . . .	USD 79	GBP 59	03/15/2021	3,730
Bank of America, NA . . . . .	USD 59	SEK 509	03/15/2021	913
Bank of America, NA . . . . .	EUR 141	USD 172	03/17/2021	1,428
Bank of America, NA . . . . .	USD 97	GBP 71	04/09/2021	1,403
Bank of America, NA . . . . .	EUR 103	USD 124	06/16/2021	(460)
Barclays Bank PLC . . . . .	BRL 1,656	USD 305	03/02/2021	9,199
Barclays Bank PLC . . . . .	USD 55	GBP 41	03/15/2021	2,443
Barclays Bank PLC . . . . .	USD 168	JPY 17,636	03/15/2021	(2,950)
Barclays Bank PLC . . . . .	EUR 329	USD 400	03/17/2021	2,832
Barclays Bank PLC . . . . .	USD 304	BRL 1,656	04/05/2021	(9,249)
Barclays Bank PLC . . . . .	USD 113	GBP 82	04/09/2021	865
Barclays Bank PLC . . . . .	INR 47,746	USD 650	04/15/2021	8,981
Barclays Bank PLC . . . . .	USD 89	TWD 2,472	04/27/2021	66
BNP Paribas SA . . . . .	USD 72	AUD 99	03/15/2021	3,639
BNP Paribas SA . . . . .	USD 87	CNH 582	03/15/2021	2,330
BNP Paribas SA . . . . .	USD 122	ZAR 1,844	03/15/2021	(582)
Brown Brothers Harriman & Co. . . . .	CHF 107	USD 118	03/15/2021	(113)
Brown Brothers Harriman & Co. . . . .	EUR 133	USD 156	03/15/2021	(3,632)
Brown Brothers Harriman & Co. . . . .	EUR 201	USD 246	03/15/2021	2,184
Brown Brothers Harriman & Co. . . . .	HKD 995	USD 128	03/15/2021	67
Brown Brothers Harriman & Co. . . . .	USD 95	CHF 86	03/15/2021	(730)
Brown Brothers Harriman & Co. . . . .	USD 933	EUR 763	03/15/2021	(12,414)
Brown Brothers Harriman & Co. . . . .	EUR 184	USD 223	03/17/2021	686
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . .	USD 6,682	EUR 5,553	03/05/2021	17,755
Citibank, NA . . . . .	USD 236	BRL 1,277	03/02/2021	(8,178)
Citibank, NA . . . . .	CHF 152	USD 170	03/15/2021	2,803
Citibank, NA . . . . .	EUR 1,129	USD 1,337	03/15/2021	(23,665)
Citibank, NA . . . . .	EUR 113	USD 138	03/15/2021	1,333
Citibank, NA . . . . .	NOK 278	USD 32	03/15/2021	(258)
Citibank, NA . . . . .	USD 685	CAD 875	03/15/2021	3,135
Citibank, NA . . . . .	USD 652	EUR 535	03/15/2021	(5,608)
Citibank, NA . . . . .	USD 238	JPY 24,947	03/15/2021	(4,061)
Citibank, NA . . . . .	USD 693	KRW 755,409	04/22/2021	(22,982)
Citibank, NA . . . . .	USD 102	TWD 2,829	04/27/2021	(261)
Citibank, NA . . . . .	CHF 137	USD 154	05/06/2021	3,355
Citibank, NA . . . . .	EUR 43	USD 52	06/16/2021	(143)
Credit Suisse International . . . . .	USD 56	AUD 76	03/15/2021	2,754
Deutsche Bank AG . . . . .	NOK 723	USD 80	03/15/2021	(3,509)
Deutsche Bank AG . . . . .	INR 76,921	USD 1,034	04/15/2021	1,069
Deutsche Bank AG . . . . .	USD 204	KRW 224,042	04/22/2021	(4,665)
Goldman Sachs Bank USA . . . . .	AUD 968	USD 725	03/15/2021	(20,222)

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Goldman Sachs Bank USA	EUR	6,781	USD	8,241	03/15/2021	\$ 56,092
Goldman Sachs Bank USA	EUR	244	USD	293	03/15/2021	(1,419)
Goldman Sachs Bank USA	JPY	65,190	USD	621	03/15/2021	8,906
Goldman Sachs Bank USA	USD	1,009	AUD	1,340	03/15/2021	22,465
Goldman Sachs Bank USA	USD	208	CHF	187	03/15/2021	(2,760)
Goldman Sachs Bank USA	USD	56	CNH	376	03/15/2021	1,407
Goldman Sachs Bank USA	USD	707	EUR	577	03/15/2021	(9,477)
Goldman Sachs Bank USA	USD	72	GBP	55	03/15/2021	4,629
Goldman Sachs Bank USA	USD	243	SEK	2,053	03/15/2021	113
Goldman Sachs Bank USA	EUR	273	USD	332	03/17/2021	3,020
Goldman Sachs Bank USA	USD	96	RUB	7,160	03/24/2021	(664)
Goldman Sachs Bank USA	USD	304	AUD	393	03/30/2021	(1,133)
Goldman Sachs Bank USA	INR	10,445	USD	142	04/15/2021	1,272
Goldman Sachs Bank USA	USD	148	INR	10,973	04/15/2021	(985)
Goldman Sachs Bank USA	USD	267	CNH	1,732	04/22/2021	(403)
Goldman Sachs Bank USA	USD	97	TWD	2,662	04/27/2021	(582)
HSBC Bank USA	ILS	280	USD	85	03/15/2021	952
HSBC Bank USA	USD	207	CNH	1,338	04/22/2021	(1,640)
JPMorgan Chase Bank, NA	CHF	126	USD	139	03/15/2021	264
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR	129	USD	157	03/15/2021	1,118
JPMorgan Chase Bank, NA	NOK	936	USD	103	03/15/2021	(4,847)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	228	CHF	201	03/15/2021	(5,606)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	687	CNH	4,528	03/15/2021	10,675
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	55	GBP	41	03/15/2021	3,099
JPMorgan Chase Bank, NA	INR	12,115	USD	164	04/15/2021	1,748
JPMorgan Chase Bank, NA	NOK	3,032	USD	357	04/15/2021	7,493
Morgan Stanley Capital Services LLC	AUD	207	USD	159	03/15/2021	(451)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	111	USD	135	03/15/2021	1,901
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	332	USD	394	03/15/2021	(6,722)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	221	CAD	289	03/15/2021	5,843
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	102	JPY	10,603	03/15/2021	(2,589)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	766	USD	930	03/17/2021	5,148
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	89	SEK	738	04/15/2021	(1,686)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	486	CAD	616	04/22/2021	(1,564)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	840	CNH	5,458	04/22/2021	(1,663)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	116	KRW	128,281	04/22/2021	(2,024)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	643	TWD	17,707	04/27/2021	(3,240)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CHF	102	USD	115	05/06/2021	2,587
Royal Bank of Scotland PLC	CNH	900	USD	140	03/15/2021	843
Royal Bank of Scotland PLC	HKD	263	USD	34	03/15/2021	19
Royal Bank of Scotland PLC	ILS	1,061	USD	326	03/15/2021	5,980
Royal Bank of Scotland PLC	USD	69	CAD	90	03/15/2021	1,900
Royal Bank of Scotland PLC	USD	726	EUR	603	03/15/2021	1,921
Royal Bank of Scotland PLC	USD	460	GBP	342	03/15/2021	16,278
Royal Bank of Scotland PLC	USD	67	GBP	49	04/09/2021	1,266
Royal Bank of Scotland PLC	INR	10,888	USD	148	04/15/2021	1,239
Royal Bank of Scotland PLC	NOK	2,097	USD	246	04/15/2021	4,639
Royal Bank of Scotland PLC	USD	119	TWD	3,312	04/27/2021	439
Standard Chartered Bank	USD	70	BRL	379	03/02/2021	(1,924)
Standard Chartered Bank	USD	462	JPY	48,126	03/15/2021	(10,932)
Standard Chartered Bank	USD	160	INR	11,663	04/15/2021	(2,964)
State Street Bank & Trust Co.	EUR	177	USD	215	03/17/2021	1,989
State Street Bank & Trust Co.	USD	99	GBP	71	04/09/2021	609
UBS AG	CHF	238	USD	269	03/15/2021	7,047
UBS AG	USD	220	AUD	283	03/15/2021	(2,054)
UBS AG	USD	257	GBP	197	03/15/2021	17,580
UBS AG	EUR	122	USD	150	03/17/2021	2,570
UBS AG	USD	73	RUB	5,617	03/24/2021	1,722
UBS AG	USD	84	ZAR	1,270	04/08/2021	(285)
UBS AG	HKD	744	USD	96	05/21/2021	37
						\$ 81,301
					Wertsteigerung	\$ 277,780
					Wertminderung	\$ (196,479)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

\* Betrag geringer als 0.5.

(a) Stellt sämtliche oder einen Teil der verliehenen Wertpapiere dar. Informationen zur Wertpapierleihe finden Sie in Anmerkung N.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	–	Australian Dollar
BRL	–	Brazilian Real
CAD	–	Canadian Dollar
CHF	–	Swiss Franc
CNH	–	Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
EUR	–	Euro
GBP	–	Great British Pound
HKD	–	Hong Kong Dollar
ILS	–	Israeli Shekel
INR	–	Indian Rupee
JPY	–	Japanese Yen
KRW	–	South Korean Won
NOK	–	Norwegian Krone
RUB	–	Russian Ruble
SEK	–	Swedish Krona
TWD	–	New Taiwan Dollar
USD	–	United States Dollar
ZAR	–	South African Rand

Glossar:

ADR	–	American Depositary Receipt
REG	–	Registered Shares
REIT	–	Real Estate Investment Trust

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG</b>			
Juniper Networks, Inc. ....	228,207	\$ 5,312,649	1.0%
NetScout Systems, Inc. ....	65,379	1,845,008	0.4
		<u>7,157,657</u>	<u>1.4</u>
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
Arrow Electronics, Inc. ....	25,715	2,578,141	0.5
Hitachi Ltd. ....	59,908	2,763,114	0.5
		<u>5,341,255</u>	<u>1.0</u>
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
21 Vianet Group, Inc. (ADR) ....	67,246	2,450,439	0.4
Amdocs Ltd. ....	39,538	2,997,396	0.6
		<u>5,447,835</u>	<u>1.0</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
NXP Semiconductors NV ....	26,370	4,813,883	0.9
<b>SOFTWARE</b>			
Avast PLC ....	789,418	5,094,456	1.0
Citrix Systems, Inc. ....	41,388	5,528,554	1.1
CommVault Systems, Inc. ....	71,907	4,582,655	0.9
Microsoft Corp. ....	70,030	16,273,612	3.1
Open Text Corp. ....	52,333	2,330,831	0.4
Oracle Corp. ....	182,782	11,791,249	2.2
		<u>45,601,357</u>	<u>8.7</u>
<b>TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE</b>			
Apple, Inc. ....	107,823	13,074,653	2.5
NCR Corp. ....	100,973	3,509,820	0.7
Samsung Electronics Co., Ltd. ....	71,916	5,270,437	1.0
Western Digital Corp. ....	83,754	5,739,674	1.1
		<u>27,594,584</u>	<u>5.3</u>
		<u>95,956,571</u>	<u>18.3</u>
<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BANKEN</b>			
Bank Hapoalim BM ....	358,709	2,527,256	0.5
Bank Leumi Le-Israel BM ....	437,516	2,653,606	0.5
Bank of America Corp. ....	255,687	8,874,893	1.7
Bank of Ireland Group PLC ....	1,059,230	4,335,827	0.8
KB Financial Group, Inc. ....	78,841	3,051,604	0.6
Wells Fargo & Co. ....	220,353	7,970,168	1.5
Westpac Banking Corp. ....	328,227	6,017,124	1.1
		<u>35,430,478</u>	<u>6.7</u>
<b>KAPITALMÄRKTE</b>			
Credit Suisse Group AG (REG) ....	186,307	2,695,223	0.5
IG Group Holdings PLC ....	258,654	2,821,211	0.6
Morgan Stanley ....	89,233	6,859,341	1.3
		<u>12,375,775</u>	<u>2.4</u>
<b>FINANZWESEN – VERBRAUCHER</b>			
Synchrony Financial ....	138,345	5,351,179	1.0
<b>VERSICHERUNGEN</b>			
Everest Re Group Ltd. ....	12,161	2,940,699	0.6
Intact Financial Corp. ....	1	101	0.0
Reinsurance Group of America, Inc. - Class A ....	20,442	2,498,663	0.5
Suncorp Group Ltd. ....	652,178	4,996,544	0.9
		<u>10,436,007</u>	<u>2.0</u>
<b>SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG</b>			
BankUnited, Inc. ....	92,242	3,707,201	0.7
Essent Group Ltd. ....	77,108	3,179,152	0.6
		<u>6,886,353</u>	<u>1.3</u>
		<u>70,479,792</u>	<u>13.4</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG</b>			
Airbus SE ....	42,629	4,952,393	1.0
L3Harris Technologies, Inc. ....	15,278	2,779,192	0.5
		<u>7,731,585</u>	<u>1.5</u>
<b>BAUPRODUKTE</b>			
Masco Corp. ....	74,036	3,940,196	0.8

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>BAU- UND INGENIEURWESEN</b>			
AECOM .....	81,284	\$ 4,705,544	0.9%
<b>ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG</b>			
Prysmian SpA .....	78,689	2,527,563	0.5
Regal Beloit Corp. ....	42,404	5,795,398	1.1
Schneider Electric SE (Paris) .....	22,769	3,366,887	0.6
		<u>11,689,848</u>	<u>2.2</u>
<b>MASCHINEN</b>			
Alstom SA .....	78,140	3,894,870	0.7
Oshkosh Corp. ....	74,162	7,861,145	1.5
		<u>11,756,015</u>	<u>2.2</u>
<b>PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Robert Half International, Inc. ....	92,035	7,159,425	1.4
<b>STRASSE UND SCHIENE</b>			
Knight-Swift Transportation Holdings, Inc. ....	148,970	6,435,512	1.2
<b>HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER</b>			
AerCap Holdings NV .....	162,914	7,849,208	1.5
United Rentals, Inc. ....	18,341	5,454,126	1.0
		<u>13,303,334</u>	<u>2.5</u>
		<u>66,721,459</u>	<u>12.7</u>
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>			
Faurecia SE .....	100,227	5,185,040	1.0
Toyo Tire Corp. ....	169,933	2,983,021	0.6
		<u>8,168,061</u>	<u>1.6</u>
<b>KRAFTFAHRZEUGE</b>			
Stellantis NV .....	357,724	5,793,961	1.1
Suzuki Motor Corp. ....	52,453	2,288,004	0.4
		<u>8,081,965</u>	<u>1.5</u>
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
Entain PLC .....	475,814	9,413,093	1.8
Papa John's International, Inc. ....	25,345	2,285,903	0.4
		<u>11,698,996</u>	<u>2.2</u>
<b>HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER</b>			
PulteGroup, Inc. ....	145,261	6,552,712	1.3
Sony Corp. ....	35,208	3,718,027	0.7
		<u>10,270,739</u>	<u>2.0</u>
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
Alibaba Group Holding Ltd. ....	73,111	2,196,923	0.4
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>			
AutoZone, Inc. ....	4,006	4,646,443	0.9
Foot Locker, Inc. ....	113,546	5,460,447	1.0
		<u>10,106,890</u>	<u>1.9</u>
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
Pandora A/S .....	48,708	4,728,801	0.9
Tapestry, Inc. ....	102,706	4,328,011	0.8
		<u>9,056,812</u>	<u>1.7</u>
		<u>59,580,386</u>	<u>11.3</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
<b>GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF</b>			
Medtronic PLC .....	69,062	8,078,176	1.6
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
HCA Healthcare, Inc. ....	37,094	6,381,340	1.2
UnitedHealth Group, Inc. ....	20,577	6,836,102	1.3
		<u>13,217,442</u>	<u>2.5</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE</b>			
Change Healthcare, Inc. ....	213,477	4,882,210	0.9
<b>PHARMAZEUTIKA</b>			
GlaxoSmithKline PLC .....	313,739	5,234,978	1.0
Johnson & Johnson .....	16,445	2,605,948	0.5
Novo Nordisk A/S - Class B .....	47,091	3,359,332	0.7
Roche Holding AG .....	26,101	8,562,592	1.6
Sanofi .....	36,223	3,324,222	0.6
		<u>23,087,072</u>	<u>4.4</u>
		<u>49,264,900</u>	<u>9.4</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>			
<b>GETRÄNKE</b>			
Carlsberg AS - Class B	16,499	\$ 2,590,858	0.5%
Coca-Cola Co. (The)	104,457	5,117,347	1.0
Molson Coors Beverage Co. - Class B	54,330	2,414,977	0.4
		<u>10,123,182</u>	<u>1.9</u>
<b>LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL</b>			
Koninklijke Ahold Delhaize NV	116,519	3,076,664	0.6
Walmart, Inc.	42,780	5,557,945	1.1
		<u>8,634,609</u>	<u>1.7</u>
<b>LEBENSMITTELPRODUKTE</b>			
Hain Celestial Group, Inc. (The)	108,032	4,556,776	0.8
Nichirei Corp.	81,015	2,105,371	0.4
Nomad Foods Ltd.	82,066	1,938,390	0.4
Salmar ASA	38,325	2,513,526	0.5
WH Group Ltd.	2,974,284	2,667,665	0.5
		<u>13,781,728</u>	<u>2.6</u>
<b>TABAK</b>			
Philip Morris International, Inc.	72,558	6,096,291	1.2
		<u>38,635,810</u>	<u>7.4</u>
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>			
<b>DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Charter Communications, Inc. - Class A	7,895	4,842,889	0.9
Comcast Corp. - Class A	193,811	10,217,728	1.9
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	136,252	3,529,619	0.7
		<u>18,590,236</u>	<u>3.5</u>
<b>UNTERHALTUNG</b>			
Nintendo Co., Ltd.	7,455	4,559,150	0.9
<b>INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Alphabet, Inc. - Class A	3,907	7,899,666	1.5
Facebook, Inc. - Class A	12,485	3,216,267	0.6
Z Holdings Corp.	451,599	2,757,141	0.6
		<u>13,873,074</u>	<u>2.7</u>
		<u>37,022,460</u>	<u>7.1</u>
<b>GRUNDSTOFFE</b>			
<b>CHEMIKALIEN</b>			
LyondellBasell Industries NV - Class A	41,702	4,299,054	0.8
Tosoh Corp.	318,760	5,859,726	1.1
Trinseo SA	36,128	2,337,837	0.5
Westlake Chemical Corp.	24,538	2,100,204	0.4
		<u>14,596,821</u>	<u>2.8</u>
<b>METALL UND BERGBAU</b>			
Agnico Eagle Mines Ltd.	39,944	2,229,796	0.4
Northern Star Resources Ltd.	249,610	1,933,393	0.4
Reliance Steel & Aluminum Co.	18,673	2,468,560	0.5
South32 Ltd.	2,113,824	4,491,734	0.8
		<u>11,123,483</u>	<u>2.1</u>
		<u>25,720,304</u>	<u>4.9</u>
<b>VERSORGUNG</b>			
<b>STROMVERSORGBETRIEBE</b>			
EDP - Energias de Portugal SA	863,303	4,948,200	0.9
Enel SpA	932,694	8,794,277	1.7
NextEra Energy, Inc.	51,645	3,794,851	0.7
Power Grid Corp. of India Ltd.	717,409	2,094,034	0.4
		<u>19,631,362</u>	<u>3.7</u>
<b>GASVERSORGBETRIEBE</b>			
China Resources Gas Group Ltd.	526,327	2,631,277	0.5
Kunlun Energy Co., Ltd.	3,431,002	3,151,468	0.6
		<u>5,782,745</u>	<u>1.1</u>
		<u>25,414,107</u>	<u>4.8</u>
<b>IMMOBILIEN</b>			
<b>AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)</b>			
Americold Realty Trust	128,384	4,498,581	0.9
Medical Properties Trust, Inc.	119,977	2,590,310	0.5
MGM Growth Properties LLC - Class A	103,047	3,402,606	0.6
Mid-America Apartment Communities, Inc.	24,331	3,278,166	0.6
Omega Healthcare Investors, Inc.	38,792	1,440,731	0.3
		<u>15,210,394</u>	<u>2.9</u>



	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG</b>					
Aroundtown SA .....			468,835	\$ 3,409,157	0.6%
Vonovia SE .....			41,254	2,627,418	0.5
				<u>6,036,575</u>	<u>1.1</u>
				<u>21,246,969</u>	<u>4.0</u>
<b>ENERGIE</b>					
<b>ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE</b>					
ENEOS Holdings, Inc. ....			778,891	3,444,249	0.7
Repsol SA .....			308,283	3,880,601	0.7
Royal Dutch Shell PLC - Class A (a) .....			430,535	8,885,186	1.7
Royal Dutch Shell PLC - Class A (London) (a) .....			45,168	923,888	0.2
				<u>17,133,924</u>	<u>3.3</u>
<b>Gesamtanlagen</b>				<u>\$ 507,176,682</u>	<u>96.6%</u>
(Kosten \$415,753,620) .....					
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(b) .....	0.00 %	–		7,163,183	1.4
Bank of Nova Scotia, Toronto(b) .....	0.00 %	–		51,294	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	(0.56)%	–		50,247	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	2.80 %	–		761	0.0
BNP Paribas, Paris(b) .....	(1.37)%	–		51,091	0.0
BNP Paribas, Paris(b) .....	(0.06)%	–		30,764	0.0
Citibank, New York(b) .....	0.00 %	–		25,408	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b) .....	0.00 %	–		50,989	0.0
HSBC Continental Europe, Paris(b) .....	(0.71)%	–		52,415	0.0
MUFG, Tokyo(b) .....	(0.30)%	–		51,239	0.0
National Australia Bank, London(b) .....	(0.06)%	–		52,079	0.0
SEB, Stockholm(b) .....	(0.29)%	–		41,821	0.0
SEB, Stockholm(b) .....	0.00 %	–		98,871	0.1
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....				<u>7,720,162</u>	<u>1.5</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....				<u>10,232,790</u>	<u>1.9</u>
<b>Nettovermögen</b> .....				<u>\$ 525,129,634</u>	<u>100.0%</u>

**DEVISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA. ....	USD 1,853	EUR 1,525	03/15/2021	\$ (12,481)
Bank of America, NA. ....	EUR 909	USD 1,096	06/16/2021	(4,057)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	EUR 487	USD 577	03/15/2021	(10,735)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	EUR 1,778	USD 2,165	03/15/2021	19,262
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 6,227	EUR 5,104	03/15/2021	(66,923)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 23,926	AUD 30,248	03/05/2021	(651,529)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 5,756	CAD 7,355	03/05/2021	23,705
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 1,160	EUR 963	03/05/2021	2,654
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 22,806	GBP 16,685	03/05/2021	440,589
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 6,343	SGD 8,451	03/05/2021	(4,568)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 4,255	ZAR 63,676	03/05/2021	(48,431)
Citibank, NA .....	EUR 7,380	USD 8,760	03/15/2021	(147,853)
Citibank, NA .....	EUR 997	USD 1,215	03/15/2021	11,760
Citibank, NA .....	EUR 380	USD 459	06/16/2021	(1,257)
Goldman Sachs Bank USA .....	AUD 8,539	USD 6,392	03/15/2021	(178,364)
Goldman Sachs Bank USA .....	EUR 20,307	USD 24,702	03/15/2021	192,318
Goldman Sachs Bank USA .....	USD 4,153	AUD 5,482	03/15/2021	65,797
HSBC Bank USA .....	ILS 2,467	USD 754	03/15/2021	8,394
JPMorgan Chase Bank, NA .....	EUR 1,136	USD 1,381	03/15/2021	9,859
Morgan Stanley Capital Services LLC .....	AUD 1,830	USD 1,404	03/15/2021	(3,982)
Morgan Stanley Capital Services LLC .....	EUR 975	USD 1,194	03/15/2021	16,767
Royal Bank of Scotland PLC .....	ILS 9,354	USD 2,879	03/15/2021	52,744
UBS AG .....	USD 1,937	AUD 2,493	03/15/2021	(18,118)
				<u>\$ (304,449)</u>
			Wertsteigerung	\$ 843,849
			Wertminderung	\$ (1,148,298)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

(a) Stellt sämtliche oder einen Teil der verliehenen Wertpapiere dar. Informationen zur Wertpapierleihe finden Sie in Anmerkung N.

(b) Tagesgeld.



Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar  
CAD – Canadian Dollar  
EUR – Euro  
GBP – Great British Pound  
ILS – Israeli Shekel  
SGD – Singapore Dollar  
USD – United States Dollar  
ZAR – South African Rand

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt  
REG – Registered Shares  
REIT – Real Estate Investment Trust

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIEEN</b>			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
Samsung SDI Co., Ltd. ....	26,250	\$ 15,706,151	1.8%
Sinbon Electronics Co., Ltd. ....	1,609,000	15,528,915	1.7
		<u>31,235,066</u>	<u>3.5</u>
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
FPT Corp. ....	144,842	480,482	0.1
GDS Holdings Ltd. (ADR) ....	100,540	10,271,166	1.1
My EG Services Bhd ....	1,818,300	948,241	0.1
Network International Holdings PLC ....	578,500	2,996,948	0.3
		<u>14,696,837</u>	<u>1.6</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
Broadcom, Inc. ....	26,920	12,648,901	1.4
MediaTek, Inc. ....	749,000	24,040,356	2.7
Micron Technology, Inc. ....	157,260	14,394,008	1.6
SK Hynix, Inc. ....	222,190	27,908,166	3.1
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. ....	3,543,000	77,404,052	8.7
		<u>156,395,483</u>	<u>17.5</u>
<b>TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE</b>			
Samsung Electronics Co., Ltd. ....	752,540	55,150,399	6.2
		<u>257,477,785</u>	<u>28.8</u>
<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BANKEN</b>			
Bandhan Bank Ltd. ....	467,883	2,199,025	0.3
Bank Central Asia Tbk PT ....	389,000	915,218	0.1
Bank for Foreign Trade of Vietnam JSC ....	3,185,530	13,574,395	1.5
Capitec Bank Holdings Ltd. ....	50,826	4,498,820	0.5
Credicorp Ltd. ....	55,270	8,843,753	1.0
HDFC Bank Ltd. ....	949,393	19,913,650	2.2
Itau Unibanco Holding SA (ADR) ....	2,711,410	12,282,687	1.4
Sberbank of Russia PJSC (Sponsored ADR) ....	1,459,129	21,244,918	2.4
TCS Group Holding PLC (GDR) ....	292,300	15,286,820	1.7
		<u>98,759,286</u>	<u>11.1</u>
<b>KAPITALMÄRKTE</b>			
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao ....	199,600	1,933,957	0.2
New Frontier Health Corp. ....	479,590	5,366,612	0.6
		<u>7,300,569</u>	<u>0.8</u>
<b>FINANZWESEN – VERBRAUCHER</b>			
Manappuram Finance Ltd. ....	2,793,400	6,703,448	0.8
Muangthai Capital PCL ....	4,224,900	9,147,992	1.0
Muthoot Finance Ltd. ....	610,836	10,821,265	1.2
		<u>26,672,705</u>	<u>3.0</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>			
AIA Group Ltd. ....	1,754,400	22,125,493	2.5
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H ....	384,500	4,758,024	0.5
		<u>26,883,517</u>	<u>3.0</u>
<b>SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG</b>			
Housing Development Finance Corp., Ltd. ....	799,523	27,669,244	3.1
		<u>187,285,321</u>	<u>21.0</u>
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE</b>			
Fu Shou Yuan International Group Ltd. ....	8,641,000	8,670,428	1.0
New Oriental Education & Technology Group, Inc. ....	115,414	20,569,263	2.3
		<u>29,239,691</u>	<u>3.3</u>
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
OPAP SA ....	1,757,499	23,709,316	2.7
Premium Leisure Corp. ....	136,320,600	1,320,478	0.1
		<u>25,029,794</u>	<u>2.8</u>
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
Alibaba Group Holding Ltd. ....	1,761,200	52,922,626	5.9
Despegar.com Corp. ....	347,818	4,139,034	0.5
JD.com, Inc. - Class A ....	750,880	35,216,109	3.9
Naspers Ltd. - Class N ....	67,480	15,923,758	1.8
		<u>108,201,527</u>	<u>12.1</u>
<b>MULTILINE-EINZELHANDEL</b>			
Lojas Renner SA ....	932,300	6,098,661	0.7

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
Samsonite International SA .....	2,436,600	\$ 4,736,617	0.5%
		<u>173,306,290</u>	<u>19.4</u>
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>			
<b>UNTERHALTUNG</b>			
HUYA, Inc. (ADR) (a) .....	390,710	10,295,208	1.1
NCSOFT Corp. ....	14,610	12,134,501	1.4
		<u>22,429,709</u>	<u>2.5</u>
<b>INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
NAVER Corp. ....	13,130	4,371,265	0.5
Tencent Holdings Ltd. ....	750,100	65,256,460	7.3
		<u>69,627,725</u>	<u>7.8</u>
<b>DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Safaricom PLC .....	14,326,980	4,973,106	0.6
		<u>97,030,540</u>	<u>10.9</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF</b>			
A-Living Smart City Services Co., Ltd. - Class H .....	3,289,750	13,774,708	1.6
Sunny Friend Environmental Technology Co., Ltd. ....	1,459,000	11,597,468	1.3
		<u>25,372,176</u>	<u>2.9</u>
<b>MASCHINEN</b>			
Techtronic Industries Co., Ltd. ....	299,500	4,558,369	0.5
<b>PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN</b>			
HeadHunter Group PLC (ADR) .....	306,077	10,648,419	1.2
L&T Technology Services Ltd. ....	261,521	9,134,365	1.0
		<u>19,782,784</u>	<u>2.2</u>
<b>STRASSE UND SCHIENE</b>			
Globaltrans Investment PLC (Sponsored GDR) .....	1,799,173	11,964,500	1.3
		<u>61,677,829</u>	<u>6.9</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
<b>GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF</b>			
Yestar Healthcare Holdings Co., Ltd. ....	7,767,500	1,171,667	0.1
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Universal Vision Biotechnology Co., Ltd. ....	978,000	8,505,737	1.0
<b>GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE</b>			
Alibaba Health Information Technology Ltd. ....	4,352,000	14,578,260	1.6
<b>PHARMAZEUTIKA</b>			
Genomma Lab Internacional SAB de CV - Class B .....	14,026,356	14,032,390	1.6
		<u>38,288,054</u>	<u>4.3</u>
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>			
<b>HAUSHALTSPRODUKTE</b>			
C&S Paper Co., Ltd. ....	4,217,401	13,879,968	1.5
<b>ENERGIE</b>			
<b>ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE</b>			
Petroleo Brasileiro SA (ADR) .....	1,558,216	12,356,653	1.4
Reliance Industries Ltd. ....	33,774	957,373	0.1
		<u>13,314,026</u>	<u>1.5</u>
<b>GRUNDSTOFFE</b>			
<b>METALL UND BERGBAU</b>			
Antofagasta PLC .....	176,270	4,399,326	0.5
MMC Norilsk Nickel PJSC (ADR) .....	264,340	8,297,633	0.9
		<u>12,696,959</u>	<u>1.4</u>
<b>VERSORGUNG</b>			
<b>STROMVERSORGBETRIEBE</b>			
Equatorial Energia SA .....	2,930,200	10,509,443	1.2
<b>IMMOBILIEN</b>			
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG</b>			
Vincom Retail JSC .....	5,724,534	8,249,303	0.9
		<u>873,715,518</u>	<u>97.8</u>
<b>AKTIENANLEIHEN</b>			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
FPT Corp., Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2021 .....	3,361,795	11,129,787	1.2

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>					
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>					
Mobile World Investment Corp., Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2021 .....			577,293	\$ 3,386,030	0.4%
				<u>14,515,817</u>	<u>1.6</u>
<b>Gesamtanlagen</b>				\$ 888,231,335	99.4%
(Kosten \$708,428,100) .....					
<b>Termineinlagen</b>					
Barclays, London(b) .....	0.00 %	–		11,951,225	1.4
BBH, Grand Cayman(b) .....	(1.37)%	–		1,176	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	(0.71)%	–		2,102	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	(0.29)%	–		108	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	0.00 %	–		994	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	0.07 %	–		51,445	0.0
BNP Paribas, Paris(b) .....	(0.06)%	–		84,903	0.0
BNP Paribas, Paris(b) .....	2.80 %	–		91,412	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b) .....	0.00 %	–		833,209	0.1
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....				<u>13,016,574</u>	<u>1.5</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....				<u>(7,776,149)</u>	<u>(0.9)</u>
<b>Nettovermögen</b> .....				\$ <u>893,471,760</u>	<u>100.0%</u>

**DEVISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 4,919	AUD 6,442	03/05/2021	\$ 38,352
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 592	PLN 2,212	03/05/2021	(1,897)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 37	SGD 49	03/05/2021	(13)
				<u>\$ 36,442</u>
			Wertsteigerung	\$ 38,352
			Wertminderung	\$ (1,910)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

(a) Stellt sämtliche oder einen Teil der verliehenen Wertpapiere dar. Informationen zur Wertpapierleihe finden Sie in Anmerkung N.

(b) Tagesgeld.

**Währungskürzel:**

AUD – Australian Dollar  
PLN – Polish Zloty  
SGD – Singapore Dollar  
USD – United States Dollar

**Glossar:**

ADR – American Depositary Receipt  
GDR – Global Depositary Receipt  
JSC – Joint Stock Company  
PJSC – Public Joint Stock Company

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG</b>			
Ciena Corp. ....	216,635	\$ 11,301,848	1.9%
Lumentum Holdings, Inc. ....	117,317	10,558,530	1.8
Motorola Solutions, Inc. ....	52,480	9,209,190	1.5
		<u>31,069,568</u>	<u>5.2</u>
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
Flex Ltd. ....	927,457	16,870,443	2.8
Keysight Technologies, Inc. ....	63,169	8,939,677	1.5
		<u>25,810,120</u>	<u>4.3</u>
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
MAXIMUS, Inc. ....	116,028	9,430,756	1.6
PayPal Holdings, Inc. ....	53,564	13,918,605	2.4
Square, Inc. - Class A ....	44,886	10,325,127	1.7
Twilio, Inc. - Class A ....	17,990	7,067,911	1.2
Visa, Inc. - Class A ....	59,620	12,662,692	2.1
		<u>53,405,091</u>	<u>9.0</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
Monolithic Power Systems, Inc. ....	17,075	6,394,929	1.1
NVIDIA Corp. ....	11,284	6,190,177	1.0
NXP Semiconductors NV ....	72,360	13,209,318	2.2
		<u>25,794,424</u>	<u>4.3</u>
<b>SOFTWARE</b>			
Adobe, Inc. ....	19,170	8,811,874	1.5
ANSYS, Inc. ....	26,970	9,196,500	1.5
Microsoft Corp. ....	59,868	13,912,126	2.3
Proofpoint, Inc. ....	92,127	11,139,997	1.9
salesforce.com, Inc. ....	56,680	12,271,220	2.1
Zendesk, Inc. ....	63,357	9,258,992	1.6
		<u>64,590,709</u>	<u>10.9</u>
<b>TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE</b>			
Apple, Inc. ....	109,398	13,265,601	2.2
		<u>213,935,513</u>	<u>35.9</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
<b>GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF</b>			
Alcon, Inc. ....	183,978	12,584,095	2.1
Danaher Corp. ....	65,756	14,444,621	2.4
Koninklijke Philips NV (ADR) ....	271,416	14,765,030	2.5
STERIS PLC ....	69,130	12,083,924	2.0
		<u>53,877,670</u>	<u>9.0</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Laboratory Corp. of America Holdings ....	55,730	13,370,184	2.3
UnitedHealth Group, Inc. ....	21,949	7,291,897	1.2
		<u>20,662,081</u>	<u>3.5</u>
<b>LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A ....	27,353	15,987,829	2.7
Bruker Corp. ....	235,597	14,366,705	2.4
ICON PLC ....	28,896	5,220,929	0.9
		<u>35,575,463</u>	<u>6.0</u>
		<u>110,115,214</u>	<u>18.5</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG</b>			
Hexcel Corp. ....	201,400	10,827,264	1.8
<b>BAUPRODUKTE</b>			
Trex Co., Inc. ....	157,244	14,409,840	2.4
<b>GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF</b>			
Tetra Tech, Inc. ....	62,561	8,656,565	1.5
Waste Management, Inc. ....	103,622	11,490,644	1.9
		<u>20,147,209</u>	<u>3.4</u>
<b>ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG</b>			
Rockwell Automation, Inc. ....	52,610	12,798,961	2.1
Vestas Wind Systems A/S (Sponsored ADR) ....	223,824	14,067,338	2.4
		<u>26,866,299</u>	<u>4.5</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>MASCHINEN</b>					
Xylem, Inc./NY			128,185	\$ 12,762,099	2.2%
				<u>85,012,711</u>	<u>14.3</u>
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>					
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>					
Aptiv PLC			108,927	16,321,621	2.7
<b>HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER</b>					
TopBuild Corp.			58,275	11,096,143	1.9
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>					
Home Depot, Inc. (The)			46,555	12,027,019	2.0
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>					
Lululemon Athletica, Inc.			30,710	9,571,693	1.6
NIKE, Inc. - Class B			104,492	14,083,431	2.4
				<u>23,655,124</u>	<u>4.0</u>
				<u>63,099,907</u>	<u>10.6</u>
<b>FINANZWERTE</b>					
<b>BANKEN</b>					
SVB Financial Group			32,080	16,211,949	2.7
<b>KAPITALMÄRKTE</b>					
Intercontinental Exchange, Inc.			120,632	13,306,916	2.2
MSCI, Inc. - Class A			31,682	13,132,823	2.2
				<u>26,439,739</u>	<u>4.4</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Aflac, Inc.			247,377	11,846,884	2.0
				<u>54,498,572</u>	<u>9.1</u>
<b>VERSORGUNG</b>					
<b>STROMVERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
NextEra Energy, Inc.			195,756	14,384,151	2.4
<b>WASSERVERSORGER</b>					
American Water Works Co., Inc.			71,467	10,139,738	1.7
				<u>24,523,889</u>	<u>4.1</u>
<b>IMMOBILIEN</b>					
<b>AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)</b>					
SBA Communications Corp.			35,513	9,060,432	1.5
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>					
<b>HAUSHALTSPRODUKTE</b>					
Procter & Gamble Co. (The)			65,819	8,130,621	1.4
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten \$471,657,628)				\$ 568,376,859	95.4%
<b>Termineinlagen</b>					
BBH, Grand Cayman(a)	(0.71)%	-		65	0.0
SEB, Stockholm(a)	0.00 %	-		25,460,868	4.2
<b>Termineinlagen insgesamt</b>					
				<u>25,460,933</u>	<u>4.2</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b>					
				<u>2,240,978</u>	<u>0.4</u>
<b>Nettovermögen</b>					
				<u>\$ 596,078,770</u>	<u>100.0%</u>

**DEVISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 205	AUD 269	03/05/2021	\$ 2,050
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 4,449	CAD 5,698	03/05/2021	27,947
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 15,239	EUR 12,681	03/05/2021	62,331
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 574	GBP 420	03/05/2021	10,925
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 32	JPY 3,354	03/05/2021	(489)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 2,139	SGD 2,850	03/05/2021	(1,416)
				<u>\$ 101,348</u>
			Wertsteigerung	\$ 103,253
			Wertminderung	\$ (1,905)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar  
CAD – Canadian Dollar  
EUR – Euro  
GBP – Great British Pound  
JPY – Japanese Yen  
SGD – Singapore Dollar  
USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt  
REIT – Real Estate Investment Trust

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BANKEN</b>			
Agricultural Bank of China Ltd. - Class H	19,212,000	\$ 6,984,876	1.8%
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	9,477,500	3,960,051	1.0
Bank of the Philippine Islands	996,140	1,827,215	0.5
China Construction Bank Corp. - Class H	16,359,000	13,139,590	3.4
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	474,600	1,535,813	0.4
Hana Financial Group, Inc.	377,850	12,460,474	3.2
ICICI Bank Ltd.	1,332,905	10,842,267	2.8
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	914,800	3,481,191	0.9
Kasikornbank PCL (Foreign Shares)	840,100	3,930,782	1.0
KB Financial Group, Inc.	318,500	12,416,822	3.2
Metropolitan Bank & Trust Co.	3,272,350	3,419,376	0.9
Shinhan Financial Group Co., Ltd.	168,660	4,946,459	1.3
State Bank of India	2,350,595	12,479,889	3.2
		<u>91,424,805</u>	<u>23.6</u>
<b>KAPITALMÄRKTE</b>			
China Everbright Ltd.	1,782,000	2,302,037	0.6
<b>DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN</b>			
Fubon Financial Holding Co., Ltd.	2,208,000	3,955,810	1.0
Metro Pacific Investments Corp.	25,506,000	2,139,518	0.6
		<u>6,095,328</u>	<u>1.6</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>			
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	555,500	6,825,178	1.7
		<u>106,647,348</u>	<u>27.5</u>
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
Simple Technology Co., Ltd.	453,000	6,090,962	1.6
Zhen Ding Technology Holding Ltd.	466,000	2,007,719	0.5
		<u>8,098,681</u>	<u>2.1</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
Nanya Technology Corp.	3,617,000	12,531,748	3.2
Novatek Microelectronics Corp.	330,000	5,616,013	1.4
Realtek Semiconductor Corp.	239,000	3,947,222	1.0
SK Hynix, Inc.	115,550	14,553,026	3.8
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	842,000	18,319,792	4.7
United Microelectronics Corp.	5,097,000	9,918,585	2.6
		<u>64,886,386</u>	<u>16.7</u>
<b>TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE</b>			
Samsung Electronics Co., Ltd.	336,600	24,716,956	6.4
Samsung Electronics Co., Ltd. (Preference Shares)	28,830	1,868,112	0.5
		<u>26,585,068</u>	<u>6.9</u>
		<u>99,570,135</u>	<u>25.7</u>
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>			
Hyundai Mobis Co., Ltd.	17,670	4,765,474	1.2
<b>KRAFTFAHRZEUGE</b>			
Great Wall Motor Co., Ltd. - Class H	1,789,000	5,201,084	1.3
Hyundai Motor Co.	36,660	7,733,351	2.0
Kia Motors Corp.	107,300	7,583,107	2.0
Maruti Suzuki India Ltd.	32,990	3,082,456	0.8
		<u>23,599,998</u>	<u>6.1</u>
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
Galaxy Entertainment Group Ltd.	599,000	5,475,327	1.4
Melco Resorts & Entertainment Ltd. (ADR)	258,970	5,609,290	1.5
		<u>11,084,617</u>	<u>2.9</u>
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
Alibaba Group Holding Ltd.	141,800	4,248,635	1.1
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>			
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	605,500	3,747,075	1.0
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
Samsonite International SA	1,259,400	2,451,758	0.6
		<u>49,897,557</u>	<u>12.9</u>



	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>VERSORGUNG</b>			
<b>STROMVERSORGUNGSBETRIEBE</b>			
Power Grid Corp. of India Ltd. ....	2,234,149	\$ 6,515,318	1.7%
<b>GASVERSORGUNGSBETRIEBE</b>			
China Resources Gas Group Ltd. ....	504,000	2,517,904	0.6
ENN Energy Holdings Ltd. ....	122,000	1,870,160	0.5
GAIL India Ltd. ....	5,042,015	9,729,301	2.5
Kunlun Energy Co., Ltd. ....	8,724,000	8,019,406	2.1
		<u>22,136,771</u>	<u>5.7</u>
		<u>28,652,089</u>	<u>7.4</u>
<b>IMMOBILIEN</b>			
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG</b>			
Ayala Land, Inc. ....	2,183,100	1,757,009	0.5
CIFI Holdings Group Co., Ltd. ....	6,224,000	5,897,853	1.5
KWG Living Group Holdings Ltd. ....	1,699,200	2,030,772	0.5
Midea Real Estate Holding Ltd. ....	1,664,600	3,717,019	1.0
New World Development Co., Ltd. ....	251,000	1,276,609	0.3
Sun Hung Kai Properties Ltd. ....	70,000	1,124,483	0.3
Times China Holdings Ltd. ....	2,842,000	4,286,935	1.1
Wharf Real Estate Investment Co., Ltd. ....	465,000	2,778,687	0.7
		<u>22,869,367</u>	<u>5.9</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>FLUGGESELLSCHAFTEN</b>			
Air China Ltd. - Class H ....	2,072,000	1,709,648	0.4
<b>ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG</b>			
NARI Technology Co., Ltd. ....	192,700	843,536	0.2
<b>MASCHINEN</b>			
Weichai Power Co., Ltd. - Class H ....	3,618,000	10,588,427	2.7
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd. - Class H ....	4,520,400	6,888,606	1.8
		<u>17,477,033</u>	<u>4.5</u>
<b>TRANSPORTWESEN – INFRASTRUKTUR</b>			
Jiangsu Expressway Co., Ltd. - Class H ....	2,302,000	2,674,035	0.7
		<u>22,704,252</u>	<u>5.8</u>
<b>GRUNDSTOFFE</b>			
<b>CHEMIKALIEN</b>			
LG Chem Ltd. ....	6,470	4,785,554	1.2
<b>METALL UND BERGBAU</b>			
Hindalco Industries Ltd. ....	964,912	4,467,732	1.2
Jiangxi Copper Co., Ltd. - Class H ....	2,798,000	6,788,977	1.7
		<u>11,256,709</u>	<u>2.9</u>
		<u>16,042,263</u>	<u>4.1</u>
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>			
<b>DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Telkom Indonesia Persero Tbk PT ....	26,706,500	6,545,343	1.7
<b>DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Bharti Airtel Ltd. ....	395,529	2,994,255	0.8
		<u>9,539,598</u>	<u>2.5</u>
<b>ENERGIE</b>			
<b>ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE</b>			
PetroChina Co., Ltd. - Class H (a) ....	15,354,000	5,503,048	1.4
Petronet LNG Ltd. ....	1,046,765	3,634,512	0.9
		<u>9,137,560</u>	<u>2.3</u>
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>			
<b>LEBENSMITTELPRODUKTE</b>			
WH Group Ltd. ....	8,310,500	7,457,159	1.9
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. - Class H ....	2,445,800	4,483,917	1.2
<b>PHARMAZEUTIKA</b>			
China Resources Pharmaceutical Group Ltd. ....	2,586,700	1,650,776	0.4
		<u>6,134,693</u>	<u>1.6</u>
		<u>378,652,021</u>	<u>97.6</u>
<b>AKTIENANLEIHEN</b>			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
FPT Corp., Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2021 ....	958,750	3,174,103	0.8

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>IMMOBILIEN</b>					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG					
Vincomet Retail, Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2021			1,855,250	\$ 2,676,092	0.7%
<b>FINANZWERTE</b>					
BANKEN					
Military Commercial Joint, Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2021			1,040,500	1,249,965	0.3
Vietnam Technological & Commercial Joint Stock Bank, Macquarie Bank Ltd., expiring 08/10/2022			113,200	193,040	0.1
				1,443,005	0.4
				7,293,200	1.9
<b>Gesamtanlagen</b>				\$ 385,945,221	99.5%
(Kosten \$304,111,126)					
<b>Termineinlagen</b>					
Barclays, London(b)	0.00 %	–		2,560,974	0.6
BBH, Grand Cayman(b)	(0.06)%	–		65	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.00 %	–		330	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.07 %	–		24,662	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	2.80 %	–		242,253	0.1
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b)	0.00 %	–		39,849	0.0
Sumitomo Trust Bank, London(b)	(0.30)%	–		26,035	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	0.00 %	–		2,213,121	0.6
<b>Termineinlagen insgesamt</b>				5,107,289	1.3
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b>				(3,260,715)	(0.8)
<b>Nettovermögen</b>				\$ 387,791,795	100.0%

**DEWISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 39,962	AUD 52,535	03/05/2021	\$ 461,822
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 6,187	CAD 7,928	03/05/2021	42,641
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 621	EUR 512	03/05/2021	(3,320)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 4,374	GBP 3,198	03/05/2021	81,043
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 5,810	NZD 8,074	03/05/2021	24,429
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 66	SGD 89	03/05/2021	(35)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 19,718	ZAR 294,877	03/05/2021	(237,282)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 17	CNH 109	03/12/2021	(134)
				\$ 369,164
			Wertsteigerung	\$ 609,935
			Wertminderung	\$ (240,771)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

- (a) Stellt sämtliche oder einen Teil der verliehenen Wertpapiere dar. Informationen zur Wertpapierleihe finden Sie in Anmerkung N.
- (b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- CAD – Canadian Dollar
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- NZD – New Zealand Dollar
- SGD – Singapore Dollar
- USD – United States Dollar
- ZAR – South African Rand

Glossar:

- ADR – American Depositary Receipt

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>			
NGK Spark Plug Co., Ltd. ....	78,300	¥ 141,096,600	1.7%
Toyo Tire Corp. ....	117,000	217,269,000	2.6
TS Tech Co., Ltd. ....	21,600	63,871,200	0.8
		<u>422,236,800</u>	<u>5.1</u>
<b>KRAFTFAHRZEUGE</b>			
Honda Motor Co., Ltd. ....	70,800	206,134,200	2.5
Subaru Corp. ....	86,500	172,005,250	2.1
Suzuki Motor Corp. ....	30,400	139,809,600	1.7
		<u>517,949,050</u>	<u>6.3</u>
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
Sushiro Global Holdings Ltd. ....	13,800	54,993,000	0.7
<b>HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER</b>			
Panasonic Corp. ....	93,600	127,810,800	1.6
Sony Corp. ....	23,200	257,984,000	3.1
		<u>385,794,800</u>	<u>4.7</u>
<b>MULTILINE-EINZELHANDEL</b>			
Ryohin Keikaku Co., Ltd. ....	55,700	133,568,600	1.6
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
Asics Corp. ....	47,100	82,189,500	1.0
		<u>1,596,731,750</u>	<u>19.4</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF</b>			
Park24 Co., Ltd. ....	39,800	91,181,800	1.1
<b>ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG</b>			
Fuji Electric Co., Ltd. ....	34,500	152,490,000	1.9
<b>MASCHINEN</b>			
IHI Corp. ....	76,100	149,003,800	1.8
<b>PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Outsourcing, Inc. ....	74,700	121,761,000	1.5
UT Group Co., Ltd. ....	23,600	79,532,000	0.9
		<u>201,293,000</u>	<u>2.4</u>
<b>STRASSE UND SCHIENE</b>			
East Japan Railway Co. ....	23,600	185,425,200	2.2
Sankyu, Inc. ....	34,400	152,736,000	1.9
		<u>338,161,200</u>	<u>4.1</u>
<b>HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER</b>			
Mitsubishi Corp. ....	82,200	246,846,600	3.0
		<u>1,178,976,400</u>	<u>14.3</u>
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
Hitachi Ltd. ....	34,400	167,734,400	2.0
Ok Electric Industry Co., Ltd. (a) ....	155,700	162,395,100	2.0
		<u>330,129,500</u>	<u>4.0</u>
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Fujitsu Ltd. ....	19,500	299,520,000	3.7
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
SCREEN Holdings Co., Ltd. ....	28,600	237,380,000	2.9
<b>SOFTWARE</b>			
Oracle Corp. Japan ....	8,500	91,800,000	1.1
<b>TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE</b>			
Maxell Holdings Ltd. ....	47,300	65,605,100	0.8
		<u>1,024,434,600</u>	<u>12.5</u>
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>			
<b>GETRÄNKE</b>			
Asahi Group Holdings Ltd. ....	35,236	162,508,432	2.0
Coca-Cola Bottlers Japan Holdings, Inc. ....	43,400	79,422,000	1.0
		<u>241,930,432</u>	<u>3.0</u>
<b>LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL</b>			
Seven & i Holdings Co., Ltd. (a) ....	46,900	189,335,300	2.3
Sundrug Co., Ltd. ....	24,900	99,600,000	1.2
		<u>288,935,300</u>	<u>3.5</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
<b>LEBENSMITTELPRODUKTE</b>					
Morinaga & Co., Ltd./Japan			15,700	¥ 60,288,000	0.7%
Nichirei Corp.			66,500	184,404,500	2.3
				<u>244,692,500</u>	<u>3.0</u>
<b>TABAK</b>					
Japan Tobacco, Inc.			65,900	126,857,500	1.5
				<u>902,415,732</u>	<u>11.0</u>
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>					
<b>DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>					
Nippon Telegraph & Telephone Corp.			147,100	405,701,800	5.0
<b>UNTERHALTUNG</b>					
Konami Holdings Corp.			22,600	154,358,000	1.9
Nintendo Co., Ltd.			1,200	77,700,000	0.9
				<u>232,058,000</u>	<u>2.8</u>
<b>INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Kakaku.com, Inc.			19,100	64,558,000	0.8
Z Holdings Corp.			118,100	76,587,850	0.9
				<u>141,145,850</u>	<u>1.7</u>
				<u>778,905,650</u>	<u>9.5</u>
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
<b>CHEMIKALIEN</b>					
Air Water, Inc.			85,200	149,270,400	1.8
Tosoh Corp.			124,900	243,555,000	3.0
Zeon Corp.			64,500	100,620,000	1.2
				<u>493,445,400</u>	<u>6.0</u>
<b>CONTAINER UND VERPACKUNGEN</b>					
Rengo Co., Ltd.			81,800	70,593,400	0.9
<b>METALL UND BERGBAU</b>					
Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.			26,600	136,777,200	1.7
Yamato Kogyo Co., Ltd.			22,400	59,449,600	0.7
				<u>196,226,800</u>	<u>2.4</u>
				<u>760,265,600</u>	<u>9.3</u>
<b>FINANZWERTE</b>					
<b>BANKEN</b>					
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			485,800	271,076,400	3.3
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.			56,000	209,552,000	2.6
				<u>480,628,400</u>	<u>5.9</u>
<b>DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN</b>					
ORIX Corp.			88,200	158,892,300	1.9
				<u>639,520,700</u>	<u>7.8</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>					
<b>PHARMAZEUTIKA</b>					
Astellas Pharma, Inc.			89,900	150,492,600	1.8
Nippon Shinyaku Co., Ltd.			34,000	245,820,000	3.0
Santen Pharmaceutical Co., Ltd.			49,100	71,784,200	0.9
				<u>468,096,800</u>	<u>5.7</u>
<b>ENERGIE</b>					
<b>ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE</b>					
ENEOS Holdings, Inc.			634,400	296,708,880	3.6
<b>IMMOBILIEN</b>					
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG</b>					
Mitsui Fudosan Co., Ltd.			110,900	266,160,000	3.2
<b>VERSORGUNG</b>					
<b>GASVERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
Tokyo Gas Co., Ltd.			40,700	89,621,400	1.1
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten ¥7,573,959,703)				¥ 8,001,837,512	97.4%
<b>Termineinlagen</b>					
BBH, Grand Cayman(b)	(0.06)%	–		34,826	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.00 %	–		1,970,681	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.01 %	–		20,549	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	2.80 %	–		147,550	0.0
MUFG, Tokyo(b)	(0.30)%	–		<u>112,752,114</u>	<u>1.4</u>
<b>Termineinlagen insgesamt</b>				<u>114,925,720</u>	<u>1.4</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b>				<u>94,721,434</u>	<u>1.2</u>
<b>Nettovermögen</b>				<u>¥ 8,211,484,666</u>	<u>100.0%</u>

**DEWISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	481,548	AUD	6,030	03/05/2021	¥ 13,006,430
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	2,395	CZK	491	03/05/2021	19,445
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	51,166	EUR	406	03/05/2021	962,129
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	53,674	NZD	710	03/05/2021	994,662
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	10,648	SGD	135	03/05/2021	146,109
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	936,101	USD	8,915	03/05/2021	14,130,403
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	45,479	ZAR	6,334	03/05/2021	(876,551)
						¥ 28,382,627
					Wertsteigerung	¥ 29,259,178
					Wertminderung	¥ (876,551)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Stellt sämtliche oder einen Teil der verliehenen Wertpapiere dar. Informationen zur Wertpapierleihe finden Sie in Anmerkung N.

(b) Tagesgeld.

**Währungskürzel:**

- AUD – Australian Dollar
- CZK – Czech Koruna
- EUR – Euro
- JPY – Japanese Yen
- NZD – New Zealand Dollar
- SGD – Singapore Dollar
- USD – United States Dollar
- ZAR – South African Rand

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE</b>			
Fu Shou Yuan International Group Ltd. ....	3,589,000	\$ 3,604,524	2.3%
New Oriental Education & Technology Group, Inc. ....	26,700	4,705,619	3.1
		<u>8,310,143</u>	<u>5.4</u>
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
Galaxy Entertainment Group Ltd. ....	189,000	1,727,607	1.2
Jiumaojiu International Holdings Ltd. ....	981,000	3,851,176	2.5
Melco Resorts & Entertainment Ltd. (ADR) ....	35,270	763,948	0.5
		<u>6,342,731</u>	<u>4.2</u>
<b>HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER</b>			
Bear Electric Appliance Co., Ltd. ....	72,160	903,238	0.6
Haier Smart Home Co., Ltd. - Class A ....	343,658	1,532,432	1.0
		<u>2,435,670</u>	<u>1.6</u>
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
Alibaba Group Holding Ltd. ....	463,860	13,898,248	9.1
Meituan - Class B ....	157,800	6,917,082	4.6
		<u>20,815,330</u>	<u>13.7</u>
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>			
Topsports International Holdings Ltd. ....	1,404,000	2,063,522	1.4
Zhongsheng Group Holdings Ltd. ....	279,500	1,729,657	1.1
		<u>3,793,179</u>	<u>2.5</u>
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
Hermes International ....	780	868,832	0.6
Li Ning Co., Ltd. ....	253,000	1,422,145	1.0
Shenzhou International Group Holdings Ltd. ....	83,000	1,723,894	1.1
Stella International Holdings Ltd. ....	1,056,000	1,262,062	0.8
		<u>5,276,933</u>	<u>3.5</u>
		<u>46,973,986</u>	<u>30.9</u>
<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BANKEN</b>			
Bank of Hangzhou Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK) ....	905,600	2,236,946	1.5
China Construction Bank Corp. - Class H ....	8,175,100	6,566,261	4.3
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class H ....	248,500	1,907,854	1.2
China Minsheng Banking Corp., Ltd. - Class H ....	2,036,000	1,215,334	0.8
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK) ....	827,900	3,150,500	2.1
Ping An Bank Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK) ....	580,936	1,915,105	1.2
		<u>16,992,000</u>	<u>11.1</u>
<b>KAPITALMÄRKTE</b>			
CITIC Securities Co., Ltd. - Class H ....	268,500	578,786	0.4
<b>VERSICHERUNGEN</b>			
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H ....	530,000	6,511,871	4.3
		<u>24,082,657</u>	<u>15.8</u>
<b>KOMMUNIKATIONSLEISTUNGEN</b>			
<b>UNTERHALTUNG</b>			
NetEase, Inc. ....	209,550	4,484,693	2.9
<b>INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Tencent Holdings Ltd. ....	172,700	14,750,788	9.7
		<u>19,235,481</u>	<u>12.6</u>
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
BOE Technology Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK) ....	1,146,700	1,076,772	0.7
GoerTek, Inc. - Class A (Nth SZ-SEHK) ....	365,700	1,804,394	1.2
Shengyi Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK) ....	193,000	728,493	0.5
Simplo Technology Co., Ltd. ....	163,000	2,191,670	1.4
		<u>5,801,329</u>	<u>3.8</u>
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
21Vianet Group, Inc. (ADR) ....	51,290	1,869,008	1.2
GDS Holdings Ltd. ....	439,360	5,562,487	3.7
		<u>7,431,495</u>	<u>4.9</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
Novatek Microelectronics Corp. ....	52,000	884,947	0.6
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. ....	59,000	1,283,691	0.8
		<u>2,168,638</u>	<u>1.4</u>
		<u>15,401,462</u>	<u>10.1</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>					
<b>GETRÄNKE</b>					
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK) . . . . .			15,200	\$ 4,975,138	3.3%
Luzhou Laojiao Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK) . . . . .			19,500	707,208	0.5
Tsingtao Brewery Co., Ltd. - Class H . . . . .			116,000	951,904	0.6
Wuliangye Yibin Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK) . . . . .			26,804	1,157,215	0.7
				<u>7,791,465</u>	<u>5.1</u>
<b>LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL</b>					
Taiwan FamilyMart Co., Ltd./Taiwan . . . . .			206,000	1,915,591	1.3
<b>LEBENSMITTELPRODUKTE</b>					
Nestle SA (REG) . . . . .			14,600	1,524,763	1.0
				<u>11,231,819</u>	<u>7.4</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>					
<b>GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF</b>					
A-Living Smart City Services Co., Ltd. - Class H . . . . .			547,250	2,293,011	1.5
Ever Sunshine Lifestyle Services Group Ltd. . . . .			1,317,820	3,245,088	2.1
				<u>5,538,099</u>	<u>3.6</u>
<b>INDUSTRIEKONZERNE</b>					
Guoco Group Ltd. . . . .			83,000	1,016,573	0.7
<b>MASCHINEN</b>					
Sany Heavy Industry Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK) . . . . .			248,528	1,575,358	1.0
Weichai Power Co., Ltd. - Class H . . . . .			534,000	1,562,803	1.0
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd. - Class H . . . . .			571,800	871,362	0.6
				<u>4,009,523</u>	<u>2.6</u>
				<u>10,564,195</u>	<u>6.9</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>					
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>					
China National Accord Medicines Corp. Ltd. . . . .			145,900	874,433	0.6
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. - Class H . . . . .			671,800	1,231,619	0.8
				<u>2,106,052</u>	<u>1.4</u>
<b>PHARMAZEUTIKA</b>					
Jiangsu Hengrui Medicine Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK) . . . . .			106,278	1,668,198	1.1
Yunnan Baiyao Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK) . . . . .			164,300	3,313,867	2.2
				<u>4,982,065</u>	<u>3.3</u>
				<u>7,088,117</u>	<u>4.7</u>
<b>VERSORGUNG</b>					
<b>GASVERSORGBETRIEBE</b>					
China Resources Gas Group Ltd. . . . .			234,000	1,169,027	0.8
ENN Energy Holdings Ltd. . . . .			168,000	2,575,302	1.7
Kunlun Energy Co., Ltd. . . . .			2,926,000	2,689,681	1.7
				<u>6,434,010</u>	<u>4.2</u>
<b>IMMOBILIEN</b>					
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG</b>					
KWG Living Group Holdings Ltd. . . . .			323,600	386,746	0.3
Midea Real Estate Holding Ltd. (a) . . . . .			621,200	1,387,127	0.9
Times Neighborhood Holdings Ltd. . . . .			529,000	456,267	0.3
				<u>2,230,140</u>	<u>1.5</u>
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
<b>METALL UND BERGBAU</b>					
Shandong Nanshan Aluminum Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK) . . . . .			2,336,250	1,484,134	1.0
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten \$102,834,761) . . . . .				<u>\$ 144,726,001</u>	<u>95.1%</u>
<b>Termineinlagen</b>					
BBH, Grand Cayman(b) . . . . .	(1.37)%	–		16,528	0.0
BBH, Grand Cayman(b) . . . . .	(0.71)%	–		143	0.0
BBH, Grand Cayman(b) . . . . .	(0.30)%	–		801	0.0
BBH, Grand Cayman(b) . . . . .	(0.06)%	–		1,328	0.0
BBH, Grand Cayman(b) . . . . .	0.00 %	–		9,422	0.0
BBH, Grand Cayman(b) . . . . .	0.01 %	–		604	0.0
BBH, Grand Cayman(b) . . . . .	0.07 %	–		1	0.0
BNP Paribas, Paris(b) . . . . .	2.80 %	–		113,163	0.0
Sumitomo, Tokyo(b) . . . . .	0.00 %	–		6,782,226	4.5
<b>Termineinlagen insgesamt</b> . . . . .				<u>6,924,216</u>	<u>4.5</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> . . . . .				<u>562,664</u>	<u>0.4</u>
<b>Nettovermögen</b> . . . . .				<u>\$ 152,212,881</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	11,765	AUD	15,497	03/05/2021	\$ 159,431
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	544	CAD	698	03/05/2021	3,699
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	330	EUR	274	03/05/2021	1,035
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	1,429	GBP	1,046	03/05/2021	28,270
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	645	NZD	896	03/05/2021	2,638
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	352	PLN	1,312	03/05/2021	(2,489)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	28	SGD	37	03/05/2021	(1)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	11,607	ZAR	173,975	03/05/2021	(113,448)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	11	CNH	67	03/12/2021	(85)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	10	CNH	68	03/25/2021	(27)
						<u>\$ 79,023</u>
					Wertsteigerung	\$ 195,073
					Wertminderung	\$ (116,050)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

- (a) Stellt sämtliche oder einen Teil der verliehenen Wertpapiere dar. Informationen zur Wertpapierleihe finden Sie in Anmerkung N.  
(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar  
CAD – Canadian Dollar  
CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)  
EUR – Euro  
GBP – Great British Pound  
NZD – New Zealand Dollar  
PLN – Polish Zloty  
SGD – Singapore Dollar  
USD – United States Dollar  
ZAR – South African Rand

Glossar:

- ADR – American Depositary Receipt  
REG – Registered Shares

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>					
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>					
<b>AUSTRALIEN</b>					
Australia Government Bond, Series 142	4.25%	04/21/2026	AUD 21,544	\$ 19,413,790	3.6%
<b>CHINA</b>					
Agricultural Bank of China Ltd.	3.05%	10/27/2023	CNH 31,165	4,828,261	0.9
<b>KOLUMBIEN</b>					
Colombian TES, Series B	10.00%	07/24/2024	COP 16,641,088	5,462,448	1.0
<b>FRANKREICH</b>					
French Republic Government Bond OAT	8.50%	04/25/2023	EUR 2,001	2,892,526	0.5
<b>UNGARN</b>					
Hungary Government Bond, Series 26/E.	1.50%	04/22/2026	HUF 1,621,042	5,273,923	1.0
<b>INDONESIEN</b>					
Indonesia Treasury Bond, Series FR77	8.13%	05/15/2024	IDR 72,192,835	5,457,074	1.0
<b>ITALIEN</b>					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4.50%	03/01/2024	EUR 20,436	28,082,984	5.3
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4.50%	03/01/2026	3,696	5,426,652	1.0
				33,509,636	6.3
<b>JAPAN</b>					
Japan Government Twenty Year Bond, Series 71	2.20%	06/20/2024	JPY 1,817,871	18,348,386	3.4
<b>MALAYSIA</b>					
Malaysia Government Bond, Series 0217	4.06%	09/30/2024	MYR 10,696	2,813,457	0.5
<b>MEXIKO</b>					
Mexican Bonos, Series M 20	10.00%	12/05/2024	MXN 95,084	5,355,881	1.0
<b>NEUSEELAND</b>					
New Zealand Government Bond, Series 0425	2.75%	04/15/2025	NZD 17,540	13,636,982	2.6
<b>RUSSLAND</b>					
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6227	7.40%	07/17/2024	RUB 393,985	5,535,887	1.0
<b>SPANIEN</b>					
Spain Government Bond	4.65%	07/30/2025	EUR 5,700	8,376,382	1.6
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
U.S. Treasury Bonds	7.13%	02/15/2023	USD 26,583	30,122,045	5.6
U.S. Treasury Bonds	7.25%	08/15/2022	19,040	20,982,836	3.9
U.S. Treasury Bonds(a)	7.50%	11/15/2024	14,095	17,688,696	3.3
U.S. Treasury Bonds	8.00%	11/15/2021	35,631	37,568,313	7.0
				106,361,890	19.8
				237,266,523	44.2
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Air Products & Chemicals, Inc.	0.38%	06/01/2021	EUR 1,940	2,343,315	0.4
PPG Industries, Inc.	0.88%	03/13/2022	880	1,071,078	0.2
				3,414,393	0.6
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Johnson Controls International PLC	1.00%	09/15/2023	1,744	2,156,915	0.4
Parker-Hannifin Corp.	3.50%	09/15/2022	USD 1,290	1,351,066	0.3
Siemens Financieringsmaatschappij NV	0.00%	02/20/2023	EUR 1,461	1,771,646	0.3
Siemens Financieringsmaatschappij NV	0.13%	06/05/2022	487	590,539	0.1
				5,870,166	1.1
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
AT&T, Inc.	2.75%	05/19/2023	1,315	1,687,442	0.3
Telstra Corp. Ltd.	4.80%	10/12/2021	USD 1,425	1,463,074	0.3
Vodafone Group PLC	4.65%	01/20/2022	EUR 1,524	1,919,506	0.3
				5,070,022	0.9
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
American Honda Finance Corp.	1.60%	04/20/2022	311	382,572	0.1
American Honda Finance Corp.	2.63%	10/14/2022	GBP 838	1,206,231	0.2
Daimler AG	2.63%	04/07/2025	EUR 1,091	1,449,211	0.3
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	0.90%	11/19/2024	424	521,726	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	4.05%	02/04/2022	USD 438	452,519	0.1
Hyundai Capital America	2.85%	11/01/2022	1,541	1,592,973	0.3
Toyota Motor Credit Corp.	0.00%	07/21/2021	EUR 1,612	1,947,998	0.3
Volkswagen Leasing GmbH	1.13%	04/04/2024	1,889	2,343,833	0.4
				9,897,063	1.8
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Marriott International, Inc./MD(b)	0.88%	03/08/2021	USD 872	871,709	0.2
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	0.00%	02/11/2024	EUR 1,558	1,888,325	0.4

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
AbbVie, Inc. ....	1.38%	05/17/2024	EUR 1,519	\$ 1,905,359	0.3%
Amgen, Inc. ....	1.25%	02/25/2022	2,060	2,514,795	0.5
Anheuser-Busch InBev SA/NV ....	9.75%	07/30/2024	GBP 355	644,051	0.1
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.(b) ....	0.99%	09/06/2022	AUD 2,493	1,932,286	0.4
Asahi Group Holdings Ltd. ....	0.16%	10/23/2024	EUR 1,958	2,369,570	0.4
AstraZeneca PLC ....	0.75%	05/12/2024	1,088	1,343,550	0.2
Baxter International, Inc. ....	0.40%	05/15/2024	1,299	1,588,406	0.3
Baxter International, Inc. ....	1.30%	05/30/2025	375	474,947	0.1
Bayer AG ....	0.38%	07/06/2024	1,363	1,662,042	0.3
Cargill, Inc. ....	2.50%	02/15/2023	1,159	1,473,248	0.3
Danone SA ....	3.00%	06/15/2022	USD 532	549,297	0.1
DH Europe Finance SARL(b) ....	0.00%	06/30/2022	EUR 2,065	2,496,252	0.5
Diageo Finance PLC ....	0.13%	10/12/2023	1,354	1,643,929	0.3
GlaxoSmithKline Capital PLC ....	0.13%	05/12/2023	2,143	2,603,213	0.5
Heineken NV ....	3.40%	04/01/2022	USD 1,461	1,506,385	0.3
Medtronic Global Holdings SCA ....	0.38%	03/07/2023	EUR 1,741	2,124,493	0.4
Sanofi ....	4.00%	03/29/2021	USD 496	497,149	0.1
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd. ....	1.13%	11/21/2022	EUR 502	618,660	0.1
				<u>27,947,632</u>	<u>5.2</u>
<b>ENERGIE</b>					
BG Energy Capital PLC. ....	4.00%	10/15/2021	USD 857	875,600	0.2
BP Capital Markets PLC ....	1.88%	04/07/2024	EUR 1,807	2,304,979	0.4
Exxon Mobil Corp. ....	0.14%	06/26/2024	2,040	2,474,338	0.5
Kinder Morgan, Inc.(b) ....	1.52%	01/15/2023	USD 1,836	1,852,919	0.3
Repsol International Finance BV ....	0.13%	10/05/2024	EUR 1,461	1,768,379	0.3
Saudi Arabian Oil Co. ....	2.88%	04/16/2024	USD 1,782	1,878,072	0.4
Total Capital International SA ....	2.13%	03/15/2023	EUR 1,850	2,342,385	0.4
				<u>13,496,672</u>	<u>2.5</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Baidu, Inc. ....	2.88%	07/06/2022	USD 1,402	1,439,691	0.3
Fidelity National Information Services, Inc. ....	0.75%	05/21/2023	EUR 1,984	2,434,784	0.4
Fiserv, Inc. ....	0.38%	07/01/2023	1,222	1,489,661	0.3
Honeywell International, Inc. ....	0.00%	03/10/2024	455	550,456	0.1
Honeywell International, Inc. ....	1.30%	02/22/2023	2,221	2,759,055	0.5
International Business Machines Corp. ....	0.38%	01/31/2023	2,026	2,472,729	0.5
LG Display Co., Ltd. ....	3.88%	11/15/2021	USD 530	540,749	0.1
				<u>11,687,125</u>	<u>2.2</u>
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Penske Truck Leasing Co. Lp/PTL Finance Corp. ....	3.65%	07/29/2021	1,977	1,998,175	0.4
				<u>82,141,282</u>	<u>15.3</u>
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series G ....	1.13%	02/28/2024	EUR 1,656	2,058,209	0.4
Banco Santander SA ....	2.75%	09/12/2023	GBP 1,850	2,694,482	0.5
Bank of America Corp. ....	1.38%	02/07/2025	EUR 2,065	2,587,332	0.5
Bank of Nova Scotia (The) ....	1.38%	12/05/2023	GBP 1,124	1,595,409	0.3
Bankia SA ....	1.00%	06/25/2024	EUR 1,169	1,442,411	0.3
Barclays PLC(b) ....	1.57%	05/16/2024	USD 1,354	1,380,092	0.3
Barclays PLC(b) ....	1.85%	01/10/2023	195	196,968	0.0
BNP Paribas SA ....	1.13%	08/28/2024	EUR 1,850	2,316,437	0.4
BPCE SA ....	0.63%	09/26/2024	1,558	1,912,861	0.4
Citigroup, Inc. ....	1.75%	01/28/2025	1,480	1,902,602	0.3
Credit Suisse Group AG ....	1.25%	07/17/2025	1,524	1,903,779	0.3
Danske Bank A/S ....	3.00%	09/20/2022	USD 2,050	2,075,750	0.4
Deutsche Bank AG ....	3.88%	02/12/2024	GBP 1,071	1,603,044	0.3
Goldman Sachs Group, Inc. (The) ....	2.13%	09/30/2024	EUR 1,646	2,126,923	0.4
ING Groep NV ....	1.00%	09/20/2023	1,071	1,330,930	0.2
Intesa Sanpaolo SpA ....	3.13%	07/14/2022	USD 1,719	1,772,394	0.3
JPMorgan Chase & Co. ....	2.75%	02/01/2023	EUR 1,344	1,714,939	0.3
Lloyds Banking Group PLC ....	0.63%	01/15/2024	1,680	2,050,879	0.4
Morgan Stanley, Series G ....	1.00%	12/02/2022	2,030	2,498,883	0.5
NatWest Markets PLC ....	2.38%	05/21/2023	USD 1,490	1,549,551	0.3
Nordea Bank Abp(b) ....	1.13%	08/30/2023	891	902,238	0.2
Nordea Bank Abp ....	3.75%	08/30/2023	506	546,387	0.1
Santander UK Group Holdings PLC ....	3.57%	01/10/2023	1,315	1,349,265	0.2
Societe Generale SA ....	1.25%	02/15/2024	EUR 1,558	1,944,285	0.4
Standard Chartered PLC ....	2.74%	09/10/2022	USD 1,883	1,903,214	0.3
Toronto-Dominion Bank (The) ....	0.38%	04/25/2024	EUR 2,055	2,512,993	0.5
UBS Group AG ....	2.13%	03/04/2024	1,120	1,439,164	0.3
UniCredit SpA ....	3.75%	04/12/2022	USD 1,417	1,461,798	0.3
Wells Fargo & Co. ....	2.13%	04/22/2022	GBP 1,865	2,643,713	0.5
				<u>51,416,932</u>	<u>9.6</u>

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
<b>FINANZEN</b>							
	Aviation Capital Group LLC .....	4.38%	01/30/2024	USD	758 \$	812,659	0.1%
	JAB Holdings BV .....	1.25%	05/22/2024	EUR	1,266	1,582,706	0.3
						2,395,365	0.4
<b>VERSICHERUNGEN</b>							
	Berkshire Hathaway, Inc. ....	0.63%	01/17/2023		2,084	2,552,377	0.5
	Chubb INA Holdings, Inc. ....	0.30%	12/15/2024		936	1,138,967	0.2
	Metropolitan Life Global Funding I .....	0.00%	09/23/2022		999	1,210,452	0.2
	Metropolitan Life Global Funding I, Series G .....	2.63%	12/05/2022	GBP	1,139	1,650,042	0.3
						6,551,838	1.2
<b>REITS</b>							
	Digital Dutch Finco BV .....	0.63%	07/15/2025	EUR	1,105	1,356,282	0.3
						61,720,417	11.5
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>							
<b>ELEKTRIZITÄT</b>							
	E.ON International Finance BV .....	5.63%	12/06/2023	GBP	1,120	1,766,840	0.3
	EDP Finance BV, Series E .....	8.63%	01/04/2024		925	1,566,429	0.3
	Electricite de France SA .....	3.88%	01/18/2022	EUR	779	974,668	0.2
	Enel Finance International NV .....	0.00%	06/17/2024		1,003	1,212,900	0.2
	Enel Finance International NV .....	2.65%	09/10/2024	USD	1,208	1,274,842	0.3
	Engie SA .....	0.38%	02/28/2023	EUR	2,045	2,491,917	0.5
	Scottish Power UK PLC .....	6.75%	05/29/2023	GBP	1,013	1,603,146	0.3
	Western Power Distribution East Midlands PLC .....	5.25%	01/17/2023		443	669,789	0.1
						11,560,531	2.2
<b>ERDGAS</b>							
	Southern Gas Networks PLC .....	4.88%	10/05/2023		1,154	1,777,919	0.3
<b>SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE</b>							
	Veolia Environnement SA .....	0.31%	10/04/2023	EUR	877	1,068,583	0.2
						14,407,033	2.7
						158,268,732	29.5
<b>GEDECKTE ANLEIHEN</b>							
	Australia & New Zealand Banking Group Ltd. ....	0.45%	11/22/2023		2,620	3,231,514	0.6
	Bank of Nova Scotia (The) .....	0.38%	10/23/2023		1,880	2,314,684	0.4
	BPCE SFH SA .....	2.38%	11/29/2023		2,045	2,659,823	0.5
	CaixaBank SA .....	1.00%	02/08/2023		2,337	2,897,041	0.6
	Canadian Imperial Bank of Commerce .....	1.13%	06/30/2022	GBP	721	1,016,087	0.2
	Cie de Financement Foncier SA .....	2.38%	11/21/2022	EUR	1,295	1,640,077	0.3
	Commonwealth Bank of Australia .....	0.38%	04/24/2023		1,765	2,166,129	0.4
	Korea Housing Finance Corp. ....	0.10%	06/18/2024		1,855	2,261,041	0.4
	National Bank of Canada .....	0.25%	07/24/2023		1,646	2,018,288	0.4
	Sumitomo Mitsui Banking Corp. ....	0.55%	11/06/2023		1,885	2,322,800	0.4
	Swedbank Hypotek AB .....	0.40%	05/08/2024		1,880	2,326,353	0.4
	Westpac Banking Corp., Series G .....	0.50%	05/17/2024		1,466	1,816,054	0.4
						26,669,891	5.0
<b>INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE</b>							
<b>DEUTSCHLAND</b>							
	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond .....	0.10%	04/15/2026		8,292	10,869,301	2.0
<b>NEUSEELAND</b>							
	New Zealand Government Inflation Linked Bond, Series 925 .....	2.00%	09/20/2025	NZD	6,228	5,584,559	1.0
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>							
	U.S. Treasury Inflation Index .....	0.13%	10/15/2024	USD	6,827	7,363,616	1.4
						23,817,476	4.4
<b>REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN</b>							
<b>KANADA</b>							
	Canada Housing Trust No. 1 .....	2.90%	06/15/2024	CAD	16,323	13,733,459	2.6
<b>JAPAN</b>							
	Development Bank of Japan, Inc., Series G .....	0.01%	10/15/2024	EUR	2,420	2,946,450	0.5
<b>NORWEGEN</b>							
	Kommunalbanken AS .....	5.13%	05/14/2021	NZD	3,199	2,333,789	0.4
<b>SPANIEN</b>							
	Fondo De Titulizacion Del Deficit Del Sistema Electrico FTA. ....	5.90%	03/17/2021	EUR	1,266	1,531,576	0.3
						20,545,274	3.8
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>							
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>							
	Bellemeade Re Ltd.						
	Series 2018-3A, Class M1B(b) .....	1.97%	10/25/2028	USD	526	529,049	0.1
	Series 2019-3A, Class M1B(b) .....	1.72%	07/25/2029		782	785,140	0.1
	Connecticut Avenue Securities Trust,						
	Series 2020-R02, Class 2M1(b) .....	0.86%	01/25/2040		356	356,007	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency					
Credit Risk Debt Notes					
Series 2014-DN3, Class M3(b)	4.11%	08/25/2024	USD 761	\$ 777,577	0.1%
Series 2014-HQ2, Class M3(b)	3.86%	09/25/2024	1,164	1,200,499	0.2
Series 2015-DN1, Class M3(b)	4.26%	01/25/2025	50	49,903	0.0
Series 2015-DNA2, Class M3(b)	4.02%	12/25/2027	439	445,845	0.1
Series 2016-DNA4, Class M3(b)	3.91%	03/25/2029	804	834,907	0.2
Series 2017-DNA1, Class M2(b)	3.36%	07/25/2029	369	380,150	0.1
Series 2017-DNA2, Class M2(b)	3.56%	10/25/2029	467	483,215	0.1
Series 2017-DNA3, Class M2(b)	2.62%	03/25/2030	1,326	1,350,060	0.3
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue					
Securities					
Series 2014-C04, Class 1M2(b)	5.01%	11/25/2024	1,292	1,330,392	0.2
Series 2014-C04, Class 2M2(b)	5.11%	11/25/2024	931	947,097	0.2
Series 2015-C03, Class 2M2(b)	5.13%	07/25/2025	139	141,594	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(b)	6.11%	09/25/2028	772	812,872	0.2
Series 2016-C03, Class 1M2(b)	5.41%	10/25/2028	937	985,732	0.2
Series 2016-C06, Class 1M2(b)	4.36%	04/25/2029	1,584	1,648,187	0.3
Home Re Ltd., Series 2019-1, Class M1(b)	1.77%	05/25/2029	672	671,891	0.1
Radnor Re Ltd., Series 2019-2, Class M1B(b)	1.86%	06/25/2029	2,344	2,342,440	0.4
				<u>16,072,557</u>	<u>3.0</u>
<b>GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN</b>					
KANADA					
Hydro-Quebec, Series HX	10.50%	10/15/2021	CAD 7,791	6,509,982	1.2
Province of Ontario Canada, Series HC	9.50%	07/13/2022	2,922	2,580,145	0.5
Province of Ontario Canada, Series HP	8.10%	09/08/2023	2,094	1,954,132	0.4
Province of Quebec Canada	9.38%	01/16/2023	2,824	2,589,814	0.5
				<u>13,634,073</u>	<u>2.6</u>
<b>QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE</b>					
<b>QUASI-STAATSANLEIHEN</b>					
CHILE					
Corp. Nacional del Cobre de Chile	2.25%	07/09/2024	EUR 1,222	1,575,196	0.3
CHINA					
Export-Import Bank of China (The)	0.75%	06/08/2022	1,768	2,154,105	0.4
Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd.	1.00%	04/28/2022	1,373	1,671,884	0.3
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	1.25%	05/19/2022	1,101	1,344,858	0.3
				<u>5,170,847</u>	<u>1.0</u>
SÜDKOREA					
Export-Import Bank of Korea, Series 5FRN(b)	1.09%	01/25/2022	USD 2,318	2,330,007	0.4
Korea Development Bank (The)(b)	0.71%	10/01/2022	2,756	2,764,617	0.5
				<u>5,094,624</u>	<u>0.9</u>
				<u>11,840,667</u>	<u>2.2</u>
<b>REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN</b>					
CHILE					
Chile Government International Bond	1.63%	01/30/2025	EUR 1,062	1,358,492	0.2
INDONESIEN					
Indonesia Government International Bond	2.15%	07/18/2024	1,325	1,685,012	0.3
PHILIPPINEN					
Philippine Government International Bond	0.00%	02/03/2023	1,422	1,704,900	0.3
KATAR					
Qatar Government International Bond	3.88%	04/23/2023	USD 1,339	1,429,533	0.3
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE					
Abu Dhabi Government International Bond	2.50%	10/11/2022	1,373	1,417,600	0.3
				<u>7,595,537</u>	<u>1.4</u>
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
OCP CLO Ltd., Series 2020-18A, Class A(b)	2.02%	04/20/2030	1,619	1,621,516	0.3
SCFF I Ltd., Series 2020-1A, Class A1(b)	2.74%	04/15/2031	1,771	1,774,042	0.3
				<u>3,395,558</u>	<u>0.6</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>					
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
MSCG Trust, Series 2018-SELF, Class A(b)	1.01%	10/15/2037	1,346	1,345,931	0.3
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-C8, Class B	3.98%	10/15/2045	1,077	1,078,704	0.2
				<u>2,424,635</u>	<u>0.5</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>ENERGIE</b>					
Occidental Petroleum Corp.(b) .....	1.64%	08/15/2022	USD 1,686	\$ 1,647,650	0.3%
<b>HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAUHLUNGEN</b>					
<b>FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT</b>					
Federal National Mortgage Association, Series 1999 .....	7.00%	09/01/2029	1	724	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 1999 .....	7.00%	10/01/2029	2	2,056	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2000 .....	7.00%	12/01/2030	1	975	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001 .....	7.00%	05/01/2031	0*	431	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001 .....	7.00%	09/01/2031	8	10,868	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001 .....	7.00%	11/01/2031	3	3,899	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001 .....	7.00%	12/01/2031	31	35,504	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001 .....	7.00%	01/01/2032	2	1,833	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2002 .....	7.00%	02/01/2032	2	2,557	0.0
				<u>58,847</u>	<u>0.0</u>
				<u>523,237,420</u>	<u>97.5</u>
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Apidos CLO XXXIII, Series 2020-33A, Class A(b) .....	1.92%	07/24/2031	1,249	1,252,689	0.2
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class A1A(b) .....	1.65%	07/23/2032	1,433	1,434,018	0.3
				<u>2,686,707</u>	<u>0.5</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Eaton Capital Unlimited Co. ....	0.02%	05/14/2021	EUR 1,913	2,308,714	0.4
				<u>4,995,421</u>	<u>0.9</u>
<b>Gesamtanlagen</b>				<u>\$ 528,232,841</u>	<u>98.4%</u>
(Kosten \$527,963,974) .....					
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(c) .....	0.01 %	–		54,369	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(c) .....	0.00 %	–		53,919	0.0
BBH, Grand Cayman(c) .....	(0.29)%	–		1,092	0.0
BBH, Grand Cayman(c) .....	(0.06)%	–		1,402	0.0
BBH, Grand Cayman(c) .....	0.00 %	–		8,220	0.0
BBH, Grand Cayman(c) .....	0.07 %	–		166	0.0
BBH, Grand Cayman(c) .....	2.80 %	–		1	0.0
Deutsche Bank, Frankfurt(c) .....	(0.71)%	–		300,855	0.1
HSBC Bank PLC, London(c) .....	0.00 %	–		113,940	0.0
MUFG, Tokyo(c) .....	(0.30)%	–		35,941	0.0
National Australia Bank, London(c) .....	(0.06)%	–		54,275	0.0
Sumitomo Trust Bank, London(c) .....	0.00 %	–		2,057,408	0.4
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....				<u>2,681,588</u>	<u>0.5</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....				<u>6,150,580</u>	<u>1.1</u>
<b>Nettovermögen</b> .....				<u>\$ 537,065,009</u>	<u>100.0%</u>

**TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
<b>Long</b>					
Korea 3 Yr Bond Futures .....	03/16/2021	57	\$ 5,706,749	\$ 5,699,589	\$ (7,160)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures .....	06/30/2021	198	24,719,732	24,509,350	(210,382)
<b>Short</b>					
Euro-BOBL Futures .....	03/08/2021	592	96,470,517	95,886,465	584,052
Euro-Schatz Futures .....	03/08/2021	64	8,709,486	8,699,404	10,082
					<u>\$ 376,592</u>
				Wertsteigerung	\$ 594,134
				Wertminderung	\$ (217,542)



DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	USD 2,758	EUR 2,269	03/17/2021	\$ (19,757)
Bank of America, NA.	EUR 3,357	USD 4,071	03/17/2021	18,740
Bank of America, NA.	RUB 93,920	USD 1,236	03/24/2021	(19,071)
Bank of America, NA.	RUB 40,904	USD 554	03/24/2021	7,637
Bank of America, NA.	USD 1,296	RUB 95,853	03/24/2021	(14,927)
Barclays Bank PLC	EUR 41,400	USD 50,346	03/11/2021	384,332
BNP Paribas SA.	CLP 738,670	USD 1,041	03/18/2021	20,732
BNP Paribas SA.	COP 11,150,708	USD 3,244	03/18/2021	188,138
BNP Paribas SA.	USD 1,399	CLP 1,027,356	03/18/2021	21,056
BNP Paribas SA.	HUF 1,634,684	USD 5,484	03/24/2021	45,381
BNP Paribas SA.	GBP 18,897	USD 25,747	04/09/2021	(585,731)
BNP Paribas SA.	EUR 4,604	USD 5,596	04/16/2021	35,185
BNP Paribas SA.	CAD 37,411	USD 29,475	04/22/2021	76,138
Brown Brothers Harriman & Co.	NZD 7,335	USD 5,318	03/05/2021	18,446
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY 1,252,965	USD 12,157	03/12/2021	401,675
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY 871,277	USD 8,362	03/25/2021	186,295
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD 4,948	USD 3,820	03/30/2021	12,074
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 319	AUD 412	03/30/2021	(2,104)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 1,419	GBP 1,033	04/09/2021	20,513
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 1,122	CNH 7,299	04/22/2021	(349)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 31,225	USD 37,940	04/29/2021	214,207
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 18,521	AUD 24,317	03/05/2021	190,523
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 8,063	CAD 10,358	03/05/2021	75,972
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,510	EUR 2,083	03/05/2021	5,304
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 11,321	GBP 8,297	03/05/2021	238,423
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 613	NZD 854	03/05/2021	3,078
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,424	SGD 1,898	03/05/2021	(723)
Citibank, NA	EUR 5,213	USD 6,317	03/17/2021	25,215
Citibank, NA	USD 2,055	EUR 1,686	03/17/2021	(20,150)
Citibank, NA	CLP 1,028,908	USD 1,438	03/18/2021	15,925
Citibank, NA	USD 4,139	CLP 3,033,890	03/18/2021	53,337
Citibank, NA	RUB 193,554	USD 2,605	03/24/2021	17,787
Citibank, NA	IDR 39,411,271	USD 2,784	04/15/2021	65,392
Citibank, NA	INR 81,568	USD 1,101	04/15/2021	5,202
Citibank, NA	KRW 1,626,945	USD 1,493	04/22/2021	48,696
Citibank, NA	CHF 1,056	USD 1,189	05/06/2021	25,949
Deutsche Bank AG.	NZD 9,610	USD 6,941	03/05/2021	(2,670)
Deutsche Bank AG.	USD 1,289	NZD 1,801	03/05/2021	12,040
Deutsche Bank AG.	USD 6,166	EUR 5,095	03/11/2021	(17,317)
Deutsche Bank AG.	USD 2,487	INR 184,957	04/15/2021	(2,570)
Deutsche Bank AG.	JPY 1,040,563	USD 10,008	04/16/2021	240,221
Deutsche Bank AG.	USD 8,095	JPY 857,393	05/20/2021	(44,219)
Goldman Sachs Bank USA	EUR 958	USD 1,153	03/17/2021	(3,900)
Goldman Sachs Bank USA	USD 3,891	GBP 2,861	04/09/2021	95,193
HSBC Bank USA.	EUR 1,150	USD 1,394	03/17/2021	5,516
HSBC Bank USA.	EUR 42,235	USD 51,180	03/31/2021	180,282
HSBC Bank USA.	USD 997	IDR 13,965,687	04/15/2021	(33,882)
JPMorgan Chase Bank, NA.	USD 1,626	EUR 1,340	03/17/2021	(9,002)
JPMorgan Chase Bank, NA.	USD 1,435	CAD 1,816	04/22/2021	(8,459)
Morgan Stanley & Co., Inc.	NZD 18,910	USD 13,482	03/05/2021	(181,613)
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD 7,094	JPY 735,565	03/12/2021	(192,589)
Morgan Stanley & Co., Inc.	EUR 48,498	USD 58,848	03/17/2021	310,420
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD 1,222	EUR 1,014	03/17/2021	1,304
Morgan Stanley & Co., Inc.	CLP 1,036,994	USD 1,414	03/18/2021	(19,200)
Morgan Stanley & Co., Inc.	CLP 1,257,735	USD 1,778	03/18/2021	40,301
Morgan Stanley & Co., Inc.	PLN 17,205	USD 4,624	03/24/2021	31,994
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD 3,252	PLN 11,979	03/24/2021	(55,201)
Morgan Stanley & Co., Inc.	MYR 11,542	USD 2,770	03/25/2021	(65,004)
Morgan Stanley & Co., Inc.	AUD 31,835	USD 24,686	03/30/2021	187,153
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD 5,979	AUD 7,747	03/30/2021	(17,480)
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD 5,464	CNH 35,324	04/22/2021	(37,386)
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD 2,742	KRW 3,065,406	04/22/2021	(21,888)
Morgan Stanley & Co., Inc.	JPY 622,833	USD 5,883	05/20/2021	34,473
Royal Bank of Scotland PLC	EUR 1,332	USD 1,607	03/17/2021	(473)
Royal Bank of Scotland PLC	EUR 7,760	USD 9,442	03/17/2021	75,167
Royal Bank of Scotland PLC	USD 1,186	EUR 974	03/17/2021	(11,228)
Standard Chartered Bank	IDR 54,631,444	USD 3,870	04/15/2021	100,817
Standard Chartered Bank	INR 102,391	USD 1,384	04/15/2021	8,205
UBS AG	MXN 31,581	USD 1,528	04/16/2021	26,582
				\$ 2,384,127
			Wertsteigerung	\$ 3,771,020
			Wertminderung	\$ (1,386,893)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

**ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS**

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	CNY 43,826	05/07/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	1.830%	\$ (283,367)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	75,167	07/21/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.585%	(152,057)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	41,820	07/22/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.510%	(104,692)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	57,354	12/02/2024	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.938%	23,695
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	42,405	09/01/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.748%	(44,566)
Insgesamt					<u>\$ (560,987)</u>
				Wertsteigerung	\$ 23,695
				Wertminderung	\$ (584,682)

\* Kapitalbetrag geringer als 500.

- (a) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für offene OTC-Derivate zu dienen.  
 (b) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2021.  
 (c) Tagesgeld.

**Währungskürzel:**

AUD	– Australian Dollar
CAD	– Canadian Dollar
CHF	– Swiss Franc
CLP	– Chilean Peso
CNH	– Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
CNY	– Chinese Yuan Renminbi
COP	– Colombian Peso
EUR	– Euro
GBP	– Great British Pound
HUF	– Hungarian Forint
IDR	– Indonesian Rupiah
INR	– Indian Rupee
JPY	– Japanese Yen
KRW	– South Korean Won
MXN	– Mexican Peso
MYR	– Malaysian Ringgit
NZD	– New Zealand Dollar
PLN	– Polish Zloty
RUB	– Russian Ruble
SGD	– Singapore Dollar
USD	– United States Dollar

**Glossar:**

BOBL	– Bundesobligationen
CBT	– Chicago Board of Trade
CLO	– Collateralized Loan Obligations
CMBS	– Commercial Mortgage-Backed Securities
LCH	– London Clearing House
OAT	– Obligations Assimilables du Trésor
REIT	– Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>					
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Advanced Drainage Systems, Inc.	5.00%	09/30/2027	USD 2,804	\$ 2,944,133	0.0%
Avient Corp.	5.75%	05/15/2025	7,156	7,578,664	0.0
Big River Steel LLC/BRS Finance Corp.	6.63%	01/31/2029	28,002	30,225,453	0.2
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	20,942	24,677,865	0.1
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,106	17,626,616	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	4.63%	03/01/2029	8,053	7,882,881	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	4.88%	03/01/2031	8,434	8,256,426	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	2,020	2,173,234	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	9.88%	10/17/2025	22,399	26,226,174	0.1
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	5,648	6,210,727	0.0
Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034	11,724	14,532,324	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.45%	03/15/2043	16,385	20,378,390	0.1
Graham Packaging Co., Inc.	7.13%	08/15/2028	6,383	6,906,951	0.0
Grinding Media, Inc./Moly-Cop AltaSteel Ltd.	7.38%	12/15/2023	12,839	13,075,303	0.1
Hecla Mining Co.	7.25%	02/15/2028	25,670	27,833,547	0.1
Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV, Inc.	9.00%	07/01/2028	19,086	21,214,193	0.1
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	28,516	29,794,110	0.2
Joseph T Ryerson & Son, Inc.	8.50%	08/01/2028	11,638	12,814,751	0.1
Kaiser Aluminum Corp.	6.50%	05/01/2025	4,837	5,174,399	0.0
Mercer International, Inc.	5.13%	02/01/2029	22,091	22,436,574	0.1
Nouryon Holding BV	6.50%	10/01/2026	EUR 12,500	15,735,557	0.1
Nouryon Holding BV	8.00%	10/01/2026	USD 15,275	16,246,581	0.1
Novelis Corp.	5.88%	09/30/2026	2,000	2,085,008	0.0
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	21,555	23,251,317	0.1
Peabody Energy Corp.(a)	8.50%	12/31/2024	1,884	1,111,560	0.0
PIC AU Holdings LLC/PIC AU Holdings Corp.	10.00%	12/31/2024	1,871	1,665,190	0.0
United States Steel Corp.	6.25%	03/15/2026	10,974	10,538,403	0.1
United States Steel Corp.	12.00%	06/01/2025	47,975	57,479,617	0.3
Valvoline, Inc.	4.25%	02/15/2030	26,506	27,399,744	0.1
WR Grace & Co.-Conn	4.88%	06/15/2027	6,463	6,699,275	0.0
				<u>470,174,967</u>	<u>2.2</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
ARD Finance SA(a)	5.00%	06/30/2027	EUR 19,306	24,106,457	0.1
ARD Finance SA(a)	6.50%	06/30/2027	USD 21,828	23,106,867	0.1
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	6.00%	02/15/2025	1,667	1,723,178	0.0
Bombardier, Inc.	5.75%	03/15/2022	8,173	8,336,525	0.1
Bombardier, Inc.	6.13%	01/15/2023	1,667	1,646,653	0.0
Bombardier, Inc.	7.50%	12/01/2024	15,280	14,334,648	0.1
Bombardier, Inc.	7.50%	03/15/2025	42,769	39,114,354	0.2
Bombardier, Inc.	7.88%	04/15/2027	541	485,926	0.0
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	2,611	2,838,319	0.0
Cleaver-Brooks, Inc.	7.88%	03/01/2023	13,689	13,450,253	0.1
Colfax Corp.	6.00%	02/15/2024	3,182	3,286,089	0.0
Colfax Corp.	6.38%	02/15/2026	941	1,005,791	0.0
Cornerstone Building Brands, Inc.	8.00%	04/15/2026	2,000	2,074,973	0.0
Covanta Holding Corp.	5.88%	07/01/2025	3,000	3,113,536	0.0
EnerSys	4.38%	12/15/2027	18,085	19,103,933	0.1
F-Brasile SpA/F-Brasile US LLC, Series XR	7.38%	08/15/2026	20,200	20,453,137	0.1
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026	24,892	26,160,247	0.1
Granite US Holdings Corp.	11.00%	10/01/2027	27,965	31,355,067	0.2
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	27,481	28,855,639	0.1
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	2,036	2,074,216	0.0
Mauser Packaging Solutions Holding Co.	5.50%	04/15/2024	5,301	5,320,866	0.0
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	7,075	7,269,447	0.0
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	20,393	581,153	0.0
Signature Aviation US Holdings, Inc.	4.00%	03/01/2028	1,667	1,687,295	0.0
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	5.25%	01/15/2029	5,336	5,662,175	0.0
Terex Corp.	5.63%	02/01/2025	6,909	7,089,876	0.0
Tervita Corp.	11.00%	12/01/2025	27,174	29,642,254	0.2
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024	7,229	7,244,749	0.0
Triumph Group, Inc.	7.75%	08/15/2025	8,167	7,994,283	0.0
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	14,627	16,272,166	0.1
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	EUR 1,566	1,931,366	0.0
Vertical Holdco GmbH	7.63%	07/15/2028	USD 8,693	9,390,636	0.1
Vertical US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	17,684	18,437,072	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	31,560	34,166,024	0.2
Wesco Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	10,669	11,852,780	0.1
				<u>431,167,950</u>	<u>2.1</u>



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	USD 36,810	\$ 37,722,576	0.2%
Altice Financing SA	5.00%	01/15/2028	1,953	1,954,744	0.0
Altice Financing SA	7.50%	05/15/2026	42,708	44,594,486	0.2
Arches Buyer, Inc.	6.13%	12/01/2028	8,568	8,863,088	0.1
Banjay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	6,056	6,172,329	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	18,000	18,630,631	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.75%	02/15/2026	493	509,474	0.0
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	22,181	22,555,607	0.1
CSC Holdings LLC	5.50%	05/15/2026	2,000	2,068,417	0.0
CSC Holdings LLC	5.50%	04/15/2027	6,197	6,515,651	0.0
CSC Holdings LLC	7.50%	04/01/2028	17,996	19,824,136	0.1
DISH DBS Corp.	5.00%	03/15/2023	36,424	37,556,201	0.2
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	1,544	1,617,935	0.0
DISH DBS Corp.	6.75%	06/01/2021	4,824	4,884,914	0.0
Gray Television, Inc.	5.88%	07/15/2026	4,000	4,146,382	0.0
iHeartCommunications, Inc.	4.75%	01/15/2028	6,435	6,570,764	0.0
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	7,448	7,635,889	0.0
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026	2,630	2,783,125	0.0
iHeartCommunications, Inc.	8.38%	05/01/2027	4,768	5,053,147	0.0
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029	2,301	2,423,271	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	48,857	51,860,420	0.3
Liberty Interactive LLC(b)	3.75%	02/15/2030	11,951	9,360,591	0.1
Liberty Interactive LLC	8.25%	02/01/2030	2,000	2,311,463	0.0
Meredith Corp.	6.88%	02/01/2026	55,144	56,259,396	0.3
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	6,800	5,849,010	0.0
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	12,566	11,574,203	0.1
Netflix, Inc.	5.88%	11/15/2028	33,984	40,691,825	0.2
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp.	4.63%	03/15/2030	10,335	10,252,497	0.1
Scripps Escrow II, Inc.	5.38%	01/15/2031	9,519	9,669,958	0.1
Scripps Escrow, Inc.	5.88%	07/15/2027	12,381	12,886,233	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	18,660	18,731,935	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.88%	03/15/2026	895	915,127	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	406	440,952	0.0
TEGNA, Inc.	4.75%	03/15/2026	6,806	7,250,707	0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029	18,735	19,532,983	0.1
TEGNA, Inc.	5.50%	09/15/2024	1,242	1,264,283	0.0
Univision Communications, Inc.	5.13%	02/15/2025	1,681	1,682,602	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	27,088	28,440,734	0.1
Univision Communications, Inc.	9.50%	05/01/2025	13,167	14,352,347	0.1
UPC Holding BV	5.50%	01/15/2028	52,055	53,654,533	0.3
Urban One, Inc.	7.38%	02/01/2028	48,053	48,460,327	0.2
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	4,000	4,079,905	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.00%	04/15/2027	GBP 2,000	2,908,041	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	08/15/2026	USD 1,000	1,040,222	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	05/15/2029	3,952	4,230,187	0.0
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	1,484	1,559,114	0.0
Ziggo Bond Co. BV	6.00%	01/15/2027	2,820	2,943,409	0.0
Ziggo BV	5.50%	01/15/2027	20,626	21,491,215	0.1
				<u>685,776,986</u>	<u>3.3</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Altice France SA/France	7.38%	05/01/2026	11,327	11,824,182	0.1
Altice France SA/France	8.13%	02/01/2027	8,421	9,189,533	0.0
Arqiva Broadcast Finance PLC	6.75%	09/30/2023	GBP 6,698	9,634,304	0.0
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	USD 25,208	26,988,214	0.1
C&W Senior Financing DAC	7.50%	10/15/2026	14,419	15,312,668	0.1
CenturyLink, Inc., Series P	7.60%	09/15/2039	1,567	1,873,972	0.0
CenturyLink, Inc., Series T	5.80%	03/15/2022	1,492	1,548,543	0.0
Connect Finco SARRL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	37,256	38,559,960	0.2
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	24,110	25,846,064	0.1
DKT Finance ApS	7.00%	06/17/2023	EUR 8,954	11,082,860	0.1
DKT Finance ApS	9.38%	06/17/2023	USD 23,497	24,263,246	0.1
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	22,553	26,885,460	0.1
Frontier Communications Corp.	5.88%	10/15/2027	16,401	17,558,189	0.1
Frontier Communications Corp.	6.75%	05/01/2029	14,848	15,416,280	0.1
Hughes Satellite Systems Corp.	6.63%	08/01/2026	9,000	10,048,319	0.1
Hughes Satellite Systems Corp.	7.63%	06/15/2021	5,607	5,702,277	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(c)	5.50%	08/01/2023	33,777	21,618,437	0.1
Intelsat Jackson Holdings SA(c)	8.50%	10/15/2024	2,575	1,685,390	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(c)	9.75%	07/15/2025	2,000	1,281,929	0.0
Intrado Corp.	8.50%	10/15/2025	16,455	16,402,357	0.1
Nexstar Broadcasting, Inc.	5.63%	07/15/2027	11,783	12,445,235	0.1
Sprint Capital Corp.	8.75%	03/15/2032	455	676,493	0.0
Sprint Corp.	7.63%	02/15/2025	3,000	3,569,959	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Sprint Corp. ....	7.63%	03/01/2026	USD 8,328	\$ 10,221,049	0.1%
Sprint Corp. ....	7.88%	09/15/2023	25,000	28,601,353	0.1
Telecom Italia Capital SA .....	6.00%	09/30/2034	2,000	2,309,624	0.0
Telecom Italia Capital SA .....	7.20%	07/18/2036	31,658	40,575,643	0.2
Telecom Italia Capital SA .....	7.72%	06/04/2038	13,001	17,449,079	0.1
Zayo Group Holdings, Inc. ....	6.13%	03/01/2028	29,638	30,595,364	0.1
				<u>439,165,983</u>	<u>2.1</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
Adient US LLC .....	9.00%	04/15/2025	38,045	42,199,755	0.2
Allison Transmission, Inc. ....	5.88%	06/01/2029	6,094	6,642,667	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc. ....	6.25%	04/01/2025	10,690	11,012,552	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc. ....	6.25%	03/15/2026	4,000	4,096,724	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc. ....	6.50%	04/01/2027	8,019	8,372,598	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc. ....	6.88%	07/01/2028	23,971	25,465,653	0.1
Aston Martin Capital Holdings Ltd. ....	10.50%	11/30/2025	33,751	36,831,368	0.2
Aston Martin Capital Holdings Ltd.(a) .....	15.00%	11/30/2026	27,024	27,824,146	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co. ....	6.25%	05/15/2026	6,245	6,643,098	0.0
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co. ....	8.50%	05/15/2027	37,834	40,893,874	0.2
Dana, Inc. ....	5.38%	11/15/2027	232	243,327	0.0
Dana, Inc. ....	5.63%	06/15/2028	3,358	3,573,799	0.0
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC .....	8.00%	02/01/2028	34,435	36,659,659	0.2
Ford Motor Co. ....	8.50%	04/21/2023	32,333	36,168,610	0.2
Ford Motor Co. ....	9.00%	04/22/2025	10,929	13,267,271	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC .....	4.38%	08/06/2023	500	523,151	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(a) .....	3.75%	09/15/2026	EUR 1,111	1,364,122	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(a) .....	6.00%	05/15/2027	USD 15,335	16,240,461	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a) .....	6.38%	05/15/2029	15,335	16,776,425	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC .....	2.20%	01/15/2024	EUR 3,000	3,488,805	0.0
Jaguar Land Rover Automotive PLC .....	5.88%	11/15/2024	8,244	10,634,818	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC .....	5.88%	01/15/2028	USD 24,297	24,931,725	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC .....	7.75%	10/15/2025	24,649	26,682,234	0.1
Meritor, Inc. ....	6.25%	02/15/2024	3,867	3,919,444	0.0
Meritor, Inc. ....	6.25%	06/01/2025	7,776	8,293,461	0.0
Navistar International Corp. ....	6.63%	11/01/2025	17,855	18,554,159	0.1
PM General Purchaser LLC .....	9.50%	10/01/2028	27,234	29,854,645	0.2
Real Hero Merger Sub 2, Inc. ....	6.25%	02/01/2029	9,889	10,185,733	0.1
Tenneco, Inc. ....	5.00%	07/15/2024	EUR 5,450	6,719,045	0.0
Tenneco, Inc. ....	5.00%	07/15/2026	USD 31,522	29,629,532	0.2
Tenneco, Inc. ....	7.88%	01/15/2029	6,003	6,727,685	0.0
Titan International, Inc. ....	6.50%	11/30/2023	17,801	17,533,479	0.1
ZF North America Capital, Inc. ....	4.75%	04/29/2025	25,379	27,405,726	0.1
				<u>559,359,751</u>	<u>2.7</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG</b>					
Carnival Corp. ....	5.75%	03/01/2027	20,679	20,885,790	0.1
Carnival Corp. ....	7.63%	03/01/2026	EUR 15,125	18,808,160	0.1
Carnival Corp. ....	9.88%	08/01/2027	USD 13,439	15,421,252	0.1
Carnival Corp. ....	11.50%	04/01/2023	30,960	35,283,884	0.2
Cedar Fair LP .....	5.25%	07/15/2029	2,000	2,020,937	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./Magnum Management Corp./Millennium Op .....	5.50%	05/01/2025	39,998	41,949,766	0.2
Mattel, Inc. ....	5.88%	12/15/2027	2,598	2,828,400	0.0
Mattel, Inc. ....	6.75%	12/31/2025	2,951	3,101,355	0.0
NCL Corp. Ltd. ....	5.88%	03/15/2026	27,640	27,817,677	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd. ....	10.88%	06/01/2023	25,951	29,357,328	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd. ....	11.50%	06/01/2025	46,802	54,641,335	0.3
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc. ....	8.75%	05/01/2025	19,206	20,838,572	0.1
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc. ....	9.50%	08/01/2025	31,131	33,741,147	0.2
Six Flags Theme Parks, Inc. ....	7.00%	07/01/2025	7,239	7,795,522	0.0
Vail Resorts, Inc. ....	6.25%	05/15/2025	5,640	6,020,984	0.0
Viking Cruises Ltd. ....	5.88%	09/15/2027	29,535	28,440,015	0.1
Viking Cruises Ltd. ....	7.00%	02/15/2029	7,971	8,058,502	0.0
Viking Cruises Ltd. ....	13.00%	05/15/2025	9,492	11,168,427	0.1
VOC Escrow Ltd. ....	5.00%	02/15/2028	493	486,440	0.0
				<u>368,665,493</u>	<u>1.8</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Adams Homes, Inc. ....	7.50%	02/15/2025	16,531	17,320,721	0.1
Bally's Corp. ....	6.75%	06/01/2027	21,077	22,476,461	0.1
Beazer Homes USA, Inc. ....	5.88%	10/15/2027	12,791	13,340,433	0.1
Beazer Homes USA, Inc. ....	6.75%	03/15/2025	21,605	22,274,693	0.1
Boyd Gaming Corp. ....	6.38%	04/01/2026	2,336	2,411,673	0.0
Boyd Gaming Corp. ....	8.63%	06/01/2025	8,389	9,247,504	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./Brookfield Residential US Corp. ....	4.88%	02/15/2030	23,127	23,406,078	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>Brookfield Residential Properties, Inc./Brookfield Residential</b>					
US Corp. . . . .	6.25%	09/15/2027	USD 19,888	\$ 20,996,497	0.1%
Caesars Entertainment, Inc. . . . .	6.25%	07/01/2025	22,343	23,661,426	0.1
CP Atlas Buyer, Inc. . . . .	7.00%	12/01/2028	9,899	10,295,324	0.1
Empire Communities Corp. . . . .	7.00%	12/15/2025	6,172	6,490,134	0.0
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp. . . . .	7.88%	11/15/2025	32,611	34,403,658	0.2
Forestar Group, Inc. . . . .	5.00%	03/01/2028	7,964	8,348,007	0.0
Forestar Group, Inc. . . . .	8.00%	04/15/2024	11,953	12,501,639	0.1
Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp. . . . .	6.50%	07/15/2025	5,954	6,422,689	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc. . . . .	5.38%	05/01/2025	5,320	5,592,523	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc. . . . .	5.75%	05/01/2028	5,733	6,210,492	0.0
Installed Building Products, Inc. . . . .	5.75%	02/01/2028	5,705	6,083,377	0.0
International Game Technology PLC . . . . .	5.25%	01/15/2029	2,512	2,670,413	0.0
International Game Technology PLC . . . . .	6.25%	01/15/2027	9,125	10,336,015	0.1
International Game Technology PLC . . . . .	6.50%	02/15/2025	23,261	25,644,947	0.1
K. Hovnanian Enterprises, Inc. . . . .	10.00%	07/15/2022	35,940	36,306,029	0.2
KB Home . . . . .	4.80%	11/15/2029	5,544	5,974,650	0.0
KB Home . . . . .	7.50%	09/15/2022	7,596	8,265,321	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc. . . . .	6.13%	09/15/2025	13,943	14,849,867	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC . . . . .	6.50%	09/15/2026	41,661	43,241,756	0.2
Mattamy Group Corp. . . . .	4.63%	03/01/2030	24,097	25,037,258	0.1
Mattamy Group Corp. . . . .	5.25%	12/15/2027	9,677	10,181,189	0.0
Meritage Homes Corp. . . . .	7.00%	04/01/2022	10,422	10,998,800	0.1
MGM Resorts International . . . . .	6.00%	03/15/2023	954	1,017,094	0.0
MGM Resorts International . . . . .	7.75%	03/15/2022	2,370	2,503,716	0.0
Scientific Games International, Inc. . . . .	3.38%	02/15/2026	EUR 1,111	1,341,088	0.0
Scientific Games International, Inc. . . . .	5.00%	10/15/2025	USD 6,488	6,676,355	0.0
Scientific Games International, Inc. . . . .	7.00%	05/15/2028	7,525	7,972,458	0.0
Scientific Games International, Inc. . . . .	8.25%	03/15/2026	11,000	11,650,605	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp. . . . .	4.75%	02/15/2028	10,577	10,942,767	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp. . . . .	4.75%	04/01/2029	14,461	14,856,159	0.1
Stars Group Holdings BV/Stars Group US Co-Borrower LLC . . . . .	7.00%	07/15/2026	25,040	26,230,503	0.1
<b>Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP/Sugarhouse HSP</b>					
Gaming Finance Corp. . . . .	5.88%	05/15/2025	22,618	21,941,990	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc. . . . .	5.75%	01/15/2028	14,127	15,754,413	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc. . . . .	5.88%	06/15/2027	11,351	12,753,312	0.1
<b>Taylor Morrison Communities, Inc./Taylor Morrison Holdings II, Inc. . . . .</b>					
Holdings II, Inc. . . . .	5.88%	04/15/2023	15,712	16,772,560	0.1
Travel plus Leisure Co. . . . .	6.00%	04/01/2027	4,000	4,429,784	0.0
Travel + Leisure Co. . . . .	4.63%	03/01/2030	15,276	15,851,318	0.1
Travel + Leisure Co. . . . .	6.63%	07/31/2026	28,164	31,780,614	0.2
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp. . . . .	4.25%	05/30/2023	1,667	1,686,687	0.0
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp. . . . .	5.25%	05/15/2027	3,000	3,187,537	0.0
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp. . . . .	5.50%	03/01/2025	13,063	13,848,265	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp. . . . .	5.13%	10/01/2029	6,215	6,541,918	0.0
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp. . . . .	7.75%	04/15/2025	9,543	10,347,750	0.1
				<u>683,076,467</u>	<u>3.3</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS</b>					
IRB Holding Corp. . . . .	6.75%	02/15/2026	45,629	47,145,056	0.2
IRB Holding Corp. . . . .	7.00%	06/15/2025	10,678	11,585,760	0.1
Yum! Brands, Inc. . . . .	7.75%	04/01/2025	8,625	9,446,110	0.0
				<u>68,176,926</u>	<u>0.3</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
BCPE Ulysses Intermediate, Inc.(a) . . . . .	7.75%	04/01/2027	9,973	10,147,274	0.1
Burlington Coat Factory Warehouse Corp. . . . .	6.25%	04/15/2025	2,431	2,584,107	0.0
Dufry One BV . . . . .	2.50%	10/15/2024	EUR 17,530	20,372,852	0.1
Foundation Building Materials, Inc. . . . .	6.00%	03/01/2029	USD 5,396	5,379,729	0.0
L Brands, Inc. . . . .	5.25%	02/01/2028	3,551	3,798,569	0.0
L Brands, Inc. . . . .	6.63%	10/01/2030	2,689	3,028,162	0.0
L Brands, Inc. . . . .	6.75%	07/01/2036	9,880	11,877,993	0.1
L Brands, Inc. . . . .	6.88%	07/01/2025	1,664	1,818,483	0.0
L Brands, Inc. . . . .	6.88%	11/01/2035	12,781	15,439,217	0.1
L Brands, Inc. . . . .	6.95%	03/01/2033	13,864	15,364,628	0.1
L Brands, Inc. . . . .	7.50%	06/15/2029	5,283	5,968,860	0.0
L Brands, Inc. . . . .	7.60%	07/15/2037	4,421	5,152,406	0.0
L Brands, Inc. . . . .	9.38%	07/01/2025	2,879	3,568,138	0.0
LBM Acquisition LLC . . . . .	6.25%	01/15/2029	7,137	7,247,617	0.0
Murphy Oil USA, Inc. . . . .	5.63%	05/01/2027	1,441	1,520,725	0.0
Penske Automotive Group, Inc. . . . .	5.50%	05/15/2026	3,194	3,295,958	0.0
PetSmart, Inc. . . . .	7.13%	03/15/2023	64,970	65,079,619	0.3
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp. . . . .	4.75%	02/15/2028	6,641	6,873,328	0.0
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp. . . . .	7.75%	02/15/2029	28,041	30,076,468	0.1
Rite Aid Corp. . . . .	7.50%	07/01/2025	22,144	23,207,815	0.1
Rite Aid Corp. . . . .	8.00%	11/15/2026	20,400	21,486,295	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Sonic Automotive, Inc. ....	6.13%	03/15/2027	USD 16,446	\$ 17,086,500	0.1%
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp. ....	6.38%	09/30/2026	38,917	40,284,706	0.2
Staples, Inc. ....	7.50%	04/15/2026	17,327	17,365,501	0.1
Staples, Inc. ....	10.75%	04/15/2027	43,095	41,087,882	0.2
TPro Acquisition Corp. ....	11.00%	10/15/2024	12,276	13,435,078	0.1
White Cap Buyer LLC ....	6.88%	10/15/2028	31,658	33,729,556	0.2
White Cap Parent LLC(a) ....	8.25%	03/15/2026	7,186	7,428,987	0.0
William Carter Co. (The) ....	5.50%	05/15/2025	15,769	16,657,100	0.1
				<u>450,363,553</u>	<u>2.1</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Acadia Healthcare Co., Inc. ....	5.50%	07/01/2028	15,863	16,798,661	0.1
AdaptHealth LLC ....	6.13%	08/01/2028	5,430	5,764,705	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC ....	4.63%	01/15/2027	14,062	14,561,724	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC ....	4.88%	02/15/2030	4,984	5,145,131	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC ....	5.75%	03/15/2025	923	950,961	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC ....	7.50%	03/15/2026	5,667	6,204,138	0.0
Bausch Health Americas, Inc. ....	8.50%	01/31/2027	15,514	17,192,004	0.1
Bausch Health Americas, Inc. ....	9.25%	04/01/2026	5,000	5,543,537	0.0
Bausch Health Cos., Inc. ....	6.13%	04/15/2025	4,000	4,092,081	0.0
Bausch Health Cos., Inc. ....	6.25%	02/15/2029	8,519	9,070,910	0.1
Bausch Health Cos., Inc. ....	7.25%	05/30/2029	11,800	13,081,089	0.1
Bausch Health Cos., Inc. ....	9.00%	12/15/2025	6,654	7,251,293	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc. ....	6.75%	07/15/2025	11,430	12,249,823	0.1
Chobani LLC/Chobani Finance Corp., Inc. ....	7.50%	04/15/2025	2,000	2,082,316	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc. ....	5.63%	03/15/2027	7,408	7,803,699	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc. ....	6.00%	01/15/2029	5,082	5,420,960	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc. ....	6.63%	02/15/2025	6,930	7,282,751	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc. ....	6.88%	04/15/2029	35,534	36,473,026	0.2
CHS/Community Health Systems, Inc. ....	8.13%	06/30/2024	13,176	13,778,084	0.1
Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco, Inc. ....	6.00%	06/30/2028	19,381	17,012,570	0.1
Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco, Inc. ....	9.50%	07/31/2027	24,876	27,985,500	0.1
Envision Healthcare Corp. ....	8.75%	10/15/2026	23,719	16,959,431	0.1
Global Medical Response, Inc. ....	6.50%	10/01/2025	29,645	30,903,761	0.2
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc. ....	7.00%	12/31/2027	53,853	53,296,743	0.3
Legacy LifePoint Health LLC ....	6.75%	04/15/2025	1,667	1,769,006	0.0
Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC(c) .	5.50%	04/15/2025	3,859	2,088,891	0.0
Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC(c) .	5.63%	10/15/2023	5,298	2,796,663	0.0
MEDNAX, Inc. ....	6.25%	01/15/2027	493	520,737	0.0
ModivCare, Inc. ....	5.88%	11/15/2025	3,735	3,958,796	0.0
Par Pharmaceutical, Inc. ....	7.50%	04/01/2027	6,263	6,729,514	0.0
Post Holdings, Inc. ....	5.00%	08/15/2026	3,763	3,928,491	0.0
Post Holdings, Inc. ....	5.50%	12/15/2029	15,298	16,374,726	0.1
Post Holdings, Inc. ....	5.63%	01/15/2028	3,097	3,252,693	0.0
Radiology Partners, Inc. ....	9.25%	02/01/2028	36,585	39,950,125	0.2
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc./ LifePoint Health, Inc. ....	9.75%	12/01/2026	47,895	51,611,323	0.3
RP Escrow Issuer LLC ....	5.25%	12/15/2025	7,534	7,795,313	0.0
Spectrum Brands, Inc. ....	6.13%	12/15/2024	3,566	3,651,635	0.0
Tenet Healthcare Corp. ....	5.13%	05/01/2025	1,942	1,962,438	0.0
Tenet Healthcare Corp. ....	6.13%	10/01/2028	10,495	11,034,196	0.1
Tenet Healthcare Corp. ....	7.50%	04/01/2025	24,062	26,154,607	0.1
US Acute Care Solutions LLC ....	6.38%	03/01/2026	4,043	4,129,419	0.0
US Renal Care, Inc. ....	10.63%	07/15/2027	34,766	38,296,458	0.2
Vizient, Inc. ....	6.25%	05/15/2027	4,262	4,523,118	0.0
				<u>567,433,047</u>	<u>2.7</u>
<b>ENERGIE</b>					
AI Candelaria Spain SLU ....	7.50%	12/15/2028	8,400	9,575,903	0.0
Antero Resources Corp. ....	5.00%	03/01/2025	4,000	3,975,449	0.0
Antero Resources Corp. ....	7.63%	02/01/2029	2,980	3,175,885	0.0
Antero Resources Corp. ....	8.38%	07/15/2026	20,864	22,807,752	0.1
Apache Corp. ....	4.25%	01/15/2030	10,000	10,127,975	0.1
Apache Corp. ....	4.88%	11/15/2027	1,863	1,956,440	0.0
Berry Petroleum Co. LLC ....	7.00%	02/15/2026	18,888	18,169,413	0.1
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp. ....	6.63%	07/15/2026	5,384	5,507,385	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp. ....	7.63%	12/15/2025	9,386	10,095,055	0.1
Callon Petroleum, Co. ....	6.25%	04/15/2023	9,686	9,006,048	0.0
Callon Petroleum, Co. ....	8.25%	07/15/2025	6,693	5,794,299	0.0
Callon Petroleum, Co. ....	9.00%	04/01/2025	16,625	16,475,614	0.1
CITGO Petroleum Corp. ....	6.25%	08/15/2022	23,422	23,431,277	0.1
CITGO Petroleum Corp. ....	6.38%	06/15/2026	11,351	11,522,224	0.1



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
CITGO Petroleum Corp. ....	7.00%	06/15/2025	USD 37,747	\$ 38,826,913	0.2%
CNX Resources Corp. ....	6.00%	01/15/2029	15,392	16,118,521	0.1
CNX Resources Corp. ....	7.25%	03/14/2027	3,321	3,556,636	0.0
Comstock Resources, Inc. ....	6.75%	03/01/2029	13,500	13,962,796	0.1
Comstock Resources, Inc. ....	7.50%	05/15/2025	10,957	11,459,571	0.1
Comstock Resources, Inc. ....	9.75%	08/15/2026	25,279	27,599,406	0.1
Diamond Offshore Drilling, Inc.(c) .....	4.88%	11/01/2043	22,883	5,000,141	0.0
Diamond Offshore Drilling, Inc.(c) .....	5.70%	10/15/2039	10,562	2,639,559	0.0
Diamond Offshore Drilling, Inc.(c) .....	7.88%	08/15/2025	26,816	5,975,506	0.0
EnLink Midstream LLC .....	5.63%	01/15/2028	23,392	23,577,384	0.1
EnLink Midstream Partners LP .....	4.15%	06/01/2025	1,667	1,655,609	0.0
EnLink Midstream Partners LP .....	4.40%	04/01/2024	1,257	1,264,642	0.0
EnLink Midstream Partners LP .....	5.05%	04/01/2045	3,544	2,831,243	0.0
EnLink Midstream Partners LP .....	5.45%	06/01/2047	2,890	2,387,880	0.0
EnLink Midstream Partners LP .....	5.60%	04/01/2044	10,151	8,441,448	0.0
EQT Corp. ....	3.90%	10/01/2027	12,000	12,483,326	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.....	5.63%	06/15/2024	10,368	10,230,101	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.....	6.25%	05/15/2026	6,765	6,464,201	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.....	6.50%	10/01/2025	11,924	11,558,370	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.....	7.75%	02/01/2028	19,791	19,549,251	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.....	8.00%	01/15/2027	16,614	16,791,032	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.....	6.88%	01/15/2029	8,328	9,008,814	0.0
Global Partners LP/GLP Finance Corp.....	7.00%	08/01/2027	9,867	10,462,414	0.1
Gulfport Energy Corp.(c) .....	6.00%	10/15/2024	24,233	22,229,209	0.1
Gulfport Energy Corp.(c) .....	6.38%	05/15/2025	28,214	25,944,651	0.1
Gulfport Energy Corp.(c) .....	6.38%	01/15/2026	20,769	19,040,461	0.1
Gulfport Energy Corp.(c) .....	6.63%	05/01/2023	3,218	2,953,888	0.0
Hess Midstream Operations LP .....	5.63%	02/15/2026	10,815	11,195,964	0.1
HighPoint Operating Corp. ....	7.00%	10/15/2022	6,031	3,179,434	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co. ....	5.75%	02/01/2029	9,328	9,516,408	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co. ....	6.00%	02/01/2031	9,329	9,483,932	0.0
Indigo Natural Resources LLC .....	5.38%	02/01/2029	18,012	17,984,635	0.1
Ithaca Energy North Sea PLC .....	9.38%	07/15/2024	14,052	14,398,170	0.1
Moss Creek Resources Holdings, Inc. ....	7.50%	01/15/2026	41,319	34,279,540	0.2
Nabors Industries Ltd. ....	7.25%	01/15/2026	20,063	17,819,688	0.1
Nabors Industries Ltd. ....	7.50%	01/15/2028	14,854	12,821,092	0.1
Neptune Energy Bondco PLC .....	6.63%	05/15/2025	2,425	2,446,201	0.0
New Fortress Energy, Inc. ....	6.75%	09/15/2025	35,027	36,326,048	0.2
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp. ....	7.50%	02/01/2026	47,040	48,506,651	0.2
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp. ....	6.13%	03/01/2025	2,000	1,679,766	0.0
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp. ....	7.50%	11/01/2023	18,691	17,942,071	0.1
Occidental Petroleum Corp.....	2.70%	02/15/2023	16,135	15,770,661	0.1
Occidental Petroleum Corp.....	2.90%	08/15/2024	5,564	5,409,777	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	3.40%	04/15/2026	1,329	1,288,999	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	3.50%	06/15/2025	7,513	7,386,928	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	5.50%	12/01/2025	5,236	5,558,783	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	5.88%	09/01/2025	4,883	5,296,451	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	6.13%	01/01/2031	7,692	8,526,250	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	8.00%	07/15/2025	7,644	8,874,259	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	8.50%	07/15/2027	3,851	4,610,725	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	8.88%	07/15/2030	8,851	11,319,726	0.1
Parkland Corp./Canada .....	6.00%	04/01/2026	24,608	25,735,220	0.1
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.....	9.25%	05/15/2025	34,954	34,075,157	0.2
PDC Energy, Inc. ....	5.75%	05/15/2026	16,387	16,796,104	0.1
PDC Energy, Inc. ....	6.13%	09/15/2024	13,322	13,608,114	0.1
QEP Resources, Inc.....	5.25%	05/01/2023	19,937	21,133,644	0.1
QEP Resources, Inc.....	5.38%	10/01/2022	4,000	4,171,734	0.0
Range Resources Corp. ....	5.00%	03/15/2023	6,864	6,900,839	0.0
Range Resources Corp. ....	8.25%	01/15/2029	11,437	12,292,154	0.1
SM Energy Co.....	5.00%	01/15/2024	6,533	6,280,014	0.0
SM Energy Co.....	5.63%	06/01/2025	27,078	25,843,543	0.1
SM Energy Co.....	6.63%	01/15/2027	2,000	1,884,050	0.0
SM Energy Co.....	6.75%	09/15/2026	17,000	16,109,427	0.1
Southwestern Energy Co.....	8.38%	09/15/2028	9,087	10,044,816	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.....	5.88%	03/15/2028	26,261	27,865,584	0.1
Talos Production, Inc. ....	12.00%	01/15/2026	11,973	11,268,095	0.1
Transocean Phoenix 2 Ltd.....	7.75%	10/15/2024	12,486	12,380,367	0.1
Transocean, Inc.....	7.25%	11/01/2025	72	48,237	0.0
Transocean, Inc.....	7.50%	01/15/2026	27,681	18,185,098	0.1
Transocean, Inc.....	8.00%	02/01/2027	4,000	2,524,860	0.0
Transocean, Inc.....	11.50%	01/30/2027	5,345	4,410,117	0.0
Vine Oil & Gas LP/Vine Oil & Gas Finance Corp.....	8.75%	04/15/2023	67,435	67,402,595	0.3
Weatherford International Ltd.....	11.00%	12/01/2024	968	950,829	0.0
Western Midstream Operating LP .....	3.95%	06/01/2025	4,301	4,363,618	0.0
Western Midstream Operating LP .....	4.00%	07/01/2022	5,337	5,450,648	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Western Midstream Operating LP	4.35%	02/01/2025	USD 11,908	\$ 12,215,911	0.1%
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	13,423	13,880,921	0.1
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	3,831	4,020,236	0.0
Western Midstream Operating LP	5.30%	02/01/2030	9,371	10,156,741	0.1
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	3,469	3,702,540	0.0
				<u>1,188,957,064</u>	<u>5.7</u>
<b>SONSTIGE INDUSTRIEWERTE</b>					
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	5.88%	05/15/2026	1,667	1,723,431	0.0
Interface, Inc.	5.50%	12/01/2028	4,882	5,122,327	0.0
KAR Auction Services, Inc.	5.13%	06/01/2025	160	162,418	0.0
Laureate Education, Inc.	8.25%	05/01/2025	17,714	18,598,257	0.1
				<u>25,606,433</u>	<u>0.1</u>
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	19,051	20,158,463	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	9.75%	07/15/2027	35,694	39,381,416	0.2
Aptim Corp.	7.75%	06/15/2025	34,041	29,418,390	0.1
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	7,465	7,908,842	0.0
APX Group, Inc.	7.63%	09/01/2023	12,275	12,752,227	0.1
APX Group, Inc.	7.88%	12/01/2022	9,963	9,996,471	0.0
Aramark Services, Inc.	6.38%	05/01/2025	20,566	21,690,844	0.1
Carlson Travel, Inc.	6.75%	12/15/2025	17,815	16,249,269	0.1
Carriage Services, Inc.	6.63%	06/01/2026	15,492	16,347,392	0.1
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	16,622	17,476,395	0.1
eDreams ODIGEO SA	5.50%	09/01/2023	EUR 4,540	5,328,227	0.0
Garda World Security Corp.	9.50%	11/01/2027	USD 43,763	47,710,432	0.2
Korn Ferry	4.63%	12/15/2027	17,280	17,991,936	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	53,475	53,083,301	0.3
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.63%	10/01/2028	10,955	11,560,062	0.1
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.88%	10/01/2030	8,761	9,471,156	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024	1,458	1,558,496	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	39,716	41,213,014	0.2
Sabre GLBL, Inc.	7.38%	09/01/2025	17,465	18,885,275	0.1
Sabre GLBL, Inc.	9.25%	04/15/2025	12,443	14,814,794	0.1
TripAdvisor, Inc.	7.00%	07/15/2025	15,163	16,353,230	0.1
Verisure Midholding AB	5.25%	02/15/2029	EUR 21,242	26,336,098	0.1
Verscend Escrow Corp.	9.75%	08/15/2026	USD 57,645	61,903,320	0.3
				<u>517,589,050</u>	<u>2.5</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Austin BidCo, Inc.	7.13%	12/15/2028	4,558	4,695,408	0.0
Avaya, Inc.	6.13%	09/15/2028	43,942	47,287,957	0.2
Banff Merger Sub, Inc.	9.75%	09/01/2026	60,004	63,827,058	0.3
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025	14,476	15,647,788	0.1
Cablevision Lightpath LLC	5.63%	09/15/2028	16,278	16,557,522	0.1
CommScope Technologies LLC	6.00%	06/15/2025	1,443	1,470,097	0.0
CommScope, Inc.	5.50%	03/01/2024	493	506,799	0.0
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026	15,921	16,736,517	0.1
CommScope, Inc.	8.25%	03/01/2027	8,825	9,305,943	0.0
Dell International LLC/EMC Corp.	7.13%	06/15/2024	9,936	10,292,114	0.0
LogMeIn, Inc.	5.50%	09/01/2027	12,368	12,926,527	0.1
NCR Corp.	5.75%	09/01/2027	11,568	12,095,002	0.1
NCR Corp.	6.13%	09/01/2029	8,508	9,123,454	0.0
NCR Corp.	8.13%	04/15/2025	4,540	4,960,366	0.0
Presidio Holdings, Inc.	4.88%	02/01/2027	12,848	13,386,472	0.1
Presidio Holdings, Inc.	8.25%	02/01/2028	35,003	38,763,092	0.2
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028	2,038	2,132,165	0.0
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	24,862	25,835,138	0.1
Seagate HDD Cayman	4.88%	06/01/2027	11,014	12,252,556	0.1
Solera LLC/Solera Finance, Inc.	10.50%	03/01/2024	61,592	64,124,515	0.3
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	09/01/2025	68,083	70,472,319	0.3
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	10.50%	02/01/2024	12,670	12,783,323	0.1
				<u>465,182,132</u>	<u>2.2</u>
<b>TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN</b>					
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ Hawaiian Miles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	11,097	11,700,597	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	34,164	38,487,866	0.1
				<u>50,188,463</u>	<u>0.2</u>
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
AerCap Global Aviation Trust	6.50%	06/15/2045	2,000	2,089,980	0.0
Algeco Global Finance PLC	8.00%	02/15/2023	39,923	40,722,635	0.2
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.25%	03/15/2025	4,556	4,583,629	0.0
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	13,633	13,904,625	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	32,463	33,545,461	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	10.50%	05/15/2025	11,000	13,169,159	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Herc Holdings, Inc. ....	5.50%	07/15/2027	USD 17,323	\$ 18,279,047	0.1%
XPO Logistics, Inc. ....	6.75%	08/15/2024	23,103	24,398,710	0.1
				150,693,246	0.7
				7,121,577,511	34.0
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Alliance Data Systems Corp. ....	4.75%	12/15/2024	24,532	25,135,730	0.1
Alliance Data Systems Corp. ....	7.00%	01/15/2026	11,510	12,171,825	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(d) ....	5.88%	05/24/2022	EUR 16,000	19,822,419	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(d) ....	6.50%	03/05/2025	USD 41,600	44,925,990	0.2
Banco Santander SA(d) ....	6.75%	04/25/2022	EUR 39,400	49,754,375	0.2
Bank of Ireland ....	10.00%	12/19/2022	15,000	21,158,702	0.1
Bankinter SA(d) ....	8.63%	05/10/2021	19,600	23,950,750	0.1
CaixaBank SA(d) ....	5.88%	10/09/2027	200	265,271	0.0
Citizens Financial Group, Inc., Series B(d) ....	6.00%	07/06/2023	USD 8,895	9,174,701	0.0
Credit Suisse Group AG(d) ....	6.25%	12/18/2024	31,464	34,610,400	0.2
Credit Suisse Group AG(d) ....	7.50%	07/17/2023	35,155	38,294,103	0.2
Credit Suisse Group AG(d) ....	7.50%	12/11/2023	10,650	11,809,497	0.1
Dresdner Funding Trust I ....	8.15%	06/30/2031	5,173	7,412,401	0.0
Intesa Sanpaolo SpA ....	5.02%	06/26/2024	206	224,082	0.0
Intesa Sanpaolo SpA ....	5.71%	01/15/2026	11,463	12,866,066	0.1
Societe Generale SA(d) ....	8.00%	09/29/2025	44,504	52,234,748	0.3
UniCredit SpA(d) ....	9.25%	06/03/2022	EUR 21,339	27,683,999	0.1
				391,495,059	1.9
<b>MAKLER</b>					
LPL Holdings, Inc. ....	5.75%	09/15/2025	USD 31,178	32,099,234	0.2
NFP Corp. ....	6.88%	08/15/2028	56,445	58,257,373	0.3
NFP Corp. ....	7.00%	05/15/2025	8,975	9,629,352	0.0
				99,985,959	0.5
<b>FINANZEN</b>					
CNG Holdings, Inc. ....	12.50%	06/15/2024	17,033	15,994,053	0.1
Curo Group Holdings Corp. ....	8.25%	09/01/2025	42,770	43,201,834	0.2
Enova International, Inc. ....	8.50%	09/01/2024	6,350	6,474,481	0.0
Enova International, Inc. ....	8.50%	09/15/2025	32,666	33,473,150	0.2
goeasy Ltd. ....	5.38%	12/01/2024	16,674	17,276,900	0.1
ILFC E-Capital Trust I(e) ....	3.23%	12/21/2065	9,500	7,722,810	0.0
Navient Corp. ....	6.50%	06/15/2022	6,777	7,032,259	0.0
Navient Corp. ....	7.25%	09/25/2023	304	329,965	0.0
OneMain Finance Corp. ....	6.88%	03/15/2025	6,000	6,763,953	0.0
SLM Corp. ....	5.13%	04/05/2022	10,162	10,421,942	0.1
Springleaf Finance Corp. ....	7.13%	03/15/2026	5,000	5,778,645	0.0
TMX Finance LLC/TitleMax Finance Corp. ....	11.13%	04/01/2023	22,117	22,369,444	0.1
				176,839,436	0.8
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc. ....	7.00%	11/15/2025	44,139	45,493,740	0.2
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc. ....	10.13%	08/01/2026	21,929	25,260,138	0.1
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer. ....	6.75%	10/15/2027	56,684	58,631,304	0.3
Ardonagh Midco 2 PLC(a) ....	11.50%	01/15/2027	32,646	35,014,554	0.2
AssuredPartners, Inc. ....	5.63%	01/15/2029	39,614	39,925,444	0.2
Genworth Holdings, Inc. ....	7.63%	09/24/2021	8,980	8,965,242	0.1
HUB International Ltd. ....	7.00%	05/01/2026	6,220	6,480,822	0.0
USI, Inc./NY ....	6.88%	05/01/2025	2,000	2,042,829	0.0
				221,814,073	1.1
<b>SONSTIGE FINANZWERTE</b>					
Altice France Holding SA ....	10.50%	05/15/2027	16,348	18,345,296	0.1
Intrum AB ....	3.50%	07/15/2026	EUR 16,915	20,317,582	0.1
Intrum AB ....	4.88%	08/15/2025	10,509	13,165,240	0.1
Tempo Acquisition LLC/Tempo Acquisition Finance Corp. ....	6.75%	06/01/2025	USD 40,729	41,776,988	0.1
				93,605,106	0.4
<b>REITS</b>					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL ....	5.75%	05/15/2026	53,564	55,126,216	0.3
Diversified Healthcare Trust ....	9.75%	06/15/2025	20,996	23,631,706	0.1
GEO Group, Inc. (The) ....	6.00%	04/15/2026	1,976	1,447,879	0.0
Iron Mountain UK PLC ....	3.88%	11/15/2025	GBP 1,000	1,409,594	0.0
Iron Mountain, Inc. ....	4.88%	09/15/2027	USD 1,028	1,070,844	0.0
Iron Mountain, Inc. ....	4.88%	09/15/2029	11,788	12,029,779	0.1
Iron Mountain, Inc. ....	5.00%	07/15/2028	10,641	11,030,413	0.1
Iron Mountain, Inc. ....	5.25%	03/15/2028	4,653	4,862,836	0.0
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc. ....	4.63%	06/15/2025	4,985	5,283,016	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc. ....	5.63%	05/01/2024	USD 3,667	\$ 3,960,006	0.0%
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc. ....	5.75%	02/01/2027	2,493	2,816,717	0.0
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp. ....	5.75%	01/15/2029	7,241	7,276,034	0.0
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp. ....	9.38%	04/01/2027	48,969	53,856,940	0.3
				<u>183,801,980</u>	<u>0.9</u>
				<u>1,167,541,613</u>	<u>5.6</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Calpine Corp. ....	5.13%	03/15/2028	19,753	19,922,443	0.1
Calpine Corp. ....	5.25%	06/01/2026	1,341	1,379,267	0.0
NRG Energy, Inc. ....	6.63%	01/15/2027	1,104	1,148,153	0.0
NRG Energy, Inc. ....	7.25%	05/15/2026	1,941	2,018,197	0.0
Talen Energy Supply LLC ....	6.50%	06/01/2025	26,817	23,524,859	0.1
Talen Energy Supply LLC ....	7.25%	05/15/2027	6,399	6,759,615	0.0
Talen Energy Supply LLC ....	10.50%	01/15/2026	40,310	38,569,900	0.2
				<u>93,322,434</u>	<u>0.4</u>
<b>QUASI-STAAITSANLEIHEN</b>					
<b>ENERGIE</b>					
Citgo Holding, Inc. ....	9.25%	08/01/2024	31,077	30,586,814	0.2
<b>WANDELANLEIHEN</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
DISH Network Corp.(b). ....	3.38%	08/15/2026	6,494	6,095,607	0.0
				<u>8,419,123,979</u>	<u>40.2</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG</b>					
<b>STAATSANLEIHEN</b>					
<b>ANGOLA</b>					
Angolan Government International Bond ....	8.00%	11/26/2029	61,420	59,750,144	0.3
Angolan Government International Bond ....	8.25%	05/09/2028	28,770	28,644,131	0.1
Angolan Government International Bond ....	9.13%	11/26/2049	56,178	54,036,214	0.3
Angolan Government International Bond ....	9.38%	05/08/2048	10,509	10,321,808	0.0
				<u>152,752,297</u>	<u>0.7</u>
<b>ARGENTINIEN</b>					
Argentine Republic Government International Bond ....	0.13%	07/09/2030	108,293	39,391,573	0.2
Argentine Republic Government International Bond ....	0.13%	07/09/2035	285,291	91,293,215	0.4
Argentine Republic Government International Bond ....	0.13%	01/09/2038	24,411	9,093,021	0.1
Argentine Republic Government International Bond ....	0.13%	07/09/2041	30,585	10,494,448	0.1
Argentine Republic Government International Bond ....	1.00%	07/09/2029	20,068	7,939,212	0.0
				<u>158,211,469</u>	<u>0.8</u>
<b>COSTA RICA</b>					
Costa Rica Government International Bond ....	4.38%	04/30/2025	14,765	14,303,594	0.1
Costa Rica Government International Bond ....	6.13%	02/19/2031	57,181	57,574,119	0.2
Costa Rica Government International Bond ....	7.00%	04/04/2044	12,166	11,839,039	0.1
Costa Rica Government International Bond ....	7.16%	03/12/2045	12,971	12,727,794	0.1
				<u>96,444,546</u>	<u>0.5</u>
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>					
Dominican Republic International Bond ....	5.50%	01/27/2025	3,775	4,133,625	0.0
Dominican Republic International Bond ....	5.88%	01/30/2060	14,092	13,638,414	0.1
Dominican Republic International Bond ....	5.95%	01/25/2027	27,913	31,192,777	0.2
Dominican Republic International Bond ....	6.00%	07/19/2028	63,400	71,463,687	0.3
Dominican Republic International Bond ....	6.40%	06/05/2049	6,674	7,047,327	0.0
Dominican Republic International Bond ....	6.50%	02/15/2048	7,709	8,207,676	0.0
Dominican Republic International Bond ....	6.88%	01/29/2026	9,441	10,998,765	0.1
Dominican Republic International Bond ....	7.45%	04/30/2044	17,877	21,240,111	0.1
Dominican Republic International Bond ....	8.63%	04/20/2027	16,359	19,799,502	0.1
				<u>187,721,884</u>	<u>0.9</u>
<b>ECUADOR</b>					
Ecuador Government International Bond ....	0.00%	07/31/2030	5,863	2,432,990	0.0
Ecuador Government International Bond ....	0.50%	07/31/2030	27,255	16,012,168	0.1
Ecuador Government International Bond ....	0.50%	07/31/2035	52,344	23,816,428	0.1
Ecuador Government International Bond ....	0.50%	07/31/2040	16,709	7,017,588	0.0
				<u>49,279,174</u>	<u>0.2</u>
<b>ÄGYPTEN</b>					
Egypt Government International Bond ....	3.88%	02/16/2026	5,392	5,270,680	0.0
Egypt Government International Bond ....	5.88%	02/16/2031	3,822	3,678,675	0.0
Egypt Government International Bond ....	6.13%	01/31/2022	5,880	6,032,513	0.0
Egypt Government International Bond ....	6.20%	03/01/2024	28,900	30,886,875	0.2



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	USD 7,360	\$ 7,808,500	0.0%
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	15,058	16,954,367	0.1
Egypt Government International Bond	7.60%	03/01/2029	16,788	18,456,307	0.1
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	43,364	46,182,660	0.2
Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047	7,580	7,854,775	0.1
Egypt Government International Bond	8.70%	03/01/2049	10,320	10,848,900	0.1
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	22,855	24,297,722	0.1
				<u>178,271,974</u>	<u>0.9</u>
<b>EL SALVADOR</b>					
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	16,049	15,587,591	0.1
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	8,560	8,356,700	0.0
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	41,430	38,322,750	0.2
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	3,431	3,379,535	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	20,546	21,265,110	0.1
				<u>86,911,686</u>	<u>0.4</u>
<b>GABUN</b>					
Gabon Government International Bond	6.38%	12/12/2024	10,308	10,636,108	0.1
Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031	28,288	27,695,720	0.1
Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025	49,010	51,337,975	0.2
				<u>89,669,803</u>	<u>0.4</u>
<b>GHANA</b>					
Ghana Government International Bond	7.63%	05/16/2029	17,955	18,740,531	0.1
Ghana Government International Bond	8.13%	01/18/2026	10,000	11,284,375	0.1
Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032	31,733	32,327,994	0.1
Ghana Government International Bond	8.63%	06/16/2049	25,866	25,025,355	0.1
Ghana Government International Bond	8.95%	03/26/2051	6,050	5,911,984	0.0
Ghana Government International Bond	10.75%	10/14/2030	11,717	15,294,347	0.1
				<u>108,584,586</u>	<u>0.5</u>
<b>GUATEMALA</b>					
Guatemala Government Bond	5.38%	04/24/2032	2,959	3,450,934	0.0
Guatemala Government Bond	6.13%	06/01/2050	4,151	5,008,441	0.0
				<u>8,459,375</u>	<u>0.0</u>
<b>HONDURAS</b>					
Honduras Government International Bond	5.63%	06/24/2030	4,772	5,231,305	0.0
Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027	36,976	41,343,790	0.2
Honduras Government International Bond	7.50%	03/15/2024	13,637	14,855,807	0.1
				<u>61,430,902</u>	<u>0.3</u>
<b>IRAK</b>					
Iraq International Bond	5.80%	01/15/2028	23,780	22,018,678	0.1
<b>ELFENBEINKÜSTE</b>					
Ivory Coast Government International Bond	4.88%	01/30/2032	EUR 43,563	52,560,937	0.3
Ivory Coast Government International Bond	5.13%	06/15/2025	3,272	4,403,066	0.0
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	USD 6,219	6,675,708	0.0
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	44,268	49,206,648	0.3
Ivory Coast Government International Bond	6.88%	10/17/2040	EUR 39,053	51,198,169	0.2
				<u>164,044,528</u>	<u>0.8</u>
<b>JAMAICA</b>					
Jamaica Government International Bond	6.75%	04/28/2028	USD 4,743	5,547,828	0.0
<b>KENIA</b>					
Kenya Government International Bond	6.88%	06/24/2024	73,690	81,634,703	0.3
Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	16,016	17,692,675	0.1
Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	9,643	10,658,529	0.1
				<u>109,985,907</u>	<u>0.5</u>
<b>LIBANON</b>					
Lebanon Government International Bond(c)	6.65%	04/22/2024	4,315	555,556	0.0
Lebanon Government International Bond(c)	6.85%	03/23/2027	5,606	716,307	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G(c)	1.00%	11/27/2026	10,759	1,385,221	0.0
				<u>2,657,084</u>	<u>0.0</u>
<b>MEXIKO</b>					
Mexico Government International Bond	4.75%	04/27/2032	10,750	12,053,437	0.1
<b>MONGOLEI</b>					
Mongolia Government International Bond	5.13%	12/05/2022	22,941	23,815,626	0.1
Mongolia Government International Bond	10.88%	04/06/2021	16,720	16,850,625	0.1
				<u>40,666,251</u>	<u>0.2</u>
<b>NAMIBIA</b>					
Namibia International Bonds	5.25%	10/29/2025	8,550	9,030,937	0.1
<b>NIGERIA</b>					
Nigeria Government International Bond	5.63%	06/27/2022	4,260	4,431,731	0.0
Nigeria Government International Bond	6.38%	07/12/2023	8,691	9,410,724	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Nigeria Government International Bond . . . . .	6.50%	11/28/2027	USD 4,404	\$ 4,706,775	0.0%
Nigeria Government International Bond . . . . .	7.14%	02/23/2030	39,437	41,741,600	0.2
Nigeria Government International Bond . . . . .	7.63%	11/21/2025	31,750	36,363,672	0.2
Nigeria Government International Bond . . . . .	7.63%	11/28/2047	15,679	15,963,182	0.1
Nigeria Government International Bond . . . . .	7.70%	02/23/2038	14,105	14,448,809	0.1
Nigeria Government International Bond . . . . .	7.88%	02/16/2032	29,112	31,331,790	0.2
				<u>158,398,283</u>	<u>0.8</u>
<b>PAKISTAN</b>					
Pakistan Government International Bond . . . . .	6.88%	12/05/2027	918	977,670	0.0
<b>SÜDAFRIKA</b>					
Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	4.30%	10/12/2028	21,899	21,632,106	0.1
Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	5.65%	09/27/2047	8,663	7,967,253	0.0
Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	5.75%	09/30/2049	134,846	123,721,205	0.6
Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	5.88%	06/22/2030	17,500	18,790,625	0.1
Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	6.30%	06/22/2048	1,684	1,648,215	0.0
				<u>173,759,404</u>	<u>0.8</u>
<b>SRI LANKA</b>					
Sri Lanka Government International Bond . . . . .	6.20%	05/11/2027	12,953	7,407,497	0.0
<b>UKRAINE</b>					
Ukraine Government International Bond . . . . .	7.25%	03/15/2033	7,766	7,882,490	0.0
Ukraine Government International Bond . . . . .	7.38%	09/25/2032	22,357	22,992,777	0.1
Ukraine Government International Bond . . . . .	7.75%	09/01/2023	76,080	81,976,200	0.3
Ukraine Government International Bond . . . . .	7.75%	09/01/2024	38,721	41,806,580	0.2
Ukraine Government International Bond . . . . .	7.75%	09/01/2025	10,000	10,835,000	0.1
Ukraine Government International Bond . . . . .	7.75%	09/01/2027	13,037	14,088,108	0.1
Ukraine Government International Bond . . . . .	9.75%	11/01/2028	9,111	10,739,591	0.1
				<u>190,320,746</u>	<u>0.9</u>
<b>VENEZUELA</b>					
Venezuela Government International Bond(c) . . . . .	9.00%	05/07/2023	4,270	405,650	0.0
Venezuela Government International Bond(c) . . . . .	9.25%	09/15/2027	57,269	5,440,555	0.0
				<u>5,846,205</u>	<u>0.0</u>
				<u>2,080,452,151</u>	<u>9.9</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Braskem America Finance Co. . . . .	7.13%	07/22/2041	22,062	24,979,700	0.1
Braskem Idesa SAPI . . . . .	7.45%	11/15/2029	399	398,062	0.0
Braskem Netherlands Finance BV . . . . .	4.50%	01/10/2028	10,931	11,319,616	0.1
Braskem Netherlands Finance BV . . . . .	4.50%	01/31/2030	32,575	33,070,140	0.2
CSN Inova Ventures . . . . .	6.75%	01/28/2028	5,245	5,664,600	0.0
CSN Resources SA . . . . .	7.63%	02/13/2023	26,175	27,107,484	0.2
CSN Resources SA . . . . .	7.63%	04/17/2026	33,346	35,940,319	0.1
Eldorado Gold Corp. . . . .	9.50%	06/01/2024	19,494	21,727,146	0.1
First Quantum Minerals Ltd. . . . .	6.88%	10/15/2027	33,725	36,576,792	0.1
First Quantum Minerals Ltd. . . . .	7.25%	04/01/2023	21,596	22,061,664	0.1
First Quantum Minerals Ltd. . . . .	7.50%	04/01/2025	10,621	10,992,735	0.1
HTA Group Ltd./Mauritius . . . . .	7.00%	12/18/2025	14,504	15,460,358	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd. . . . .	8.25%	10/22/2025	35,078	37,489,612	0.2
Nexa Resources SA . . . . .	6.50%	01/18/2028	21,777	25,478,902	0.1
OCP SA . . . . .	5.63%	04/25/2024	10,755	11,810,334	0.1
Stillwater Mining Co. . . . .	7.13%	06/27/2025	20,000	21,016,827	0.1
Suzano Austria GmbH . . . . .	7.00%	03/16/2047	11,134	14,568,839	0.1
Vale Overseas Ltd. . . . .	3.75%	07/08/2030	3,970	4,231,885	0.0
Vedanta Resources Finance II PLC . . . . .	13.88%	01/21/2024	40,014	44,321,280	0.2
Volcan Cia Minera SAA. . . . .	4.38%	02/11/2026	4,778	4,903,423	0.0
				<u>409,119,718</u>	<u>2.0</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Cemex SAB de CV . . . . .	7.38%	06/05/2027	10,634	11,932,943	0.1
Embraer Netherlands Finance BV . . . . .	5.40%	02/01/2027	26,390	27,594,967	0.1
Embraer Netherlands Finance BV . . . . .	6.95%	01/17/2028	23,369	26,175,621	0.1
				<u>65,703,531</u>	<u>0.3</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
VTR Finance NV . . . . .	6.38%	07/15/2028	4,248	4,633,424	0.0
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Digicel Holdings Bermuda Ltd./Digicel International Finance Ltd. . . . .	8.75%	05/25/2024	4,359	4,564,690	0.0
MTN Mauritius Investments Ltd. . . . .	6.50%	10/13/2026	3,770	4,344,925	0.0
Sable International Finance Ltd. . . . .	5.75%	09/07/2027	15,802	16,682,502	0.1
VTR Comunicaciones SpA . . . . .	5.13%	01/15/2028	7,240	7,746,800	0.1
				<u>33,338,917</u>	<u>0.2</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
BRF GmbH . . . . .	4.35%	09/29/2026	6,109	6,378,363	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
BRF SA .....	5.75%	09/21/2050	USD 5,556	\$ 5,671,565	0.0%
Cosan Ltd. ....	5.50%	09/20/2029	13,818	14,789,578	0.1
Minerva Luxembourg SA. ....	6.50%	09/20/2026	8,672	9,073,080	0.1
Ulker Biskuvi Sanayi AS .....	6.95%	10/30/2025	5,581	6,060,617	0.0
				<u>41,973,203</u>	<u>0.2</u>
<b>ENERGIE</b>					
Ecopetrol SA .....	5.88%	05/28/2045	1,692	1,818,189	0.0
Ecopetrol SA .....	6.88%	04/29/2030	23,645	28,809,068	0.1
Geopark Ltd. ....	5.50%	01/17/2027	4,658	4,748,249	0.0
Gran Tierra Energy, Inc. ....	7.75%	05/23/2027	9,261	7,623,182	0.0
HPCL-Mittal Energy Ltd. ....	5.45%	10/22/2026	3,062	3,203,618	0.0
Medco Platinum Road Pte Ltd. ....	6.75%	01/30/2025	15,289	16,000,894	0.1
MV24 Capital BV .....	6.75%	06/01/2034	11,532	12,544,352	0.1
Oleoducto Central SA .....	4.00%	07/14/2027	3,463	3,714,067	0.0
Peru LNG Srl .....	5.38%	03/22/2030	12,409	11,598,537	0.1
Petrobras Global Finance BV .....	5.09%	01/15/2030	8,023	8,478,156	0.0
Petrobras Global Finance BV .....	5.60%	01/03/2031	56,775	61,241,589	0.3
Petrobras Global Finance BV .....	7.38%	01/17/2027	25,478	31,078,676	0.2
Petrobras Global Finance BV .....	8.75%	05/23/2026	8,373	10,767,155	0.1
Raizen Fuels Finance SA .....	5.30%	01/20/2027	7,683	8,636,416	0.0
				<u>210,262,148</u>	<u>1.0</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Baidu, Inc. ....	3.43%	04/07/2030	304	326,015	0.0
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA .....	6.75%	03/30/2029	10,660	10,953,150	0.1
Rumo Luxembourg SARL .....	7.38%	02/09/2024	9,226	9,557,560	0.0
				<u>20,510,710</u>	<u>0.1</u>
				<u>785,867,666</u>	<u>3.8</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE</b>					
<b>SENEGAL</b>					
Senegal Government International Bond .....	6.25%	05/23/2033	53,439	56,678,739	0.3
Senegal Government International Bond .....	6.75%	03/13/2048	30,851	31,458,379	0.1
Senegal Government International Bond .....	8.75%	05/13/2021	1,914	1,933,738	0.0
				<u>90,070,856</u>	<u>0.4</u>
<b>VERSORGENSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
AES El Salvador Trust II .....	6.75%	03/28/2023	5,470	5,198,209	0.0
AES Gener SA .....	6.35%	10/07/2079	10,186	10,899,020	0.1
Cemig Geracao e Transmissao SA. ....	9.25%	12/05/2024	31,570	36,344,962	0.1
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA .....	7.25%	05/03/2023	14,626	15,170,819	0.1
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. ....	6.75%	04/24/2033	13,152	14,742,010	0.1
				<u>82,355,020</u>	<u>0.4</u>
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand .....	5.38%	04/17/2025	16,733	18,959,326	0.1
Fidelity Bank PLC .....	10.50%	10/16/2022	11,480	12,333,825	0.1
				<u>31,293,151</u>	<u>0.2</u>
<b>SONSTIGE FINANZWERTE</b>					
OEC Finance Ltd.(a) .....	6.56%	10/25/2029	3,013	598,614	0.0
OEC Finance Ltd.(a) .....	7.87%	12/27/2033	3,360	670,260	0.0
OEC Finance Ltd.(a) .....	10.68%	12/26/2046	31,074	6,615,504	0.0
				<u>7,884,378</u>	<u>0.0</u>
<b>REITS</b>					
Trust Fibra Uno .....	4.87%	01/15/2030	27,786	30,008,880	0.2
Trust Fibra Uno .....	6.39%	01/15/2050	726	817,657	0.0
Trust Fibra Uno .....	6.95%	01/30/2044	3,173	3,778,845	0.0
				<u>34,605,382</u>	<u>0.2</u>
				<u>73,782,911</u>	<u>0.4</u>
<b>QUASI-STAATSANLEIHEN</b>					
<b>BRASILIEN</b>					
GUSAP III LP .....	4.25%	01/21/2030	7,373	7,965,891	0.0
				<u>3,120,494,495</u>	<u>14.9</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Ally Financial, Inc. ....	8.00%	11/01/2031	29,736	42,185,564	0.2
Bank of America Corp., Series AA(d) .....	6.10%	03/17/2025	14,150	15,581,697	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Bank of America Corp., Series B	8.05%	06/15/2027	USD 32,004	\$ 41,985,161	0.2%
Bank of America Corp., Series DD(d)	6.30%	03/10/2026	29,824	34,224,631	0.2
Bank of America Corp., Series X(d)	6.25%	09/05/2024	7,260	7,955,095	0.0
Bank of America Corp., Series Z(d)	6.50%	10/23/2024	808	898,354	0.0
Barclays Bank PLC(d)	6.86%	06/15/2032	1,667	2,329,182	0.0
Barclays Bank PLC	10.18%	06/12/2021	17,904	18,363,957	0.1
Barclays PLC(d)	7.13%	06/15/2025	GBP 13,922	21,580,521	0.1
Barclays PLC(d)	7.25%	03/15/2023	5,167	7,656,186	0.0
BNP Paribas SA(d)	6.75%	03/14/2022	USD 15,725	16,285,000	0.1
BNP Paribas SA(d)	7.63%	03/30/2021	30,255	30,333,902	0.1
CIT Group, Inc.	3.93%	06/19/2024	6,749	7,143,650	0.0
Citigroup, Inc.(d)	3.88%	02/18/2026	8,826	8,785,684	0.1
Citigroup, Inc.(d)	5.95%	01/30/2023	33,515	34,768,058	0.2
Citigroup, Inc., Series T(d)	6.25%	08/15/2026	5,672	6,475,089	0.0
Citigroup, Inc., Series V(d)	4.70%	01/30/2025	8,408	8,511,234	0.0
Citigroup, Inc., Series W(d)	4.00%	12/10/2025	7,221	7,241,682	0.0
Commerzbank AG	8.13%	09/19/2023	1,629	1,879,629	0.0
Credit Agricole SA(d)	6.50%	06/23/2021	EUR 815	998,742	0.0
Credit Agricole SA(d)	8.13%	12/23/2025	USD 35,763	43,432,204	0.2
Credit Suisse AG	6.50%	08/08/2023	9,231	10,323,397	0.1
DNB Bank ASA(d)	6.50%	03/26/2022	48,000	49,924,487	0.2
Erste Group Bank AG(d)	6.50%	04/15/2024	EUR 10,600	14,113,274	0.1
Erste Group Bank AG(d)	8.88%	10/15/2021	12,800	16,145,316	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(d)	5.30%	11/10/2026	USD 3,702	4,091,945	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(d)	5.00%	11/10/2022	32,640	32,652,485	0.2
HSBC Holdings PLC(d)	6.00%	09/29/2023	EUR 6,504	8,526,037	0.1
HSBC Holdings PLC(d)	6.38%	03/30/2025	USD 5,220	5,719,059	0.0
HSBC Holdings PLC(d)	6.88%	06/01/2021	18,120	18,376,819	0.1
HSBC Holdings PLC, Series E(d)	4.75%	07/04/2029	EUR 9,250	12,363,823	0.1
ING Groep NV(d)	6.50%	04/16/2025	USD 24,907	27,629,232	0.1
ING Groep NV(d)	6.75%	04/16/2024	5,795	6,349,430	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series R(d)	6.00%	08/01/2023	15,000	15,710,640	0.1
Lloyds Banking Group PLC(d)	6.41%	10/01/2035	1,976	2,465,761	0.0
Lloyds Banking Group PLC(d)	6.66%	05/21/2037	1,067	1,361,683	0.0
Lloyds Banking Group PLC(d)	7.50%	06/27/2024	6,268	6,987,928	0.0
Natwest Group PLC(d)	8.63%	08/15/2021	80,653	83,109,118	0.4
Natwest Group PLC, Series U(d) (f)	2.57%	09/30/2027	15,100	14,941,529	0.1
Regions Bank/Birmingham AL	6.45%	06/26/2037	28,048	38,248,814	0.2
Skandinaviska Enskilda Banken AB(d)	5.63%	05/13/2022	4,000	4,118,483	0.0
Standard Chartered PLC(d) (f)	1.72%	01/30/2027	16,000	14,970,864	0.1
Standard Chartered PLC(d)	7.50%	04/02/2022	45,824	48,021,676	0.2
Standard Chartered PLC(d)	7.75%	04/02/2023	13,945	15,152,509	0.1
Swedbank AB(d)	6.00%	03/17/2022	5,800	5,987,313	0.0
UBS AG/Stamford CT	7.63%	08/17/2022	3,729	4,091,619	0.0
UBS Group AG(d)	7.00%	01/31/2024	49,607	54,269,672	0.3
UBS Group AG(d)	7.00%	02/19/2025	32,133	36,699,071	0.2
				<u>910,967,206</u>	<u>4.4</u>
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The), Series G(d)	5.38%	06/01/2025	26,176	28,837,202	0.2
FINANZEN					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	2.88%	08/14/2024	1,003	1,043,517	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/23/2023	150	155,895	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.88%	01/23/2028	6,850	7,297,397	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	6.50%	07/15/2025	3,386	3,962,301	0.0
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	5,211	5,006,033	0.0
Aircastle Ltd.	4.13%	05/01/2024	2,665	2,806,618	0.0
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	648	685,875	0.0
Aircastle Ltd.	5.00%	04/01/2023	551	589,135	0.0
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	42,255	46,157,933	0.2
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	1,558	1,527,694	0.0
Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022	8,645	8,785,172	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	5,788	6,004,696	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023	15,306	16,070,626	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	7,715	8,250,228	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	12,125	13,004,297	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	5,387	5,925,254	0.0
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	15,749	17,737,137	0.1
				<u>145,009,808</u>	<u>0.7</u>
VERSICHERUNGEN					
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	39,949	52,346,122	0.3
American International Group, Inc.	6.82%	11/15/2037	15,085	20,846,449	0.1
Aon Corp.	8.21%	01/01/2027	13,915	18,467,283	0.1
Centene Corp.	5.38%	06/01/2026	1,667	1,744,448	0.0
Centene Corp.	5.38%	08/15/2026	493	519,057	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(f) . . .	2.32%	02/12/2047	USD 10,000	\$ 9,430,530	0.0%
Liberty Mutual Group, Inc. . . . .	3.63%	05/23/2059	EUR 1,111	1,367,286	0.0
Liberty Mutual Group, Inc. . . . .	7.80%	03/15/2037	USD 36,487	46,724,995	0.2
MetLife Capital Trust IV . . . . .	7.88%	12/15/2037	7,000	9,826,250	0.1
MetLife, Inc. . . . .	10.75%	08/01/2039	16,185	27,328,325	0.1
Nationwide Financial Services, Inc. . . . .	6.75%	05/15/2037	3,000	3,615,396	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.(f) . . . . .	2.51%	12/15/2024	5,000	4,989,378	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co. . . . .	9.38%	08/15/2039	22,662	38,233,729	0.2
Transatlantic Holdings, Inc. . . . .	8.00%	11/30/2039	14,148	21,711,210	0.1
				<u>257,150,458</u>	<u>1.2</u>
<b>SONSTIGE FINANZWERTE</b>					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust . . . . .	4.45%	04/03/2026	1,974	2,155,457	0.0
<b>REITS</b>					
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp. . . . .	4.63%	08/01/2029	5,685	6,114,936	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp. . . . .	5.00%	10/15/2027	1,644	1,746,080	0.0
				<u>7,861,016</u>	<u>0.0</u>
				<u>1,351,981,147</u>	<u>6.5</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
ArcelorMittal SA . . . . .	7.00%	03/01/2041	14,928	21,158,150	0.1
ArcelorMittal SA . . . . .	7.25%	10/15/2039	9,517	13,728,355	0.1
Arconic Corp. . . . .	6.00%	05/15/2025	20,000	21,368,604	0.1
Glencore Finance Canada Ltd. . . . .	6.00%	11/15/2041	4,277	5,395,998	0.0
MEGlobal Canada ULC. . . . .	5.88%	05/18/2030	2,186	2,655,959	0.0
Smurfit Kappa Treasury Funding DAC . . . . .	7.50%	11/20/2025	4,264	5,243,618	0.0
				<u>69,550,684</u>	<u>0.3</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
General Electric Co., Series D(d) (f) . . . . .	3.52%	06/15/2021	30,828	29,231,252	0.1
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Qwest Corp. . . . .	6.75%	12/01/2021	15,325	15,901,530	0.1
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
General Motors Co. . . . .	4.88%	10/02/2023	6,843	7,530,451	0.1
General Motors Co. . . . .	6.13%	10/01/2025	2,562	3,045,832	0.0
General Motors Co. . . . .	6.25%	10/02/2043	2,398	3,193,339	0.0
General Motors Co. . . . .	6.80%	10/01/2027	3,641	4,597,020	0.0
General Motors Financial Co., Inc. . . . .	3.25%	01/05/2023	1,430	1,494,326	0.0
General Motors Financial Co., Inc. . . . .	3.70%	05/09/2023	1,722	1,822,466	0.0
General Motors Financial Co., Inc. . . . .	4.00%	10/06/2026	1,162	1,286,458	0.0
General Motors Financial Co., Inc. . . . .	4.25%	05/15/2023	8,442	9,061,878	0.1
General Motors Financial Co., Inc. . . . .	4.30%	07/13/2025	3,190	3,529,091	0.0
General Motors Financial Co., Inc. . . . .	5.10%	01/17/2024	5,129	5,708,197	0.0
General Motors Financial Co., Inc. . . . .	5.25%	03/01/2026	4,702	5,436,269	0.0
General Motors Financial Co., Inc. . . . .	5.65%	01/17/2029	11,876	14,435,128	0.1
Lear Corp. . . . .	3.50%	05/30/2030	12,304	13,060,919	0.1
				<u>74,201,374</u>	<u>0.4</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
James Hardie International Finance DAC . . . . .	5.00%	01/15/2028	1,949	2,072,102	0.0
Marriott International, Inc./MD, Series EE . . . . .	5.75%	05/01/2025	6,031	6,948,545	0.0
MDC Holdings, Inc. . . . .	6.00%	01/15/2043	31,126	41,363,813	0.2
Owens Corning . . . . .	7.00%	12/01/2036	2,898	4,007,809	0.0
PulteGroup, Inc. . . . .	6.00%	02/15/2035	615	803,418	0.0
PulteGroup, Inc. . . . .	6.38%	05/15/2033	10,924	14,419,007	0.1
PulteGroup, Inc. . . . .	7.88%	06/15/2032	27,955	40,192,159	0.2
				<u>109,806,853</u>	<u>0.5</u>
<b>ENERGIE</b>					
Cenovus Energy, Inc. . . . .	5.38%	07/15/2025	10,349	11,698,273	0.1
Cenovus Energy, Inc. . . . .	6.75%	11/15/2039	5,144	6,632,257	0.0
Continental Resources, Inc./OK . . . . .	5.75%	01/15/2031	19,163	21,657,693	0.1
Energy Transfer Operating LP . . . . .	8.25%	11/15/2029	1,000	1,349,490	0.0
Hess Corp. . . . .	7.30%	08/15/2031	2,953	3,850,327	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G . . . . .	7.75%	01/15/2032	4,518	6,446,103	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G . . . . .	7.80%	08/01/2031	18,933	26,724,822	0.1
ONEOK, Inc. . . . .	5.85%	01/15/2026	14,927	17,621,951	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp. . . . .	3.60%	11/01/2024	4,987	5,333,326	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp. . . . .	4.50%	12/15/2026	6,690	7,391,109	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp. . . . .	4.65%	10/15/2025	20,509	22,660,830	0.1
				<u>131,366,181</u>	<u>0.6</u>
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Expedia Group, Inc. . . . .	6.25%	05/01/2025	7,712	9,036,002	0.1



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Dell International LLC/EMC Corp.....	5.85%	07/15/2025	USD 9,315	\$ 10,943,357	0.0%
Dell International LLC/EMC Corp.....	8.35%	07/15/2046	9,330	14,130,397	0.1
Nokia Oyj.....	6.63%	05/15/2039	2,000	2,526,643	0.0
				<u>27,600,397</u>	<u>0.1</u>
<b>TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN</b>					
Delta Air Lines, Inc.....	7.00%	05/01/2025	27,353	31,780,251	0.1
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd. ....	4.50%	10/20/2025	15,394	16,394,771	0.1
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd. ....	4.75%	10/20/2028	17,879	19,733,946	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.....	6.50%	06/20/2027	48,950	53,460,851	0.3
				<u>121,369,819</u>	<u>0.6</u>
				<u>588,064,092</u>	<u>2.8</u>
				<u>1,940,045,239</u>	<u>9.3</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG</b>					
<b>STAATSANLEIHEN</b>					
<b>BRASILIEN</b>					
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F .....	10.00%	01/01/2023	BRL 2,619,705	500,313,936	2.4
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F .....	10.00%	01/01/2025	193,351	37,396,449	0.2
				<u>537,710,385</u>	<u>2.6</u>
<b>KOLUMBIEN</b>					
Colombian TES, Series B .....	5.75%	11/03/2027	COP 371,886,500	104,586,068	0.5
Colombian TES, Series B .....	7.50%	08/26/2026	130,000,000	40,165,972	0.2
Colombian TES, Series B .....	10.00%	07/24/2024	152,590,800	50,088,024	0.2
				<u>194,840,064</u>	<u>0.9</u>
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>					
Dominican Republic International Bond .....	16.95%	02/04/2022	DOP 1,599,300	30,255,646	0.1
<b>ÄGYPTEN</b>					
Egypt Government Bond, Series 5YR .....	14.06%	01/12/2026	EGP 419,000	26,368,922	0.1
<b>INDONESIEN</b>					
Indonesia Treasury Bond, Series FR44 .....	10.00%	09/15/2024	IDR 140,000,000	11,084,972	0.0
Indonesia Treasury Bond, Series FR46 .....	9.50%	07/15/2023	250,000,000	19,109,902	0.1
				<u>30,194,874</u>	<u>0.1</u>
<b>MEXIKO</b>					
Mexican Bonos, Series M .....	8.00%	09/05/2024	MXN 2,817,670	148,907,146	0.7
Mexican Bonos, Series M 20 .....	7.50%	06/03/2027	2,235,601	118,112,771	0.6
				<u>267,019,917</u>	<u>1.3</u>
<b>RUSSLAND</b>					
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6209 .....	7.60%	07/20/2022	RUB 662,328	9,215,814	0.0
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6227 .....	7.40%	07/17/2024	5,209,135	73,193,619	0.4
				<u>82,409,433</u>	<u>0.4</u>
<b>SÜDAFRIKA</b>					
Republic of South Africa Government Bond, Series 2023 .....	7.75%	02/28/2023	ZAR 2,605,263	180,140,876	0.9
Republic of South Africa Government Bond, Series 2030 .....	8.00%	01/31/2030	3,582,220	221,724,795	1.0
Republic of South Africa Government Bond, Series 2032 .....	8.25%	03/31/2032	642,845	38,183,020	0.2
Republic of South Africa Government Bond, Series R186 .....	10.50%	12/21/2026	808,970	61,265,861	0.3
				<u>501,314,552</u>	<u>2.4</u>
<b>TÜRKEI</b>					
Turkey Government Bond .....	11.70%	11/13/2030	TRY 416,780	52,162,387	0.3
				<u>1,722,276,180</u>	<u>8.2</u>
<b>SCHATZOBLIGATIONEN</b>					
<b>INDONESIEN</b>					
JPMorgan Chase Bank, NA .....	9.50%	05/17/2041	IDR 414,814,000	34,421,481	0.2
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>ENERGIE</b>					
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E .....	7.13%	10/10/2022	INR 2,500,000	33,799,415	0.1
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
HDFC Bank Ltd. ....	8.10%	03/22/2025	1,070,000	14,910,254	0.1
				<u>1,805,407,330</u>	<u>8.6</u>
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-1A, Class B1(f) .....	4.37%	04/25/2028	USD 3,894	3,931,800	0.0
Series 2018-1A, Class M2(f) .....	3.02%	04/25/2028	934	941,315	0.0
Series 2018-3A, Class M2(f) .....	2.87%	10/25/2028	14,474	14,541,157	0.1
Series 2019-4A, Class M2(f) .....	2.97%	10/25/2029	9,310	9,386,100	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>Connecticut Avenue Securities Trust</b>					
Series 2018-R07, Class 1B1(f)	4.47%	04/25/2031	USD 8,645	\$ 8,861,527	0.0%
Series 2020-SBT1, Class 1M2(f)	3.77%	02/25/2040	29,195	29,992,618	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2M2(f)	3.78%	02/25/2040	17,621	18,174,928	0.1
<b>Eagle Re Ltd.</b>					
Series 2019-1, Class M1B(f)	1.92%	04/25/2029	894	894,879	0.0
Series 2019-1, Class M2(f)	3.42%	04/25/2029	3,654	3,681,867	0.0
Series 2020-1, Class M2(f)	2.12%	01/25/2030	10,952	10,336,112	0.1
<b>Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit</b>					
<b>Risk Debt Notes</b>					
Series 2013-DN2, Class M2(f)	4.38%	11/25/2023	2,968	2,985,977	0.0
Series 2014-DN3, Class M3(f)	4.13%	08/25/2024	1,912	1,954,834	0.0
Series 2015-DN1, Class B(f)	11.62%	01/25/2025	1,862	1,955,058	0.0
Series 2015-DNA1, Class B(f)	9.33%	10/25/2027	32,046	37,164,741	0.2
Series 2015-DNA1, Class M3(f)	3.42%	10/25/2027	2,225	2,269,883	0.0
Series 2015-DNA2, Class B(f)	7.68%	12/25/2027	48,199	52,053,561	0.3
Series 2015-DNA3, Class B(f)	9.48%	04/25/2028	15,281	18,073,146	0.1
Series 2015-HQ1, Class B(f)	10.87%	03/25/2025	11,353	12,035,999	0.1
Series 2015-HQ2, Class B(f)	8.07%	05/25/2025	1,444	1,478,507	0.0
Series 2015-HQA1, Class B(f)	8.92%	03/25/2028	17,620	19,167,855	0.1
Series 2015-HQA2, Class B(f)	10.62%	05/25/2028	10,443	11,760,380	0.1
Series 2016-DNA3, Class B(f)	11.37%	12/25/2028	7,247	8,546,763	0.0
Series 2016-DNA4, Class B(f)	8.72%	03/25/2029	8,709	9,083,031	0.0
Series 2016-HQA1, Class B(f)	12.87%	09/25/2028	16,441	20,280,916	0.1
Series 2016-HQA1, Class M3(f)	6.48%	09/25/2028	21,825	23,172,061	0.1
Series 2016-HQA2, Class B(f)	11.62%	11/25/2028	13,660	16,179,178	0.1
Series 2016-HQA4, Class B(f)	8.87%	04/25/2029	2,294	2,450,271	0.0
Series 2017-DNA1, Class B1(f)	5.08%	07/25/2029	25,819	27,859,308	0.1
Series 2017-DNA2, Class B1(f)	5.27%	10/25/2029	40,822	44,271,291	0.2
Series 2017-DNA3, Class B1(f)	4.58%	03/25/2030	53,193	56,051,023	0.3
Series 2017-HQA1, Class B1(f)	5.13%	08/25/2029	1,584	1,647,362	0.0
Series 2017-HQA2, Class B1(f)	4.88%	12/25/2029	9,130	9,697,272	0.1
Series 2017-HQA3, Class B1(f)	4.57%	04/25/2030	4,415	4,523,900	0.0
Series 2018-DNA1, Class B1(f)	3.28%	07/25/2030	5,498	5,491,580	0.0
Series 2018-HQA1, Class M2(f)	2.42%	09/25/2030	2,355	2,360,925	0.0
Series 2019-DNA1, Class B1(f)	4.78%	01/25/2049	3,365	3,499,398	0.0
Series 2019-DNA1, Class M2(f)	2.78%	01/25/2049	8,066	8,128,072	0.0
Series 2019-FTR2, Class M2(f)	2.28%	11/25/2048	6,650	6,622,326	0.0
Series 2019-HQA2, Class B1(f)	4.22%	04/25/2049	3,738	3,822,884	0.0
Series 2020-HQA2, Class M2(f)	3.23%	03/25/2050	13,137	13,227,794	0.1
<b>Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities</b>					
Series 2014-C01, Class M2(f)	4.53%	01/25/2024	2,394	2,454,758	0.0
Series 2014-C03, Class 2M2(f)	3.03%	07/25/2024	908	918,327	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(f)	5.03%	11/25/2024	27,587	28,401,452	0.1
Series 2015-C01, Class 1M2(f)	4.43%	02/25/2025	15,239	15,575,492	0.1
Series 2015-C02, Class 1M2(f)	4.13%	05/25/2025	14,808	15,122,450	0.1
Series 2015-C03, Class 1M2(f)	5.13%	07/25/2025	1,296	1,327,935	0.0
Series 2015-C03, Class 2M2(f)	5.13%	07/25/2025	1,562	1,592,651	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(f)	5.83%	04/25/2028	8,017	8,509,879	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(f)	5.68%	04/25/2028	15,500	16,294,636	0.1
Series 2016-C01, Class 1B(f)	11.87%	08/25/2028	39,292	47,744,324	0.2
Series 2016-C01, Class 1M2(f)	6.88%	08/25/2028	20,618	21,846,203	0.1
Series 2016-C02, Class 1B(f)	12.37%	09/25/2028	21,462	26,584,756	0.1
Series 2016-C02, Class 1M2(f)	6.13%	09/25/2028	5,921	6,236,520	0.0
Series 2016-C03, Class 1B(f)	11.87%	10/25/2028	7,786	9,491,045	0.1
Series 2016-C03, Class 1M2(f)	5.43%	10/25/2028	4,157	4,372,264	0.0
Series 2016-C03, Class 2B(f)	12.87%	10/25/2028	18,473	22,673,005	0.1
Series 2016-C03, Class 2M2(f)	6.03%	10/25/2028	31,725	33,337,831	0.2
Series 2016-C04, Class 1B(f)	10.38%	01/25/2029	44,258	51,698,195	0.3
Series 2016-C05, Class 2B(f)	11.24%	01/25/2029	32,431	38,556,883	0.2
Series 2016-C06, Class 1B(f)	9.37%	04/25/2029	21,248	23,673,981	0.1
Series 2016-C07, Class 2B(f)	9.62%	05/25/2029	27,713	31,582,095	0.2
Series 2017-C01, Class 1B1(f)	5.87%	07/25/2029	8,561	9,376,338	0.1
Series 2017-C01, Class 1M2(f)	3.68%	07/25/2029	6,278	6,478,180	0.0
Series 2017-C02, Class 2B1(f)	5.62%	09/25/2029	1,584	1,690,781	0.0
Series 2017-C02, Class 2M2(f)	3.77%	09/25/2029	9,632	9,907,387	0.1
Series 2017-C03, Class 1B1(f)	4.97%	10/25/2029	41,247	44,763,634	0.2
Series 2017-C04, Class 2B1(f)	5.17%	11/25/2029	4,454	4,839,106	0.0
Series 2017-C04, Class 2M2(f)	2.97%	11/25/2029	153	155,299	0.0
Series 2017-C05, Class 1B1(f)	3.73%	01/25/2030	11,946	12,343,647	0.1
Series 2017-C06, Class 1B1(f)	4.27%	02/25/2030	8,320	8,619,532	0.0
Series 2017-C06, Class 1M2(f)	2.77%	02/25/2030	3,341	3,376,534	0.0
Series 2017-C06, Class 2M2(f)	2.93%	02/25/2030	4,417	4,473,838	0.0
Series 2018-C01, Class 1B1(f)	3.67%	07/25/2030	24,895	25,051,050	0.1
Series 2018-C04, Class 2M2(f)	2.68%	12/25/2030	4,362	4,398,635	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Home Re Ltd., Series 2018-1, Class M2(f) . . . . .	3.13%	10/25/2028	USD 14,423	\$ 14,546,866	0.1%
Oaktown Re III Ltd., Series 2019-1A, Class M2(f) . . . . .	2.68%	07/25/2029	2,222	2,235,678	0.0
Radnor Re Ltd.					
Series 2018-1, Class M2(f) . . . . .	2.83%	03/25/2028	2,721	2,742,596	0.0
Series 2019-1, Class M2(f) . . . . .	3.33%	02/25/2029	2,254	2,275,495	0.0
Series 2019-2, Class M1B(f) . . . . .	1.88%	06/25/2029	519	518,199	0.0
Series 2020-1, Class M2A(f) . . . . .	2.13%	02/25/2030	11,179	11,095,093	0.1
Series 2020-1, Class M2B(f) . . . . .	2.38%	02/25/2030	9,514	9,305,673	0.1
STACR Trust, Series 2018-DNA2, Class B1(f) . . . . .	3.83%	12/25/2030	5,829	6,004,288	0.0
Triangle Re Ltd., Series 2020-1, Class M2(f) . . . . .	5.73%	10/25/2030	7,900	8,148,637	0.0
				<u>1,128,898,767</u>	<u>5.4</u>
<b>VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE</b>					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4954, Class SL(f) (g) . . . . .	5.93%	02/25/2050	29,692	5,735,757	0.0
Series 4248, Class SL(f) (g) . . . . .	5.94%	05/15/2041	22,771	4,184,760	0.0
Series 4981, Class JS(f) (g) . . . . .	5.98%	06/25/2050	168,674	27,348,007	0.2
Series 4981, Class HS(f) (g) . . . . .	5.98%	06/25/2050	98,952	16,920,652	0.1
Series 4701, Class NS(f) (g) . . . . .	6.04%	08/15/2039	8,032	1,723,313	0.0
Series 4125, Class SA(f) (g) . . . . .	6.04%	11/15/2042	7,543	1,515,639	0.0
Series 4736, Class LS(f) (g) . . . . .	6.09%	12/15/2047	31,634	6,947,527	0.1
Series 4736, Class SM(f) (g) . . . . .	6.09%	12/15/2047	66,999	13,992,002	0.1
Series 4774, Class BS(f) (g) . . . . .	6.09%	02/15/2048	39,592	7,066,791	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2012-70, Class HS(f) (g) . . . . .	5.88%	07/25/2042	4,685	980,006	0.0
Series 2016-64, Class SP(f) (g) . . . . .	5.88%	09/25/2046	23,581	5,605,480	0.0
Series 2016-89, Class SH(f) (g) . . . . .	5.88%	12/25/2046	17,065	3,356,613	0.0
Series 2020-26, Class GS(f) (g) . . . . .	5.88%	05/25/2050	13,135	2,405,027	0.0
Series 2019-38, Class SM(f) (g) . . . . .	5.93%	07/25/2049	8,284	1,705,081	0.0
Series 2019-65, Class SY(f) (g) . . . . .	5.93%	11/25/2049	14,409	3,172,178	0.0
Series 2013-15, Class SA(f) (g) . . . . .	6.03%	03/25/2043	20,979	4,778,529	0.0
Series 2018-36, Class SG(f) (g) . . . . .	6.08%	06/25/2048	18,414	3,757,133	0.0
Series 2017-97, Class SW(f) (g) . . . . .	6.08%	12/25/2047	37,100	8,432,630	0.1
Series 2018-43, Class SB(f) (g) . . . . .	6.08%	06/25/2048	11,789	2,129,439	0.0
Series 2015-26, Class SH(f) (g) . . . . .	6.33%	05/25/2045	6,837	1,379,909	0.0
Series 2005-91, Class SD(f) (g) . . . . .	6.58%	10/25/2035	7,183	1,461,746	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2015-3, Class DS(f) (g) . . . . .	5.49%	11/20/2041	27,676	3,046,730	0.0
Series 2020-47, Class SG(f) (g) . . . . .	5.89%	02/20/2049	16,651	3,174,956	0.0
Series 2009-76, Class SB(f) (g) . . . . .	5.99%	09/16/2039	7,792	1,489,480	0.0
Series 2017-134, Class MS(f) (g) . . . . .	6.09%	09/20/2047	9,471	2,143,832	0.0
Series 2017-161, Class CS(f) (g) . . . . .	6.14%	10/20/2047	20,637	4,086,972	0.0
				<u>138,540,189</u>	<u>0.7</u>
<b>FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE</b>					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 5011, Class MI(h) . . . . .	3.00%	09/25/2050	13,335	2,158,204	0.0
Series 5008, Class AI(h) . . . . .	3.50%	09/25/2050	14,690	2,619,071	0.0
Series 5030, Class EI(h) . . . . .	3.50%	10/25/2050	5,705	1,020,535	0.0
Series 5040, Class AI(h) . . . . .	3.50%	11/25/2050	2,180	348,370	0.0
Series 5049, Class CI(h) . . . . .	3.50%	12/25/2050	28,567	4,047,742	0.0
Series 4941, Class IO(h) . . . . .	4.00%	12/15/2047	32,990	4,771,841	0.0
Series 5036, Class IT(h) . . . . .	4.00%	03/25/2050	8,383	1,356,837	0.0
Series 5015, Class BI(h) . . . . .	4.00%	09/25/2050	27,465	4,745,779	0.0
Series 5013, Class JI(h) . . . . .	4.00%	09/25/2050	34,893	4,670,753	0.0
Series 5018, Class AI(h) . . . . .	4.00%	10/25/2050	14,930	2,583,600	0.0
Series 5024, Class DI(h) . . . . .	4.00%	10/25/2050	6,268	1,036,760	0.0
Series 5052, Class IK(h) . . . . .	4.00%	12/25/2050	25,221	3,893,970	0.0
Series 4987, Class IC(h) . . . . .	4.50%	06/25/2050	150,091	22,183,430	0.1
Series 4976, Class MI(h) . . . . .	4.50%	05/25/2050	37,949	6,166,189	0.1
Series 5018, Class GI(h) . . . . .	4.50%	10/25/2050	23,253	3,628,268	0.0
Series 4981, Class MI(h) . . . . .	5.00%	06/25/2050	39,424	6,230,997	0.1
Series 4993, Class LI(h) . . . . .	5.00%	07/25/2050	18,511	2,799,662	0.0
Series 5043, Class IO(h) . . . . .	5.00%	11/25/2050	19,134	3,627,369	0.0
Series 4398, Class IO(h) . . . . .	6.00%	10/15/2037	31,310	6,752,965	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2020-89, Class KI(h) . . . . .	4.00%	12/25/2050	82,839	13,429,982	0.1
Series 2015-49, Class LI(h) . . . . .	5.00%	07/25/2045	16,159	2,688,183	0.0
Series 2016-26, Class IO(h) . . . . .	5.00%	05/25/2046	16,864	2,849,155	0.0
Series 2010-109, Class IQ(h) . . . . .	5.50%	08/25/2040	7,246	873,733	0.0
Series 2019-4, Class AI(h) . . . . .	6.00%	08/25/2038	28,046	5,835,442	0.0
Series 2013-66, Class LI(h) . . . . .	7.00%	07/25/2043	16,891	3,595,618	0.0
				<u>113,914,455</u>	<u>0.5</u>
<b>NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH</b>					
Alternative Loan Trust					
Series 2006-24CB, Class A16 . . . . .	5.75%	08/25/2036	1,710	1,351,872	0.0
Series 2007-15CB, Class A19 . . . . .	5.75%	07/25/2037	1,729	1,407,525	0.0



**AB FCPI**  
**Global High Yield Portfolio**

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2006-28CB, Class A18	6.00%	10/25/2036	USD 945	\$ 678,635	0.0%
Series 2007-16CB, Class 1A7	6.00%	08/25/2037	3,919	3,753,821	0.0
Series 2006-42, Class 1A6	6.00%	01/25/2047	2,968	2,339,449	0.0
Series 2006-26CB, Class A6	6.25%	09/25/2036	712	503,919	0.0
Series 2006-26CB, Class A8	6.25%	09/25/2036	2,696	1,906,708	0.0
Series 2006-28CB, Class A14	6.25%	10/25/2036	2,683	1,979,170	0.0
Series 2006-J5, Class 1A1	6.50%	09/25/2036	2,200	1,771,164	0.0
Bear Stearns ARM Trust, Series 2007-4, Class 22A1	3.62%	06/25/2047	8,713	8,708,505	0.1
ChaseFlex Trust, Series 2007-1, Class 1A3	6.50%	02/25/2037	4,790	2,562,565	0.0
<b>CHL Mortgage Pass-Through Trust</b>					
Series 2007-HY4, Class 1A1	3.01%	09/25/2047	2,576	2,472,090	0.0
Series 2007-3, Class A30	5.75%	04/25/2037	1,478	1,055,873	0.0
Citigroup Mortgage Loan Trust, Series 2007-AR4, Class 1A1A	3.20%	03/25/2037	1,726	1,722,489	0.0
CitiMortgage Alternative Loan Trust, Series 2007-A3, Class 1A4	5.75%	03/25/2037	652	666,093	0.0
<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust,</b>					
Series 2006-13, Class 1A19	6.25%	09/25/2036	669	431,577	0.0
<b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust</b>					
Series 2006-AA3, Class A1	2.56%	06/25/2036	2,300	2,126,748	0.0
Series 2006-FA3, Class A9	6.00%	07/25/2036	2,910	2,030,677	0.0
<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust,</b>					
Series 2007-6XS, Class 2A5S	6.00%	02/25/2047	4,523	2,676,620	0.0
<b>Residential Accredited Loans, Inc. Trust</b>					
Series 2005-QA10, Class A31	3.98%	09/25/2035	4,493	3,985,095	0.1
Series 2005-QS14, Class 3A1	6.00%	09/25/2035	1,249	1,222,024	0.0
<b>Residential Asset Securitization Trust</b>					
Series 2006-A8, Class 3A4	6.00%	08/25/2036	2,749	2,031,603	0.0
Series 2007-A1, Class A8	6.00%	03/25/2037	4,079	2,374,964	0.0
Series 2007-A5, Class 2A3	6.00%	05/25/2037	1,211	1,002,493	0.0
<b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust,</b>					
Series 2006-3, Class 3CB4	6.00%	04/25/2036	575	564,105	0.0
				<u>51,325,784</u>	<u>0.2</u>
<b>NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Alternative Loan Trust, Series 2007-7T2, Class A3(f)	0.72%	04/25/2037	6,915	2,214,015	0.0
Citigroup Mortgage Loan Trust, Series 2005-8, Class 2A2(f) (g)	4.68%	09/25/2035	1,682	50,288	0.0
<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust,</b>					
Series 2007-13, Class A7(f)	0.72%	08/25/2037	2,751	1,273,000	0.0
<b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust,</b>					
Series 2007-FA2, Class 1A6(f) (g)	5.43%	04/25/2037	1,913	339,683	0.0
Impac Secured Assets Corp., Series 2005-2, Class A2D(f)	0.55%	03/25/2036	1,818	1,623,868	0.0
<b>Lehman XS Trust</b>					
Series 2007-16N, Class 2A2(f)	0.98%	09/25/2047	2,489	2,512,367	0.1
Series 2007-10H, Class 2A10(f) (g)	6.88%	07/25/2037	4,091	744,698	0.0
PHH Alternative Mortgage Trust, Series 2007-2, Class 1A3(f)	0.46%	05/25/2037	1,768	1,724,584	0.0
RBSGC Mortgage Loan Trust, Series 2007-B, Class 1A4(f)	0.58%	01/25/2037	1,060	359,512	0.0
<b>Residential Accredited Loans, Inc. Trust,</b>					
Series 2006-QS18, Class 2A2(f) (g)	6.42%	12/25/2036	8,127	1,600,094	0.0
				<u>12,442,109</u>	<u>0.1</u>
				<u>1,445,121,304</u>	<u>6.9</u>
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
U.S. Treasury Bonds(i)	1.38%	08/15/2050	179,875	147,778,555	0.7
U.S. Treasury Bonds(i)	6.00%	02/15/2026	293,266	366,308,063	1.7
U.S. Treasury Bonds(i)	6.13%	11/15/2027	62,738	83,030,219	0.4
U.S. Treasury Bonds(i)	6.25%	05/15/2030	83,300	118,611,386	0.6
U.S. Treasury Bonds(i)	6.63%	02/15/2027	55,285	73,312,963	0.3
U.S. Treasury Bonds(i)	6.75%	08/15/2026	212,755	278,276,902	1.3
U.S. Treasury Bonds(i)	7.50%	11/15/2024	58,500	73,417,500	0.4
U.S. Treasury Bonds(i)	7.63%	02/15/2025	41,846	53,262,112	0.3
U.S. Treasury Notes(i)	0.38%	04/30/2025	5,100	5,050,594	0.0
U.S. Treasury Notes	0.63%	08/15/2030	200	185,750	0.0
				<u>1,199,234,044</u>	<u>5.7</u>
<b>INVESTMENTGESELLSCHAFTEN</b>					
<b>FONDS UND INVESTMENTTRUSTS</b>					
AB FCPI - Mortgage Income Portfolio - Class SA			1,694,116	136,698,194	0.7
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			806,472	86,905,455	0.4
<b>AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio -</b>					
Class S			4,017,647	108,476,468	0.5
<b>AB SICAV I - Emerging Market Local Currency Debt Portfolio -</b>					
Class ZT			16,580,292	211,564,530	1.0
AB SICAV I - Euro High Yield Portfolio - Class S			4,195,749	161,996,180	0.8
AB SICAV I - Financial Credit Portfolio - Class ZT			1,241,460	141,464,349	0.7
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT			4,182,655	63,576,361	0.3
				<u>910,681,537</u>	<u>4.4</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE</b>					
<b>QUASI-STAAATSANLEIHEN</b>					
<b>BAHRAIN</b>					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The).....	7.50%	10/25/2027	USD 4,456	\$ 5,070,092	0.0%
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The), Series FEB .....	7.63%	11/07/2024	17,099	19,065,385	0.1
				<u>24,135,477</u>	<u>0.1</u>
<b>INDONESIEN</b>					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT .....	4.75%	05/15/2025	1,131	1,237,031	0.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT .....	5.45%	05/15/2030	1,209	1,384,305	0.0
				<u>2,621,336</u>	<u>0.0</u>
<b>MEXIKO</b>					
Petroleos Mexicanos .....	5.95%	01/28/2031	90,503	87,199,641	0.4
Petroleos Mexicanos .....	6.75%	09/21/2047	57,880	50,659,470	0.2
Petroleos Mexicanos .....	6.84%	01/23/2030	44,250	44,471,250	0.2
Petroleos Mexicanos .....	6.95%	01/28/2060	36,944	32,326,000	0.2
Petroleos Mexicanos .....	7.69%	01/23/2050	55,668	52,879,033	0.3
				<u>267,535,394</u>	<u>1.3</u>
<b>SÜDAFRIKA</b>					
Eskom Holdings SOC Ltd. ....	6.35%	08/10/2028	7,156	7,690,464	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd. ....	7.13%	02/11/2025	7,482	7,843,380	0.1
				<u>15,533,844</u>	<u>0.1</u>
<b>TRINIDAD &amp; TOBAGO</b>					
Trinidad Generation UnLtd.....	5.25%	11/04/2027	441	457,951	0.0
<b>UKRAINE</b>					
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC .....	9.63%	03/20/2025	4,229	4,524,656	0.0
<b>VENEZUELA</b>					
Petroleos de Venezuela SA(c) .....	5.38%	04/12/2027	61,738	2,469,512	0.0
				<u>317,278,170</u>	<u>1.5</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>ENERGIE</b>					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC .....	7.38%	07/19/2022	10,054	10,349,336	0.1
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The).....	8.38%	11/07/2028	14,848	17,585,600	0.1
				<u>27,934,936</u>	<u>0.2</u>
<b>SONSTIGE INDUSTRIEWERTE</b>					
DP World Salaam(d) .....	6.00%	10/01/2025	21,915	23,855,241	0.1
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
DP World Crescent Ltd.....	3.88%	07/18/2029	899	950,693	0.0
DP World PLC .....	5.63%	09/25/2048	3,782	4,498,216	0.0
				<u>5,448,909</u>	<u>0.0</u>
				<u>57,239,086</u>	<u>0.3</u>
				<u>374,517,256</u>	<u>1.8</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE</b>					
<b>BAHRAIN</b>					
Bahrain Government International Bond.....	5.45%	09/16/2032	2,327	2,315,365	0.0
Bahrain Government International Bond.....	5.63%	09/30/2031	38,984	39,373,840	0.2
Bahrain Government International Bond.....	6.75%	09/20/2029	17,385	19,166,962	0.1
Bahrain Government International Bond.....	7.00%	10/12/2028	53,288	60,415,536	0.3
Bahrain Government International Bond.....	7.38%	05/14/2030	6,009	6,833,360	0.0
CBB International Sukuk Programme Co. SPC .....	6.25%	11/14/2024	6,455	7,116,638	0.1
				<u>135,221,701</u>	<u>0.7</u>
<b>OMAN</b>					
Oman Government International Bond .....	4.13%	01/17/2023	36,310	36,911,384	0.2
Oman Government International Bond .....	4.75%	06/15/2026	7,017	7,128,834	0.0
Oman Government International Bond .....	5.38%	03/08/2027	4,890	5,059,622	0.0
Oman Government International Bond .....	6.25%	01/25/2031	32,548	34,256,770	0.2
Oman Government International Bond .....	6.50%	03/08/2047	10,000	9,437,500	0.0
				<u>92,794,110</u>	<u>0.4</u>
				<u>228,015,811</u>	<u>1.1</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Consolidated Energy Finance SA .....	6.50%	05/15/2026	5,585	5,657,306	0.0
Consolidated Energy Finance SA .....	6.88%	06/15/2025	37,865	38,639,105	0.2
				<u>44,296,411</u>	<u>0.2</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Odebrecht Holdco Finance Ltd.....	0.00%	09/10/2058	25,375	723,126	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Melco Resorts Finance Ltd. ....	5.38%	12/04/2029	USD 2,875	\$ 3,028,180	0.0%
Melco Resorts Finance Ltd. ....	5.63%	07/17/2027	10,154	10,684,071	0.1
MGM China Holdings Ltd. ....	5.25%	06/18/2025	5,982	6,277,885	0.0
MGM China Holdings Ltd. ....	5.38%	05/15/2024	7,461	7,687,218	0.0
MGM China Holdings Ltd. ....	5.88%	05/15/2026	6,242	6,582,189	0.0
Studio City Finance Ltd. ....	5.00%	01/15/2029	4,548	4,616,220	0.0
Studio City Finance Ltd. ....	6.00%	07/15/2025	9,535	10,064,193	0.0
Studio City Finance Ltd. ....	6.50%	01/15/2028	10,680	11,481,000	0.1
Wynn Macau Ltd. ....	5.13%	12/15/2029	3,667	3,712,838	0.0
Wynn Macau Ltd. ....	5.50%	01/15/2026	16,527	17,256,317	0.1
Wynn Macau Ltd. ....	5.50%	10/01/2027	12,252	12,726,765	0.1
Wynn Macau Ltd. ....	5.63%	08/26/2028	10,091	10,577,722	0.1
				<u>104,694,598</u>	<u>0.5</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV. ....	7.13%	01/31/2025	21,515	23,450,489	0.1
<b>ENERGIE</b>					
Kosmos Energy Ltd. ....	1.00%	03/01/2028	13,719	13,600,570	0.1
Leviathan Bond Ltd. ....	6.13%	06/30/2025	7,639	8,356,170	0.0
Leviathan Bond Ltd. ....	6.50%	06/30/2027	13,968	15,454,732	0.1
				<u>37,411,472</u>	<u>0.2</u>
				<u>210,576,096</u>	<u>1.0</u>
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd./Highlands Holdings Bond Co-Issuer, Inc.(a) ....	7.63%	10/15/2025	11,951	12,718,845	0.1
				<u>223,294,941</u>	<u>1.1</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>					
<b>NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS</b>					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E. ....	4.65%	02/10/2036	11,700	12,293,065	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(h) ....	1.01%	11/15/2050	5,684	264,563	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C8, Class XA(h) ....	1.60%	06/15/2050	9,514	653,546	0.0
Citigroup Commercial Mortgage Trust Series 2013-GC11, Class XA(h) ....	1.36%	04/10/2046	23,730	540,925	0.0
Series 2014-GC23, Class D. ....	4.48%	07/10/2047	15,574	14,372,528	0.1
Series 2015-GC29, Class XA(h) ....	1.04%	04/10/2048	29,339	1,081,156	0.0
Series 2017-P8, Class XA(h). ....	0.90%	09/15/2050	47,126	2,282,286	0.0
Series 2018-C6, Class XA(h) ....	0.78%	11/10/2051	3,195	167,584	0.0
Commercial Mortgage Trust Series 2010-C1, Class F. ....	4.00%	07/10/2046	3,049	2,293,880	0.0
Series 2012-CR2, Class G. ....	4.25%	08/15/2045	4,120	1,374,340	0.0
Series 2012-CR3, Class XA(h) ....	1.84%	10/15/2045	67,927	1,420,108	0.0
Series 2012-CR5, Class XA(h) ....	1.51%	12/10/2045	50,179	1,121,611	0.0
Series 2013-LC6, Class XA(h) ....	1.32%	01/10/2046	39,492	720,022	0.0
Series 2014-CR15, Class XA(h) ....	0.93%	02/10/2047	55,218	1,181,363	0.0
Series 2014-CR16, Class D. ....	4.94%	04/10/2047	20,000	18,676,202	0.1
Series 2014-CR20, Class XA(h) ....	1.02%	11/10/2047	50,682	1,573,890	0.0
Series 2016-DC2, Class XA(h) ....	0.96%	02/10/2049	42,755	1,649,043	0.0
GS Mortgage Securities Trust Series 2011-GC5, Class D. ....	5.35%	08/10/2044	2,801	1,711,414	0.0
Series 2014-GC18, Class D. ....	4.99%	01/10/2047	6,930	2,209,794	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(h) ....	1.12%	08/10/2050	57,770	3,121,032	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust Series 2013-C14, Class D. ....	4.70%	08/15/2046	3,001	2,239,076	0.0
Series 2013-C15, Class XA(h) ....	1.05%	11/15/2045	31,499	732,266	0.0
Series 2014-C21, Class XA(h) ....	1.00%	08/15/2047	64,761	1,663,725	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust Series 2012-C6, Class XA(h) ....	1.61%	11/15/2045	37,566	651,955	0.0
Series 2015-C22, Class XA(h) ....	1.03%	04/15/2048	69,172	2,185,076	0.0
Series 2016-C30, Class XA(h) ....	1.39%	09/15/2049	61,308	3,628,731	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2016-BNK2, Class XA(h)	1.04%	11/15/2049	87,029	3,604,801	0.0
UBS Commercial Mortgage Trust Series 2017-C2, Class XA(h) ....	1.06%	08/15/2050	3,112	159,542	0.0
Series 2018-C10, Class XA(h) ....	0.95%	05/15/2051	85,596	4,475,269	0.0
Series 2018-C14, Class XA(h) ....	0.99%	12/15/2051	49,683	3,042,403	0.0
Series 2018-C15, Class XA(h) ....	0.94%	12/15/2051	102,675	5,850,601	0.1
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust Series 2016-C33, Class XA(h) ....	1.62%	03/15/2059	61,358	4,052,771	0.0
Series 2016-C35, Class XA(h) ....	1.92%	07/15/2048	5,536	426,948	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(h) ....	1.65%	10/15/2049	91,075	6,351,371	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2017-C38, Class XA(h) .....	1.02%	07/15/2050	USD 26,181	\$ 1,299,632	0.0%
Series 2018-C48, Class XA(h) .....	0.95%	01/15/2052	31,819	1,929,912	0.0
<b>WF-RBS Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2012-C10, Class XA(h) .....	1.52%	12/15/2045	95,527	2,205,853	0.0
Series 2012-C7, Class XA(h) .....	1.30%	06/15/2045	22,876	219,664	0.0
Series 2012-C8, Class F .....	4.88%	08/15/2045	8,767	6,058,229	0.1
Series 2012-C8, Class XA(h) .....	1.79%	08/15/2045	26,537	423,288	0.0
Series 2013-C11, Class XA(h) .....	1.17%	03/15/2045	78,030	1,430,282	0.0
				<u>121,339,747</u>	<u>0.6</u>
<b>NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS</b>					
DBWF Mortgage Trust, Series 2018-GLKS, Class E(f) .....	3.13%	12/19/2030	15,965	15,824,614	0.1
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class E(f) .....	4.86%	05/15/2036	5,780	3,584,574	0.0
				<u>19,409,188</u>	<u>0.1</u>
				<u>140,748,935</u>	<u>0.7</u>
<b>STAMMAKTIEN</b>					
Avaya Holdings Corp. ....			377,239	11,192,681	0.1
Berry Corp. ....			2,589,382	12,843,335	0.1
Denbury, Inc. ....			730,573	31,231,996	0.1
iHeartMedia, Inc. ....			479,028	6,548,313	0.0
iHeartMedia, Inc. - Class A .....			63,751	896,976	0.0
SandRidge Energy, Inc. ....			3,888	19,479	0.0
Tervita Corp. ....			4,956,611	13,359,402	0.1
Whiting Petroleum Corp. ....			207,753	7,125,928	0.0
				<u>83,218,110</u>	<u>0.4</u>
<b>SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN</b>					
<b>SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN</b>					
Inter-American Development Bank, Series GDP .....	7.88%	03/14/2023	IDR 650,000,000	47,657,347	0.2
<b>VORZUGSAKTIEN</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Hartford Financial Services Group, Inc. (The) .....	7.88%		655,525	17,718,841	0.1
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>ENERGIE</b>					
Targa Resources Corp., Series A .....	9.50%		20,939	21,985,005	0.1
				<u>39,703,846</u>	<u>0.2</u>
<b>GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
State of California, Series 2010 .....	7.60%	11/01/2040	USD 5,645	9,764,721	0.1
State of Illinois, Series 2010 .....	7.35%	07/01/2035	21,250	26,111,575	0.1
				<u>35,876,296</u>	<u>0.2</u>
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABLE VERZINSLICH</b>					
AGL CLO Ltd., Series 2021-10A, Class E(f) .....	6.19%	04/15/2034	5,000	5,000,000	0.1
Apidos CLO, Series 2021-35A, Class E(f) .....	5.94%	04/20/2034	3,000	3,000,000	0.0
Ballyrock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class D(f) .....	7.20%	01/20/2034	1,750	1,751,285	0.0
Benefit Street Partners CLO Ltd., Series 2020-22A, Class E(f) .....	7.14%	01/20/2032	1,188	1,190,650	0.0
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(f) .....	6.52%	07/18/2030	3,732	3,703,166	0.0
Dryden CLO Ltd., Series 2018-57A, Class E(f) .....	5.39%	05/15/2031	6,004	5,686,232	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class E(f) .....	7.42%	01/20/2032	2,250	2,253,611	0.0
OZLM Ltd, Series 2018-22A, Class D(f) .....	5.52%	01/17/2031	2,933	2,690,181	0.0
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class E(f) .....	6.93%	02/25/2034	3,000	3,002,793	0.0
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(f) .....	6.19%	07/15/2031	4,750	4,540,397	0.0
York CLO-3 Ltd., Series 2016-1A, Class ER(f) .....	6.62%	10/20/2029	438	425,086	0.0
				<u>33,243,401</u>	<u>0.2</u>
<b>ABS-ANLEIHEN</b>					
<b>BAUSPARDARLEHEN – FESTVERZINSLICH</b>					
CSAB Mortgage-Backed Trust, Series 2006-2, Class A6A .....	6.22%	09/25/2036	7,609	3,436,842	0.0
CWABS Asset-Backed Certificates Trust, Series 2005-7, Class AF5W .....	4.89%	10/25/2035	7,976	8,064,097	0.1
<b>GSAA Home Equity Trust</b>					
Series 2006-6, Class AF4 .....	4.27%	03/25/2036	981	402,860	0.0
Series 2006-6, Class AF5 .....	4.27%	03/25/2036	8,342	3,426,474	0.0
Series 2006-10, Class AF3 .....	5.98%	06/25/2036	4,560	1,823,878	0.0
Series 2005-12, Class AF5 .....	6.16%	09/25/2035	2,683	2,291,204	0.0
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, Series 2006-17XS, Class A6 .....	5.58%	10/25/2046	6,866	2,428,750	0.0
				<u>21,874,105</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>BAUSPARDARLEHEN – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Lehman XS Trust, Series 2007-6, Class 3A5(f) .....	4.52%	05/25/2037	USD 877	\$ 883,143	0.0%
				<u>22,757,248</u>	<u>0.1</u>
<b>OPTIONSSCHEINE</b>					
Avaya Holdings Corp., expiring 12/15/2022 .....			750,462	6,814,195	0.0
<b>BEZUGSRECHTE</b>					
Vistra Energy Corp., expiring 12/31/2049 (d) .....			454,387	518,001	0.0
				<u>20,076,473,315</u>	<u>96.0</u>
<b>KURZFRISTIGE ANLAGEN</b>					
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>					
<b>ÄGYPTEN</b>					
Egypt Treasury Bills, Series 364D .....	0.00%	03/16/2021	EGP 836,475	53,065,564	0.2
Egypt Treasury Bills .....	0.00%	03/23/2021	891,750	56,365,984	0.3
				<u>109,431,548</u>	<u>0.5</u>
				<u>20,185,904,863</u>	<u>96.5</u>
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>STAMMAKTIE</b>					
ATD New Holdings, Inc. (j) .....			525,684	21,710,749	0.1
Battalion Oil Corp. ....			393	4,559	0.0
BIS Industries Holdings Ltd. (j) .....			10,224,003	10	0.0
Carlson Travel, Inc. (j) .....			3,152	512,830	0.0
CHC Group LLC (j) .....			5,251,140	997,717	0.0
Exide Corp. (j) .....			6,006	11,261,250	0.1
Exide Technologies (j) .....			12,197,864	12	0.0
Exide Technologies/Old (j) .....			419,729	0	0.0
K201640219 South Africa Ltd. A Shares (j) .....			193,371,375	193	0.0
K201640219 South Africa Ltd. B Shares (j) .....			30,622,211	31	0.0
Liberty Tire Recycling LLC (j) .....			55,882	8,392,940	0.0
Monitronics International, Inc. (j) .....			407,250	3,461,625	0.0
Monitronics International, Inc. ....			405,564	3,447,294	0.0
Mt Logan Re Ltd. (j) .....			44,086	44,249,006	0.2
Mt. Logan Re Ltd. (Preference Shares) (Series 1) (j) .....			29,000	31,534,342	0.2
Neenah Enterprises, Inc. (j) .....			504,400	1	0.0
New Cotai LLC/New Cotai Capital Corp. (j) .....			63	0	0.0
Paragon Offshore Ltd. - Class A (j) .....			218,935	21,894	0.0
Paragon Offshore Ltd. - Class B (j) .....			328,403	2,052,519	0.0
Paysafe Group Ltd. - Class B (j) .....			49,843	17,269,315	0.1
Southeastern Grocers, Inc. (j) .....			2,612,161	33,958,093	0.2
Vantage Drilling International (j) .....			266,094	1,064,376	0.0
Willscot Corp. (j) .....			323,192	8,962,114	0.0
				<u>188,900,870</u>	<u>0.9</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>					
<b>NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS</b>					
Commercial Mortgage Trust, Series 2012-CR3, Class F. ....	4.75%	10/15/2045	USD 3,626	1,148,429	0.0
DBUBS Mortgage Trust, Series 2011-LC2A, Class E .....	5.46%	07/10/2044	7,955	6,638,829	0.1
Grantor Trust CGCMT, Series 2015-GC17(j) .....	4.49%	09/15/2048	555	10,385,131	0.0
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(j) .....	0.00%	03/10/2047	469	7,073,588	0.0
Grantor Trust CSAIL					
Series 2015-C1(j) .....	4.00%	04/15/2050	286	6,942,479	0.0
Series 2015-C1(j) .....	5.75%	03/25/2037	720	5,035,376	0.0
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(j) .....	4.00%	04/15/2050	1,109	12,645,181	0.0
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(j) .....	3.40%	10/15/2057	581	7,577,215	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2012-GC6, Class C .....	5.65%	01/10/2045	4,553	4,519,617	0.0
Series GT-E1(j) .....	0.00%	04/10/2047	69	2,923,699	0.0
Series GT-E2(j) .....	0.00%	04/10/2047	164	5,783,172	0.0
Series GT-F3(j) .....	0.00%	04/10/2047	155	8,015,669	0.1
Series GT-F4(j) .....	0.00%	04/10/2047	41	2,119,347	0.0
Series GT-G1(j) .....	6.00%	04/25/2036	636	7,860,120	0.1
Series GT-G2(j) .....	0.00%	04/10/2047	386	8,429,730	0.1
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2012-LC9, Class G .....	4.42%	12/15/2047	13,837	9,735,155	0.1
WF-RBS Commercial Mortgage Trust, Series 2014-C20, Class D	3.99%	05/15/2047	4,799	2,265,945	0.0
				<u>109,098,682</u>	<u>0.5</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Exide Global Holding NETH(j) .....	10.75%	10/26/2024	7,759	7,479,625	0.0
SNS Bank NV, Series E(d) (j) .....	0.83%	12/31/2049	EUR 7,579	0	0.0
				<u>7,479,625</u>	<u>0.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP(a) .....	9.00%	01/15/2026	USD 12,133	\$ 12,294,992	0.1%
Magnetation LLC/Mag Finance Corp.(j) (k) .....	11.00%	05/15/2018	40,106	0	0.0
				<u>12,294,992</u>	<u>0.1</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Liberty Tire Recycling LLC(j) .....	9.50%	01/15/2023	5,039	<u>5,093,123</u>	<u>0.1</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Summer BC Holdco B SARL .....	5.75%	10/31/2026	EUR 19,048	<u>24,258,453</u>	<u>0.1</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co. ....	4.38%	05/15/2026	3,111	3,893,000	0.0
Exide Technologies, (Exchange Priority)(j) .....	11.00%	10/31/2024	USD 27,457	0	0.0
Exide Technologies, (First Lien)(j) .....	11.00%	10/31/2024	11,269	0	0.0
				<u>3,893,000</u>	<u>0.0</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Sunshine Mid BV .....	6.50%	05/15/2026	EUR 18,558	<u>23,083,698</u>	<u>0.1</u>
<b>ENERGIE</b>					
Vantage Drilling International(j) .....	1.00%	04/01/2023	USD 16,605	0	0.0
Vantage Drilling International(j) (k) .....	7.50%	11/01/2019	33,306	1	0.0
				<u>1</u>	<u>0.0</u>
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Carlson Travel, Inc. ....	10.50%	03/31/2025	3,154	3,285,949	0.0
Monitronics International, Inc.(j) (k) .....	0.00%	04/01/2020	21,822	0	0.0
				<u>3,285,949</u>	<u>0.0</u>
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Modulaire Global Finance PLC .....	6.50%	02/15/2023	EUR 3,111	<u>3,809,346</u>	<u>0.0</u>
				<u>75,718,562</u>	<u>0.4</u>
<b>VERSORGBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Texas Competitive/TCEH(j) (k) .....	11.50%	10/01/2020	USD 26,532	0	0.0
				<u>83,198,187</u>	<u>0.4</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Tonon Luxembourg SA(a) (c) (j) .....	6.50%	10/31/2024	4,667	140,490	0.0
USJ-Acucar e Alcool S/A(c) .....	9.88%	11/09/2023	16,713	4,852,046	0.1
Virgolino de Oliveira Finance SA(k) .....	10.50%	01/28/2018	27,458	299,810	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(k) .....	10.88%	01/13/2020	8,270	1,654,000	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(c) .....	11.75%	02/09/2022	32,498	162,896	0.0
				<u>7,109,242</u>	<u>0.1</u>
<b>ENERGIE</b>					
Empresa Electrica Cochrane SpA .....	5.50%	05/14/2027	5,450	<u>5,765,293</u>	<u>0.0</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
K2016470219 South Africa Ltd.(a) (j) .....	3.00%	12/31/2022	16,026	0	0.0
K2016470260 South Africa Ltd.(a) (j) .....	25.00%	12/31/2022	8,250	0	0.0
				<u>0</u>	<u>0.0</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Digicel Group 0.5 Ltd.(a) .....	8.00%	04/01/2025	5,304	4,323,127	0.0
Digicel Group 0.5 Ltd.(a) .....	10.00%	04/01/2024	34,619	34,265,572	0.2
				<u>38,588,699</u>	<u>0.2</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Globo Comunicacao e Participacoes SA .....	4.88%	01/22/2030	6,730	6,992,891	0.0
				<u>58,456,125</u>	<u>0.3</u>
<b>VERSORGBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Terraform Global Operating LLC .....	6.13%	03/01/2026	2,777	2,861,938	0.0
				<u>61,318,063</u>	<u>0.3</u>
<b>ABS-ANLEIHEN</b>					
<b>SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS</b>					
<b>Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I</b>					
Series 2019-43, Class PT. ....	5.20%	11/15/2044	4,703	4,574,001	0.0
Series 2019-24, Class PT. ....	10.00%	08/15/2044	5,661	5,524,947	0.0
Series 2018-20, Class PT. ....	10.27%	11/16/2043	2,358	2,329,121	0.0
Series 2019-36, Class PT. ....	12.47%	10/17/2044	7,859	7,704,069	0.1
<b>Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I</b>					
Series 2018-12, Class PT. ....	9.59%	06/15/2043	1,634	1,600,499	0.0
Series 2018-4, Class PT. ....	10.34%	05/15/2043	979	960,601	0.0



	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust, Series 2018-3, Class PT. ....	10.55%	03/16/2043	USD 549 \$	535,210	0.0%
SoFi Consumer Loan Program LLC					
Series 2016-1, Class R(j) .....	0.00%	08/25/2025	6,909	1,332,746	0.0
Series 2017-2, Class R(j) .....	0.00%	02/25/2026	155	4,654,710	0.0
Series 2017-3, Class R(j) .....	0.00%	05/25/2026	159	6,245,303	0.1
Series 2017-5, Class R1(j) .....	0.00%	09/25/2026	225	4,829,824	0.0
Series 2016-5, Class R(j) .....	0.00%	09/25/2028	216	3,881,808	0.0
SoFi Consumer Loan Program Trust, Series 2018-1, Class R1(j) ..	0.00%	02/25/2027	355	12,058,955	0.1
				<u>56,231,794</u>	<u>0.3</u>
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class E(f) .....	7.50%	01/20/2034	2,000	2,000,054	0.0
Apidos CLO XXIII, Series 2015-23A, Class ER(f) .....	6.44%	04/15/2033	1,752	1,725,138	0.0
Bardot CLO Ltd., Series 2019-2A, Class C(f) .....	2.97%	10/22/2032	1,500	1,507,449	0.0
Goldentree Loan Management US CLO Ltd., Series 2020-7A, Class C(f) .....	3.77%	04/20/2031	6,500	6,512,974	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class ER(f) .....	6.37%	10/20/2030	7,000	6,746,796	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2018-29A, Class D(f) .....	3.32%	10/19/2031	3,000	3,002,070	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-33A, Class D(f) .....	4.03%	10/16/2032	1,875	1,887,236	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-33A, Class E(f) .....	7.03%	10/16/2032	1,500	1,505,592	0.0
Octagon Investment Partners 30 Ltd., Series 2017-1A, Class D(f)	6.42%	03/17/2030	1,000	975,457	0.0
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class E(f) .....	5.74%	04/15/2031	10,000	9,228,890	0.1
SCFF I Ltd., Series 2020-1A, Class A2B(f) .....	4.24%	04/15/2031	7,277	7,298,892	0.1
SCFF I Ltd., Series 2020-1A, Class B(f) .....	4.99%	04/15/2031	4,323	4,339,229	0.0
				<u>46,729,777</u>	<u>0.2</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG</b>					
<b>INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE</b>					
<b>KOLUMBIEN</b>					
Fideicomiso PA Costera(j) .....	6.25%	01/15/2034	COP 18,690,784	5,798,428	0.0
Fideicomiso PA Pacifico Tres .....	7.00%	01/15/2035	97,872,936	29,230,382	0.2
				<u>35,028,810</u>	<u>0.2</u>
<b>STAATSANLEIHEN</b>					
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>					
Dominican Republic International Bond .....	12.00%	01/20/2022	DOP 477,260	8,594,987	0.0
				<u>43,623,797</u>	<u>0.2</u>
<b>VORZUGSAKTIE</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Paysafe Holdings UK Ltd.(j) .....	0.00%		15,450,976	17,710,820	0.1
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
Exide International Holdings LP(j) .....	0.00%		21	16,601,957	0.1
				<u>34,312,777</u>	<u>0.2</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHEIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Lloyds Banking Group PLC(d) .....	6.00%	06/07/2032	GBP 4,459	5,871,155	0.0
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
AIG Life Holdings, Inc. ....	8.13%	03/15/2046	USD 1,472	2,156,200	0.0
				<u>8,027,355</u>	<u>0.0</u>
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Bellemeade Re Ltd., Series 2019-4A, Class B1(f) .....	3.97%	10/25/2029	6,083	5,839,123	0.0
Radnor Re Ltd., Series 2020-1, Class B1(f) .....	3.13%	02/25/2030	1,862	1,811,769	0.0
				<u>7,650,892</u>	<u>0.0</u>
<b>OPTIONSSCHEINE</b>					
Battalion Oil Corp., expiring 10/08/2022 (j) .....			7,289	0	0.0
SandRidge Energy, Inc., A-CW22, expiring 10/03/2022 (j) .....			94,880	2,847	0.0
SandRidge Energy, Inc., B-CW22, expiring 10/03/2022. ....			39,948	879	0.0
Willscot Corp., expiring 11/29/2022 (j) .....			500,414	6,514,139	0.0
				<u>6,517,865</u>	<u>0.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Ambac LSNI LLC(f) .....	6.00%	02/12/2023	USD 630	\$ 632,607	0.0%
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Digicel Group 0.5 Ltd.(a) (d) .....	7.00%	03/12/2021	1,212	796,760	0.0
				1,429,367	0.0
				647,039,426	3.0
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten \$20,742,774,372) .....				\$ 20,832,944,289	99.5%
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(l) .....	0.01 %	–		41,928	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(l) .....	0.00 %	–		1,319,612	0.0
Barclays, London(l) .....	0.00 %	–		268,695,039	1.3
BBH, Grand Cayman(l) .....	0.07 %	–		103,206	0.0
BNP Paribas, Paris(l) .....	(0.71)%	–		4,543,942	0.0
BNP Paribas, Paris(l) .....	2.80 %	–		16,477,386	0.1
National Australia Bank, London(l) .....	(0.06)%	–		166,458	0.0
Sumitomo, Tokyo(l) .....	0.00 %	–		1,377,973	0.0
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....				292,725,544	1.4
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....				(183,115,036)	(0.9)
<b>Nettovermögen</b> .....				\$ 20,942,554,797	100.0%

**TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
<b>Long</b>					
U.S. Long Bond (CBT) Futures .....	06/21/2021	421	\$ 67,613,281	\$ 67,031,093	\$ (582,188)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures .....	06/30/2021	1,945	243,189,008	241,119,219	(2,069,789)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures .....	06/21/2021	8,966	1,203,614,938	1,189,956,313	(13,658,625)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures .....	06/21/2021	836	158,652,648	158,056,250	(596,398)
					\$ (16,907,000)

**DEWISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd. ....	USD 90,757	IDR 1,275,288,032	04/15/2021	\$ (2,778,450)
Bank of America, NA. ....	USD 12,004	EUR 9,784	03/17/2021	(194,012)
Bank of America, NA. ....	USD 104,689	RUB 7,758,592	03/24/2021	(993,622)
Barclays Bank PLC .....	USD 483,077	BRL 2,625,521	03/02/2021	(14,584,874)
Barclays Bank PLC .....	BRL 2,625,521	USD 482,544	04/05/2021	14,663,045
Barclays Bank PLC .....	USD 35,428	IDR 498,262,273	04/15/2021	(1,054,487)
BNP Paribas SA .....	GBP 32,043	USD 43,660	04/09/2021	(993,200)
BNP Paribas SA .....	CAD 37,036	USD 29,180	04/22/2021	75,375
Brown Brothers Harriman & Co. ....	EUR 12,259	USD 14,963	03/17/2021	165,023
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 828,411	AUD 1,087,232	03/05/2021	8,164,648
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 966	CHF 867	03/05/2021	(11,674)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 1,708	EUR 1,413	03/05/2021	(3,040)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 157,087	EUR 130,578	03/05/2021	471,742
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 128,444	NZD 178,394	03/05/2021	456,535
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 368,010	ZAR 5,502,531	03/05/2021	(4,491,843)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 867,705	AUD 1,120,034	03/12/2021	(5,865,521)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 46,981	CAD 59,627	03/12/2021	(124,774)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 40,139	CNH 258,248	03/12/2021	(314,634)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 71,056	GBP 51,298	03/12/2021	415,583
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 117,317	SGD 155,609	03/12/2021	(622,043)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 586,000	ZAR 8,657,337	03/12/2021	(14,627,885)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 772,811	AUD 978,102	03/25/2021	(20,132,024)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 46,981	CAD 59,265	03/25/2021	(407,374)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 41,579	CNH 269,196	03/25/2021	(108,912)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 140,727	EUR 115,786	03/25/2021	(939,240)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 71,055	GBP 50,478	03/25/2021	(718,240)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 331	PLN 1,227	03/25/2021	(3,162)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 110,745	SGD 146,332	03/25/2021	(1,011,022)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 453,112	ZAR 6,670,235	03/25/2021	(13,812,892)



Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citibank, NA	BRL 1,264,837	USD 233,796	03/02/2021	\$ 8,101,636
Citibank, NA	EUR 132,838	USD 160,784	03/17/2021	446,874
Citibank, NA	USD 153,839	EUR 125,582	03/17/2021	(2,259,835)
Citibank, NA	COP 326,092,701	USD 94,331	03/18/2021	4,964,053
Citibank, NA	USD 33,054	COP 117,401,596	03/18/2021	(879,771)
Citibank, NA	USD 98,957	IDR 1,401,620,078	04/15/2021	(2,262,667)
Deutsche Bank AG	EUR 21,361	USD 26,002	03/17/2021	218,051
Deutsche Bank AG	INR 3,612,019	USD 48,571	04/15/2021	50,197
Goldman Sachs Bank USA	BRL 50,178	USD 9,304	03/02/2021	350,211
Goldman Sachs Bank USA	EUR 400,000	USD 485,926	03/17/2021	3,119,431
Goldman Sachs Bank USA	COP 513,750,000	USD 149,580	03/18/2021	8,785,217
HSBC Bank USA	BRL 1,264,837	USD 233,515	03/02/2021	7,821,072
HSBC Bank USA	IDR 3,000,000,000	USD 212,720	04/15/2021	5,759,108
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 16,942	COP 60,000,000	03/18/2021	(498,991)
JPMorgan Chase Bank, NA	IDR 98,000,000	USD 6,933	04/15/2021	172,399
Morgan Stanley & Co. LLC	BRL 45,670	USD 8,623	03/02/2021	473,429
Morgan Stanley & Co. LLC	EUR 9,450	USD 11,569	03/17/2021	162,140
Morgan Stanley & Co. LLC	USD 21,994	EUR 17,908	03/17/2021	(378,195)
Royal Bank of Scotland PLC	EUR 10,901	USD 13,154	03/17/2021	(3,872)
Royal Bank of Scotland PLC	COP 244,450,000	USD 70,771	03/18/2021	3,778,543
Standard Chartered Bank	IDR 2,164,142,676	USD 151,604	03/19/2021	1,520,216
Standard Chartered Bank	IDR 594,429,189	USD 42,064	04/15/2021	1,055,223
Standard Chartered Bank	USD 68,509	IDR 970,906,650	04/15/2021	(1,528,668)
State Street Bank & Trust Co.	EUR 7,976	USD 9,786	03/17/2021	157,930
UBS AG	EUR 227,567	USD 277,987	03/17/2021	3,310,155
UBS AG	RUB 6,681,405	USD 89,871	03/24/2021	572,017
UBS AG	ZAR 6,514,856	USD 429,780	04/08/2021	1,462,994
UBS AG	MXN 4,763,506	USD 230,547	04/16/2021	4,009,552
				\$ (10,902,525)
			Wertsteigerung	\$ 80,702,399
			Wertminderung	\$ (91,604,924)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

#### ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Kaufkontrakte</b>					
Citigroup Global Markets, Inc.	Republic of Turkey	06/20/2025	USD 21,859	\$ 1,797,263	\$ (1,491,345)
Morgan Stanley & Co. LLC	CDX-NAHY Series 33, 5 Year Index	12/20/2024	24,524	(2,147,275)	66,414
Morgan Stanley & Co. LLC	iTraxx-XOVER Series 27, 5 Year Index	06/20/2022	EUR 4	(213)	(57)
<b>Verkaufskontrakte</b>					
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-NAHY Series 33, 5 Year Index	12/20/2024	USD 77,590	6,793,664	1,482,139
Citigroup Global Markets, Inc.	Republic of Turkey	06/20/2025	21,859	(1,797,263)	1,885,001
Morgan Stanley & Co. LLC	CDX-NAHY Series 33, 5 Year Index	12/20/2024	154,327	13,512,597	7,297,684
Morgan Stanley & Co. LLC	CDX-NAHY Series 34, 5 Year Index	06/20/2025	537,942	44,871,120	43,717,211
Morgan Stanley & Co. LLC	CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	12/20/2025	2,317,313	192,111,041	111,834,307
Morgan Stanley & Co. LLC	CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	12/20/2025	5,922	490,949	(26,112)
Morgan Stanley & Co. LLC	CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	12/20/2025	20,045	1,661,781	(99,171)
Morgan Stanley & Co. LLC	Ford Motor Company	06/20/2023	6,370	495,825	928,443
Morgan Stanley & Co. LLC	iTraxx-XOVER Series 34, 5 Year Index	12/20/2025	EUR 831,597	104,488,743	33,898,551
Insgesamt				\$ 362,278,232	\$ 199,493,065
				Wertsteigerung	\$ 201,109,750
				Wertminderung	\$ (1,616,685)

#### CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Verkaufskontrakte</b>						
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 22,575	\$ (9,736,598)	\$ (11,087,663)	\$ 1,351,065
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	25,000	(10,782,500)	(5,503,879)	(5,278,621)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	10,000	(4,313,000)	85,150	(4,398,150)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,500	(1,078,250)	(321,394)	(756,856)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(76,732)	(2,079,768)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	10,000	(4,313,000)	(1,418,557)	(2,894,443)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(762,964)	(1,393,536)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	18,635	(8,037,276)	(2,957,512)	(5,079,764)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	11,972	(5,163,524)	(5,973,931)	810,407

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,200	\$ (296,640)	\$ (134,965)	\$ (161,675)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,259	(1,794,425)	(793,291)	(1,001,134)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,650	(407,880)	(228,343)	(179,537)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	214,242	(92,402,575)	(50,059,305)	(42,343,270)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	10,000	(4,313,000)	(2,230,927)	(2,082,073)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,562	(4,835,726)	(2,012,890)	(2,822,836)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	119,200	(29,466,240)	(11,461,807)	(18,004,433)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,600	(889,920)	(391,022)	(498,898)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,066	(1,499,515)	(691,625)	(807,890)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,000	(741,600)	(307,567)	(434,033)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,124	(1,019,453)	(445,266)	(574,187)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,000	(741,600)	(305,553)	(436,047)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,515	(1,947,320)	(2,214,627)	267,307
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,515	(1,947,320)	(2,214,627)	267,307
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	95,528	(41,201,226)	(19,201,571)	(21,999,655)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	10,000	(4,313,000)	(1,486,059)	(2,826,941)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,180,000)	(3,458,532)	(2,721,468)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	17,348	(4,288,426)	(1,820,573)	(2,467,853)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,491	(2,098,975)	(885,162)	(1,213,813)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,123	(524,806)	(222,920)	(301,886)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(504,044)	(731,956)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	87,751	(21,692,047)	(13,247,094)	(8,444,953)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(3,708,000)	(2,101,651)	(1,606,349)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	32	(7,910)	(4,428)	(3,482)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,439	(1,097,321)	(1,172,735)	75,414
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,878	(2,194,642)	(2,019,838)	(174,804)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,878	(2,194,642)	(2,019,838)	(174,804)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,439	(1,097,321)	(977,527)	(119,794)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	10,000	(4,313,000)	(1,418,557)	(2,894,443)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(709,278)	(1,447,222)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(3,708,000)	(2,073,359)	(1,634,641)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(691,120)	(544,880)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,494,042)	(977,958)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(3,708,000)	(2,246,065)	(1,461,935)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(526,994)	(709,006)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,862	(1,201,886)	(498,143)	(703,743)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	50,000	(12,360,000)	(7,070,569)	(5,289,431)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,397,663)	(1,074,337)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,000	(4,944,000)	(2,836,989)	(2,107,011)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,180,000)	(3,735,106)	(2,444,894)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,994	(3,016,512)	(2,911,063)	(105,449)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,993	(3,016,081)	(2,876,404)	(139,677)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,994	(3,016,512)	(3,168,727)	152,215
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,030	(3,894,639)	(4,334,974)	440,335
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,981	(3,442,205)	(2,909,862)	(532,343)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,994	(3,016,512)	(2,928,187)	(88,325)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,993	(3,016,080)	(2,893,525)	(122,555)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(464,173)	(1,692,327)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,991	(1,721,318)	(1,718,355)	(2,963)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,981	(3,442,205)	(2,929,204)	(513,001)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,180,000)	(3,361,389)	(2,818,611)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,300	(321,360)	(170,042)	(151,318)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,010	(4,699,272)	(1,942,302)	(2,756,970)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,365	(5,034,228)	(2,166,810)	(2,867,418)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	11,552	(2,855,654)	(1,168,857)	(1,686,797)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,386,582)	(1,085,418)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	22,195	(5,486,604)	(5,971,881)	485,277
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	22,195	(5,486,604)	(5,537,914)	51,310
Morgan Stanley & Co. LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	304,220	(131,210,086)	(58,177,634)	(73,032,452)
Morgan Stanley & Co. LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,048,158)	(1,423,842)
Morgan Stanley & Co. LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,206,794)	(1,265,206)
Morgan Stanley & Co. LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(645,779)	(590,221)
Insgesamt				<u>\$ (527,526,436)</u>	<u>\$ (285,247,770)</u>	<u>\$ (242,278,666)</u>
					Wertsteigerung	\$ 3,900,637
					Wertminderung	\$ (246,179,303)
Swaps insgesamt						<u>\$ (42,785,601)</u>

- (a) Zahlungen in Sachwerten (PIK).  
(b) Wandelbares Wertpapier.

- (c) Not leidend.
- (d) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (e) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 28. Februar 2021.
- (f) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2021.
- (g) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (h) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (i) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für offene OTC-Derivate zu dienen.
- (j) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (k) Notleidendes fälliges Wertpapier.
- (l) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	– Australian Dollar
BRL	– Brazilian Real
CAD	– Canadian Dollar
CHF	– Swiss Franc
CNH	– Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
COP	– Colombian Peso
DOP	– Dominican Peso
EGP	– Egyptian Pound
EUR	– Euro
GBP	– Great British Pound
IDR	– Indonesian Rupiah
INR	– Indian Rupee
MXN	– Mexican Peso
NZD	– New Zealand Dollar
PLN	– Polish Zloty
RUB	– Russian Ruble
SGD	– Singapore Dollar
TRY	– Turkish Lira
USD	– United States Dollar
ZAR	– South African Rand

Glossar:

ABS	– Asset-Backed Securities
CBT	– Chicago Board of Trade
CDX-CMBX.NA	– North American Commercial Mortgage-Backed Index
CDX-NAHY	– North American High Yield Credit Default Swap Index
CLO	– Collateralized Loan Obligations
CMBS	– Commercial Mortgage-Backed Securities
INTRCONX	– Inter-Continental Exchange
REIT	– Real Estate Investment Trust
REMICs	– Real Estate Mortgage Investment Conduits

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>					
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds(a)	1.13%	08/15/2040	USD 391,884	\$ 330,774,251	1.2%
U.S. Treasury Bonds	1.25%	05/15/2050	114,241	90,803,592	0.3
U.S. Treasury Bonds	5.25%	11/15/2028	73,000	94,375,312	0.4
U.S. Treasury Bonds	6.00%	02/15/2026	162,260	202,672,756	0.8
U.S. Treasury Bonds(a)	6.13%	11/15/2027	837,372	1,108,208,977	4.1
U.S. Treasury Bonds	6.13%	08/15/2029	934,728	1,296,935,516	4.8
U.S. Treasury Bonds(a)	6.25%	05/15/2030	893,144	1,271,753,564	4.7
U.S. Treasury Bonds	6.38%	08/15/2027	115,197	153,302,002	0.6
U.S. Treasury Bonds(a)	6.50%	11/15/2026	267,238	347,910,471	1.3
U.S. Treasury Bonds	6.75%	08/15/2026	635,560	831,292,651	3.1
U.S. Treasury Bonds	6.88%	08/15/2025	100,000	126,687,500	0.5
U.S. Treasury Bonds	7.50%	11/15/2024	129,580	162,622,900	0.6
U.S. Treasury Bonds	7.63%	02/15/2025	390,000	496,396,875	1.8
U.S. Treasury Notes(a)	0.50%	10/31/2027	40,819	39,180,248	0.1
U.S. Treasury Notes(a)	0.63%	08/15/2030	561,941	521,902,704	1.9
				<u>7,074,819,319</u>	<u>26.2</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
GRUNDSTOFFE					
Alcoa Nederland Holding BV	6.13%	05/15/2028	3,115	3,394,923	0.0
Axalta Coating Systems LLC/Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV	4.75%	06/15/2027	3,934	4,111,030	0.0
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	5,949	7,010,248	0.0
CF Industries, Inc.	5.15%	03/15/2034	367	443,467	0.0
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,821	18,520,068	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	2,879	3,097,397	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	9.88%	10/17/2025	31,914	37,366,941	0.2
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	11,573	12,726,053	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034	9,609	11,910,705	0.1
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027	4,299	4,769,896	0.0
Grinding Media, Inc./Moly-Cop AltaSteel Ltd.	7.38%	12/15/2023	3,392	3,454,430	0.0
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./ Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	29,713	31,044,760	0.1
Joseph T Ryerson & Son, Inc.	8.50%	08/01/2028	16,146	17,778,568	0.1
Kaiser Aluminum Corp.	6.50%	05/01/2025	3,939	4,213,760	0.0
Novelis Corp.	5.88%	09/30/2026	7,873	8,207,635	0.0
OCI NV	5.25%	11/01/2024	34,414	35,567,111	0.1
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	28,838	31,107,469	0.1
Peabody Energy Corp.(b)	8.50%	12/31/2024	6,073	3,583,070	0.0
PIC AU Holdings LLC/PIC AU Holdings Corp.	10.00%	12/31/2024	6,034	5,370,260	0.0
SPCM SA	4.88%	09/15/2025	7,338	7,558,748	0.0
United States Steel Corp.	12.00%	06/01/2025	36,251	43,432,905	0.2
WR Grace & Co.-Conn	4.88%	06/15/2027	8,802	9,123,784	0.0
				<u>303,793,228</u>	<u>1.1</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.13%	08/15/2026	5,000	5,171,979	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	04/30/2025	7,709	8,123,359	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	6.00%	02/15/2025	826	853,836	0.0
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	6,001	6,523,458	0.0
Colfax Corp.	6.00%	02/15/2024	1,903	1,965,251	0.0
Colfax Corp.	6.38%	02/15/2026	3,639	3,889,558	0.0
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	36,252	38,065,377	0.2
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	9,455	9,632,473	0.0
Mauser Packaging Solutions Holding Co.	5.50%	04/15/2024	11,024	11,065,313	0.1
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	7,000	7,192,386	0.0
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	19,218	547,661	0.0
Signature Aviation US Holdings, Inc.	5.38%	05/01/2026	9,605	9,833,987	0.0
SPX FLOW, Inc.	5.88%	08/15/2026	1,900	1,977,474	0.0
Stevens Holding Co., Inc.	6.13%	10/01/2026	4,933	5,341,883	0.0
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	5.25%	01/15/2029	3,584	3,803,080	0.0
Terex Corp.	5.63%	02/01/2025	23,003	23,605,211	0.1
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024	13,414	13,443,223	0.1
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	11,119	12,369,605	0.1
Vertical US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	30,725	32,033,423	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	12,456	13,484,537	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	9,211	10,233,008	0.0
				<u>219,156,082</u>	<u>0.8</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	USD 37,082	\$ 38,001,320	0.2%
Altice Financing SA	5.00%	01/15/2028	27,955	27,979,957	0.1
Altice Financing SA	7.50%	05/15/2026	22,087	23,062,621	0.1
Altice France SA/France	7.38%	05/01/2026	21,469	22,411,350	0.1
Banjay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	8,926	9,097,458	0.0
Belo Corp.	7.75%	06/01/2027	2,604	3,027,495	0.0
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	14,724	14,972,668	0.1
CSC Holdings LLC	5.50%	05/15/2026	7,730	7,994,434	0.0
CSC Holdings LLC	5.75%	01/15/2030	14,354	15,322,895	0.1
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	357	374,095	0.0
DISH DBS Corp.	7.75%	07/01/2026	5,157	5,675,221	0.0
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	13,897	14,247,577	0.1
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029	6,462	6,805,380	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	60,417	63,982,509	0.2
Liberty Interactive LLC	8.25%	02/01/2030	2,000	2,311,463	0.0
Meredith Corp.	6.88%	02/01/2026	13,464	13,736,336	0.1
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	14,789	13,621,748	0.1
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp.	5.00%	08/15/2027	5,667	5,761,070	0.0
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	22,785	22,872,838	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	5.38%	07/15/2026	1,182	1,224,583	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	22,137	24,042,725	0.1
TEGNA, Inc.	4.75%	03/15/2026	8,620	9,183,235	0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029	35,710	37,231,001	0.1
Univision Communications, Inc.	5.13%	02/15/2025	549	549,523	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	27,939	29,334,232	0.1
Univision Communications, Inc.	9.50%	05/01/2025	5,276	5,750,967	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	7,446	7,594,743	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	08/15/2026	12,500	13,002,773	0.1
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	2,294	2,410,113	0.0
Ziggo BV	4.88%	01/15/2030	21,689	22,686,229	0.1
Ziggo BV	5.50%	01/15/2027	8,072	8,410,602	0.0
				472,679,161	1.8
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Altice France SA/France	8.13%	02/01/2027	974	1,062,891	0.0
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	21,849	23,391,998	0.1
C&W Senior Financing DAC	7.50%	10/15/2026	3,816	4,052,510	0.0
CenturyLink, Inc., Series Y	7.50%	04/01/2024	17,638	19,790,307	0.1
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	36,907	38,198,745	0.1
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	32,651	35,002,067	0.1
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	13,505	16,099,327	0.1
Level 3 Financing, Inc.	5.25%	03/15/2026	4,000	4,114,787	0.0
Nexstar Broadcasting, Inc.	5.63%	07/15/2027	5,593	5,907,341	0.0
T-Mobile USA, Inc.	6.50%	01/15/2026	2,000	2,067,749	0.0
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	9,850	12,624,616	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	8,678	11,647,035	0.0
				173,959,373	0.6
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
Adient US LLC	9.00%	04/15/2025	24,423	27,090,146	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	04/01/2025	3,583	3,691,111	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	20,726	21,639,913	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	15,758	16,740,551	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	27,202	28,936,038	0.1
Dana Financing Luxembourg SARL	6.50%	06/01/2026	812	848,018	0.0
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	13,089	13,728,070	0.1
Dana, Inc.	5.50%	12/15/2024	500	510,494	0.0
Dana, Inc.	5.63%	06/15/2028	4,704	5,006,299	0.0
Ford Motor Co.	6.63%	10/01/2028	5,800	6,821,643	0.0
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023	74,190	82,991,037	0.3
Ford Motor Co.	9.00%	04/22/2025	20,702	25,131,215	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(b)	4.75%	09/15/2026	1,500	1,552,397	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(b)	6.00%	05/15/2027	23,494	24,881,799	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(b)	6.38%	05/15/2029	12,577	13,759,633	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	31,879	32,711,794	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	7.75%	10/15/2025	34,461	37,303,601	0.1
Meritor, Inc.	6.25%	02/15/2024	403	408,466	0.0
Meritor, Inc.	6.25%	06/01/2025	10,388	11,079,279	0.0
Tenneco, Inc.	7.88%	01/15/2029	8,241	9,235,858	0.0
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025	22,275	24,053,846	0.1
				388,121,208	1.4
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG</b>					
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	24,848	25,096,480	0.1
Carnival Corp.	7.63%	03/01/2026	3,244	3,402,145	0.0
Carnival Corp.	11.50%	04/01/2023	59,923	68,291,865	0.3



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op. ....	5.50%	05/01/2025	USD 54,796	\$ 57,469,858	0.2%
Mattel, Inc. ....	5.88%	12/15/2027	2,131	2,319,985	0.0
Mattel, Inc. ....	6.75%	12/31/2025	13,003	13,665,508	0.1
National CineMedia LLC ....	5.75%	08/15/2026	8,693	7,477,271	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd. ....	10.88%	06/01/2023	31,966	36,161,857	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd. ....	11.50%	06/01/2025	57,650	67,306,375	0.3
Silversea Cruise Finance Ltd. ....	7.25%	02/01/2025	10,951	11,321,628	0.1
Six Flags Theme Parks, Inc. ....	7.00%	07/01/2025	10,297	11,088,616	0.0
Vail Resorts, Inc. ....	6.25%	05/15/2025	8,044	8,587,375	0.0
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd. ....	5.63%	02/15/2029	8,267	8,351,215	0.0
VOC Escrow Ltd. ....	5.00%	02/15/2028	23,181	22,872,533	0.1
				<u>343,412,711</u>	<u>1.3</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Adams Homes, Inc. ....	7.50%	02/15/2025	14,225	14,904,559	0.1
Beazer Homes USA, Inc. ....	5.88%	10/15/2027	8,752	9,127,939	0.0
Beazer Homes USA, Inc. ....	6.75%	03/15/2025	500	515,499	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US Corp. ....	4.88%	02/15/2030	28,915	29,263,923	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US Corp. ....	6.25%	09/15/2027	49,014	51,745,892	0.2
Caesars Entertainment, Inc. ....	6.25%	07/01/2025	30,496	32,295,521	0.1
Empire Communities Corp. ....	7.00%	12/15/2025	8,518	8,957,058	0.0
Forestar Group, Inc. ....	5.00%	03/01/2028	10,363	10,862,682	0.0
Forestar Group, Inc. ....	8.00%	04/15/2024	19,301	20,186,910	0.1
Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp. ....	6.50%	07/15/2025	8,322	8,977,095	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc. ....	5.38%	05/01/2025	5,635	5,923,659	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc. ....	5.75%	05/01/2028	6,163	6,676,306	0.0
Installed Building Products, Inc. ....	5.75%	02/01/2028	5,196	5,540,618	0.0
International Game Technology PLC ....	5.25%	01/15/2029	13,337	14,178,062	0.1
International Game Technology PLC ....	6.25%	01/15/2027	37,757	42,767,882	0.2
International Game Technology PLC ....	6.50%	02/15/2025	3,600	3,968,953	0.0
KB Home ....	4.80%	11/15/2029	7,465	8,044,871	0.0
KB Home ....	6.88%	06/15/2027	7,102	8,365,798	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc. ....	4.75%	01/15/2028	20,000	20,188,101	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc. ....	6.13%	09/15/2025	6,068	6,462,669	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC ....	6.50%	09/15/2026	37,900	39,338,051	0.2
Mattamy Group Corp. ....	4.63%	03/01/2030	11,000	11,429,217	0.0
Mattamy Group Corp. ....	5.25%	12/15/2027	34,824	36,638,394	0.1
Meritage Homes Corp. ....	5.13%	06/06/2027	1,000	1,118,602	0.0
Meritage Homes Corp. ....	7.00%	04/01/2022	5,816	6,137,883	0.0
MGM Resorts International ....	6.00%	03/15/2023	3,892	4,149,403	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp. ....	4.75%	02/15/2028	19,163	19,825,683	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc. ....	5.75%	01/15/2028	9,959	11,106,264	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc. ....	5.88%	06/15/2027	17,629	19,806,901	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc./ Taylor Morrison Holdings II, Inc. ....	5.63%	03/01/2024	338	365,735	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc./ Taylor Morrison Holdings II, Inc. ....	5.88%	04/15/2023	21,565	23,020,638	0.1
Travel + Leisure Co. ....	6.63%	07/31/2026	13,210	14,906,331	0.1
Wyndham Hotels & Resorts, Inc. ....	5.38%	04/15/2026	6,193	6,353,856	0.0
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp. ....	5.50%	03/01/2025	15,291	16,210,199	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp. ....	5.13%	10/01/2029	15,465	16,278,480	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp. ....	7.75%	04/15/2025	14,262	15,464,697	0.1
				<u>551,104,331</u>	<u>2.0</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS</b>					
Yum! Brands, Inc. ....	4.75%	01/15/2030	67	70,040	0.0
Yum! Brands, Inc. ....	7.75%	04/01/2025	11,003	12,050,498	0.0
				<u>12,120,538</u>	<u>0.0</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
Burlington Coat Factory Warehouse Corp. ....	6.25%	04/15/2025	3,459	3,676,852	0.0
FirstCash, Inc. ....	4.63%	09/01/2028	767	796,620	0.0
L Brands, Inc. ....	5.25%	02/01/2028	5,737	6,136,973	0.0
L Brands, Inc. ....	6.63%	10/01/2030	6,017	6,775,920	0.0
L Brands, Inc. ....	6.75%	07/01/2036	25,820	31,041,475	0.1
L Brands, Inc. ....	6.88%	07/01/2025	6,265	6,846,633	0.0
L Brands, Inc. ....	6.88%	11/01/2035	21,725	26,243,407	0.1
L Brands, Inc. ....	6.95%	03/01/2033	329	364,611	0.0
L Brands, Inc. ....	7.50%	06/15/2029	7,154	8,082,760	0.0
L Brands, Inc. ....	7.60%	07/15/2037	716	834,454	0.0
Murphy Oil USA, Inc. ....	4.75%	09/15/2029	11,452	12,209,144	0.1
Murphy Oil USA, Inc. ....	5.63%	05/01/2027	661	697,571	0.0
Penske Automotive Group, Inc. ....	5.50%	05/15/2026	4,586	4,732,394	0.0
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp. ....	4.75%	02/15/2028	39,680	41,068,158	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp. . . . .	6.38%	09/30/2026	USD 25,205	\$ 26,090,809	0.1%
Staples, Inc. . . . .	7.50%	04/15/2026	24,937	24,992,410	0.1
William Carter Co. (The) . . . . .	5.50%	05/15/2025	10,330	10,911,779	0.1
				211,501,970	0.8
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
AdaptHealth LLC . . . . .	6.13%	08/01/2028	7,613	8,082,265	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC . . . . .	4.88%	02/15/2030	17,673	18,244,362	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC . . . . .	5.75%	03/15/2025	2,786	2,870,396	0.0
Bausch Health Americas, Inc. . . . .	8.50%	01/31/2027	5,505	6,100,424	0.0
Bausch Health Cos., Inc. . . . .	6.25%	02/15/2029	17,487	18,619,908	0.1
Bausch Health Cos., Inc. . . . .	9.00%	12/15/2025	271	295,326	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc. . . . .	6.75%	07/15/2025	1,977	2,118,801	0.0
Chobani LLC/Chobani Finance Corp., Inc. . . . .	4.63%	11/15/2028	18,334	18,923,684	0.1
Emergent BioSolutions, Inc. . . . .	3.88%	08/15/2028	1,537	1,561,001	0.0
Hill-Rom Holdings, Inc. . . . .	4.38%	09/15/2027	3,056	3,172,129	0.0
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc. . . . .	5.00%	12/31/2026	33,210	34,180,304	0.1
Legacy LifePoint Health LLC . . . . .	6.75%	04/15/2025	64,710	68,669,702	0.3
MEDNAX, Inc. . . . .	6.25%	01/15/2027	16,419	17,342,770	0.1
ModivCare, Inc. . . . .	5.88%	11/15/2025	5,134	5,441,622	0.0
Par Pharmaceutical, Inc. . . . .	7.50%	04/01/2027	16,641	17,880,543	0.1
Post Holdings, Inc. . . . .	4.50%	09/15/2031	10,368	10,355,373	0.1
Post Holdings, Inc. . . . .	5.00%	08/15/2026	6,844	7,144,988	0.0
Post Holdings, Inc. . . . .	5.50%	12/15/2029	6,547	7,007,800	0.0
Post Holdings, Inc. . . . .	5.63%	01/15/2028	7,135	7,493,692	0.0
RP Escrow Issuer LLC . . . . .	5.25%	12/15/2025	24,848	25,709,839	0.1
Spectrum Brands, Inc. . . . .	6.13%	12/15/2024	1,912	1,957,915	0.0
Tenet Healthcare Corp. . . . .	4.88%	01/01/2026	87	90,079	0.0
Tenet Healthcare Corp. . . . .	7.50%	04/01/2025	20,067	21,812,173	0.1
US Acute Care Solutions LLC . . . . .	6.38%	03/01/2026	4,781	4,883,194	0.0
				309,958,290	1.2
<b>ENERGIE</b>					
Apache Corp. . . . .	4.63%	11/15/2025	2,602	2,694,861	0.0
Apache Corp. . . . .	4.88%	11/15/2027	6,576	6,905,823	0.0
Berry Petroleum Co. LLC . . . . .	7.00%	02/15/2026	6,480	6,233,471	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp. . . . .	7.63%	12/15/2025	12,558	13,506,680	0.1
Callon Petroleum, Co. . . . .	6.25%	04/15/2023	2,946	2,739,192	0.0
Cheniere Energy Partners LP . . . . .	4.50%	10/01/2029	6,266	6,571,604	0.0
Cheniere Energy Partners LP . . . . .	5.63%	10/01/2026	15,850	16,484,478	0.1
CITGO Petroleum Corp. . . . .	6.25%	08/15/2022	41,604	41,620,478	0.2
CITGO Petroleum Corp. . . . .	6.38%	06/15/2026	13,237	13,436,674	0.1
CITGO Petroleum Corp. . . . .	7.00%	06/15/2025	45,862	47,174,076	0.2
CNX Resources Corp. . . . .	6.00%	01/15/2029	20,821	21,803,776	0.1
EnLink Midstream LLC . . . . .	5.63%	01/15/2028	31,228	31,475,485	0.1
EnLink Midstream Partners LP . . . . .	4.40%	04/01/2024	804	808,888	0.0
EnLink Midstream Partners LP . . . . .	5.05%	04/01/2045	4,129	3,298,590	0.0
EnLink Midstream Partners LP . . . . .	5.45%	06/01/2047	3,365	2,780,352	0.0
EnLink Midstream Partners LP . . . . .	5.60%	04/01/2044	1,916	1,593,322	0.0
EQM Midstream Partners LP . . . . .	4.50%	01/15/2029	21,253	20,620,616	0.1
EQM Midstream Partners LP . . . . .	4.75%	01/15/2031	21,247	20,457,275	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. . . . .	6.25%	05/15/2026	5,083	4,856,989	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. . . . .	6.50%	10/01/2025	3,830	3,712,559	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. . . . .	7.75%	02/01/2028	40,175	39,684,258	0.2
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. . . . .	8.00%	01/15/2027	32,532	32,878,647	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp. . . . .	6.88%	01/15/2029	11,607	12,555,873	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp. . . . .	7.00%	08/01/2027	9,655	10,237,621	0.0
Gulfport Energy Corp.(c) . . . . .	6.00%	10/15/2024	5,620	5,155,290	0.0
Gulfport Energy Corp.(c) . . . . .	6.38%	05/15/2025	9,243	8,499,554	0.0
Gulfport Energy Corp.(c) . . . . .	6.38%	01/15/2026	7,135	6,541,176	0.0
Hess Midstream Operations LP . . . . .	5.63%	02/15/2026	8,201	8,489,885	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co. . . . .	5.75%	02/01/2029	10,533	10,745,746	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co. . . . .	6.00%	02/01/2031	10,533	10,707,928	0.0
Indigo Natural Resources LLC . . . . .	5.38%	02/01/2029	9,767	9,752,161	0.0
Ithaca Energy North Sea PLC . . . . .	9.38%	07/15/2024	2,000	2,049,270	0.0
Nabors Industries Ltd. . . . .	7.25%	01/15/2026	12,604	11,194,704	0.1
Nabors Industries Ltd. . . . .	7.50%	01/15/2028	12,402	10,704,671	0.0
Neptune Energy Bondco PLC . . . . .	6.63%	05/15/2025	3,286	3,314,729	0.0
New Fortress Energy, Inc. . . . .	6.75%	09/15/2025	48,364	50,157,679	0.2
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp. . . . .	7.50%	02/01/2026	71,875	74,115,976	0.3
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp. . . . .	7.50%	11/01/2023	2,382	2,286,556	0.0
Occidental Petroleum Corp. . . . .	2.70%	02/15/2023	6,792	6,638,632	0.0
Occidental Petroleum Corp. . . . .	2.90%	08/15/2024	13,626	13,248,315	0.1
Occidental Petroleum Corp. . . . .	3.40%	04/15/2026	3,253	3,155,088	0.0



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Occidental Petroleum Corp.....	3.50%	06/15/2025	USD 17,408	\$ 17,115,886	0.1%
Occidental Petroleum Corp.....	5.50%	12/01/2025	3,231	3,430,181	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	5.55%	03/15/2026	1,500	1,610,853	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	5.88%	09/01/2025	6,779	7,352,988	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	6.13%	01/01/2031	9,758	10,816,322	0.1
Occidental Petroleum Corp.....	8.00%	07/15/2025	10,610	12,317,620	0.1
Occidental Petroleum Corp.....	8.50%	07/15/2027	6,994	8,373,776	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	8.88%	07/15/2030	6,994	8,944,771	0.0
Parkland Corp./Canada .....	6.00%	04/01/2026	12,341	12,906,305	0.1
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.....	9.25%	05/15/2025	37,364	36,424,563	0.1
PDC Energy, Inc. ....	5.75%	05/15/2026	11,395	11,679,478	0.1
PDC Energy, Inc. ....	6.13%	09/15/2024	6,833	6,979,751	0.0
QEP Resources, Inc.....	5.25%	05/01/2023	4,448	4,714,975	0.0
QEP Resources, Inc.....	5.38%	10/01/2022	7,426	7,744,824	0.0
Range Resources Corp. ....	5.00%	03/15/2023	1,794	1,803,628	0.0
SM Energy Co.....	5.63%	06/01/2025	2,375	2,266,726	0.0
SM Energy Co.....	6.75%	09/15/2026	8,783	8,322,888	0.0
SM Energy Co.....	10.00%	01/15/2025	24,179	27,207,129	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.....	5.88%	03/15/2028	5,701	6,049,339	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.....	6.00%	04/15/2027	5,165	5,379,695	0.0
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp. ....	6.50%	07/15/2027	16,917	18,233,064	0.1
Transocean Phoenix 2 Ltd.....	7.75%	10/15/2024	6,179	6,126,527	0.0
Transocean Poseidon Ltd. ....	6.88%	02/01/2027	8,159	7,657,655	0.0
Transocean Sentry Ltd. ....	5.38%	05/15/2023	24,165	23,095,468	0.1
Western Midstream Operating LP .....	3.95%	06/01/2025	29,604	30,035,002	0.1
Western Midstream Operating LP .....	4.50%	03/01/2028	4,159	4,300,883	0.0
Western Midstream Operating LP .....	4.65%	07/01/2026	20,047	20,756,727	0.1
Western Midstream Operating LP .....	4.75%	08/15/2028	7,998	8,393,068	0.0
Western Midstream Operating LP .....	5.30%	02/01/2030	5,726	6,206,115	0.0
				<u>927,135,155</u>	<u>3.4</u>
<b>SONSTIGE INDUSTRIEWERTE</b>					
Avient Corp.....	5.75%	05/15/2025	8,238	8,724,572	0.1
Interface, Inc. ....	5.50%	12/01/2028	6,810	7,145,236	0.0
				<u>15,869,808</u>	<u>0.1</u>
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp. ....	6.63%	07/15/2026	41,102	43,491,320	0.2
APX Group, Inc. ....	6.75%	02/15/2027	14,450	15,309,145	0.1
APX Group, Inc. ....	7.88%	12/01/2022	17,953	18,013,314	0.1
Aramark Services, Inc.....	5.00%	04/01/2025	7,779	7,975,743	0.0
Aramark Services, Inc.....	5.00%	02/01/2028	750	770,969	0.0
Aramark Services, Inc.....	6.38%	05/01/2025	16,856	17,777,928	0.1
Cars.com, Inc. ....	6.38%	11/01/2028	14,634	15,386,209	0.1
Gartner, Inc. ....	4.50%	07/01/2028	2,768	2,908,062	0.0
MPH Acquisition Holdings LLC .....	5.75%	11/01/2028	34,084	33,834,338	0.1
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.....	5.63%	10/01/2028	10,002	10,554,427	0.0
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.....	5.88%	10/01/2030	7,599	8,214,966	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc. ....	3.38%	08/31/2027	4,358	4,247,092	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc. ....	5.25%	04/15/2024	11,896	12,715,956	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc. ....	5.75%	04/15/2026	12,000	12,933,788	0.1
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.....	5.38%	01/15/2025	1,575	1,622,473	0.0
Sabre GBLB, Inc.....	7.38%	09/01/2025	2,660	2,876,314	0.0
Sabre GBLB, Inc.....	9.25%	04/15/2025	17,308	20,607,124	0.1
TripAdvisor, Inc. ....	7.00%	07/15/2025	10,576	11,406,170	0.0
				<u>240,645,338</u>	<u>0.9</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Avaya, Inc. ....	6.13%	09/15/2028	40,340	43,411,684	0.2
Boxer Parent Co., Inc. ....	7.13%	10/02/2025	9,123	9,861,479	0.1
CommScope, Inc.....	6.00%	03/01/2026	4,210	4,425,647	0.0
LogMeIn, Inc. ....	5.50%	09/01/2027	5,670	5,926,052	0.0
NCR Corp.....	5.75%	09/01/2027	10,151	10,613,447	0.1
NCR Corp.....	6.13%	09/01/2029	7,437	7,974,980	0.0
NCR Corp.....	8.13%	04/15/2025	8,551	9,342,752	0.0
Science Applications International Corp. ....	4.88%	04/01/2028	1,671	1,748,208	0.0
Seagate HDD Cayman .....	4.09%	06/01/2029	8,300	8,624,875	0.0
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.....	7.50%	09/01/2025	76,800	79,495,235	0.3
				<u>181,424,359</u>	<u>0.7</u>
<b>TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN</b>					
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd. ....	5.75%	01/20/2026	14,186	14,957,683	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.....	8.00%	09/20/2025	52,757	59,434,051	0.2
				<u>74,391,734</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc. ....	5.38%	03/01/2029	USD 9,641	\$ 9,833,088	0.0%
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc. ....	10.50%	05/15/2025	15,928	19,068,943	0.1
Herc Holdings, Inc. ....	5.50%	07/15/2027	14,745	15,558,768	0.0
Modulaire Global Finance PLC.....	8.00%	02/15/2023	21,470	21,900,032	0.1
United Rentals North America, Inc.....	4.88%	01/15/2028	293	310,404	0.0
XPO Logistics, Inc. ....	6.75%	08/15/2024	21,129	22,314,000	0.1
				<u>88,985,235</u>	<u>0.3</u>
				<u>4,514,258,521</u>	<u>16.7</u>
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Alliance Data Systems Corp.....	4.75%	12/15/2024	33,539	34,364,391	0.1
Alliance Data Systems Corp.....	7.00%	01/15/2026	15,902	16,816,365	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(d).....	6.50%	03/05/2025	48,200	52,053,671	0.2
Banco Santander SA(d) .....	7.50%	02/08/2024	20,400	22,367,281	0.1
Citizens Financial Group, Inc., Series A(d) (e) .....	4.20%	04/06/2021	887	887,101	0.0
Credit Suisse Group AG(d) .....	6.25%	12/18/2024	45,694	50,263,400	0.2
Credit Suisse Group AG(d) .....	7.50%	07/17/2023	32,959	35,902,015	0.1
Credit Suisse Group AG(d) .....	7.50%	12/11/2023	27,004	29,951,274	0.1
Dresdner Funding Trust I.....	8.15%	06/30/2031	11,620	16,650,319	0.1
Intesa Sanpaolo SpA .....	5.02%	06/26/2024	29,505	32,094,818	0.1
Intesa Sanpaolo SpA .....	5.71%	01/15/2026	3,000	3,367,199	0.0
Societe Generale SA(d) .....	7.88%	12/18/2023	9,332	10,339,850	0.0
Societe Generale SA(d) .....	8.00%	09/29/2025	16,232	19,031,767	0.1
				<u>324,089,451</u>	<u>1.2</u>
<b>MAKLER</b>					
NFP Corp. ....	7.00%	05/15/2025	12,792	13,724,643	0.1
<b>FINANZEN</b>					
goeasy Ltd.....	5.38%	12/01/2024	21,183	21,948,936	0.1
Navient Corp.....	6.50%	06/15/2022	16,842	17,476,363	0.1
Navient Corp.....	6.63%	07/26/2021	3,354	3,405,698	0.0
Navient Corp.....	7.25%	01/25/2022	10,891	11,314,082	0.0
				<u>54,145,079</u>	<u>0.2</u>
<b>REITS</b>					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL .....	5.75%	05/15/2026	57,055	58,719,032	0.1
Diversified Healthcare Trust .....	6.75%	12/15/2021	16,681	16,915,665	0.1
Diversified Healthcare Trust .....	9.75%	06/15/2025	27,934	31,440,659	0.1
Iron Mountain, Inc. ....	4.88%	09/15/2029	15,460	15,777,094	0.1
Iron Mountain, Inc. ....	5.00%	07/15/2028	10,020	10,386,686	0.0
Iron Mountain, Inc. ....	5.25%	03/15/2028	15,339	16,030,743	0.1
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc. ....	5.63%	05/01/2024	1,235	1,333,681	0.0
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc. ....	5.75%	02/01/2027	21,477	24,265,799	0.1
				<u>174,869,359</u>	<u>0.6</u>
				<u>566,828,532</u>	<u>2.1</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Calpine Corp.....	5.13%	03/15/2028	25,246	25,462,562	0.1
Calpine Corp.....	5.25%	06/01/2026	3,853	3,962,951	0.0
Talen Energy Supply LLC .....	6.50%	06/01/2025	2,406	2,110,632	0.0
Talen Energy Supply LLC .....	7.25%	05/15/2027	62,448	65,967,248	0.3
Terraform Global Operating LLC .....	6.13%	03/01/2026	7,871	8,111,745	0.0
Vistra Operations Co. LLC .....	5.63%	02/15/2027	24,023	25,203,286	0.1
				<u>130,818,424</u>	<u>0.5</u>
				<u>5,211,905,477</u>	<u>19.3</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
AIB Group PLC .....	4.26%	04/10/2025	45,541	49,732,939	0.1
AIB Group PLC .....	4.75%	10/12/2023	26,916	29,567,537	0.1
Ally Financial, Inc. ....	3.88%	05/21/2024	13,322	14,486,364	0.1
Ally Financial, Inc. ....	5.80%	05/01/2025	8,159	9,550,531	0.0
Ally Financial, Inc. ....	8.00%	11/01/2031	11,107	15,749,732	0.0
American Express Co., Series C(d) (e) .....	3.50%	06/15/2021	2,849	2,830,813	0.0
AmSouth Bancorp .....	6.75%	11/01/2025	11,929	14,580,171	0.1
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.....	4.40%	05/19/2026	11,780	13,297,792	0.0
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.....	4.50%	03/19/2024	18,269	20,062,603	0.1
Australia & New Zealand Banking Group Ltd./ United Kingdom(d) .....	6.75%	06/15/2026	43,923	51,413,985	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Banco Santander SA	5.18%	11/19/2025	USD 74,800	\$ 86,203,385	0.3%
Bank of America Corp., Series X(d)	6.25%	09/05/2024	15,203	16,658,583	0.1
Bank of America Corp., Series Z(d)	6.50%	10/23/2024	14,620	16,254,875	0.1
Bank of America Corp., Series B	8.05%	06/15/2027	34,006	44,611,530	0.2
Bank of Ireland Group PLC	4.50%	11/25/2023	25,505	27,913,356	0.1
Bank of New York Mellon Corp. (The), Series E(d) (e)	3.66%	06/20/2021	3,374	3,368,661	0.0
Barclays Bank PLC	7.63%	11/21/2022	8,608	9,529,468	0.0
Barclays Bank PLC	10.18%	06/12/2021	21,076	21,617,446	0.1
BBVA USA	5.90%	04/01/2026	7,500	8,683,730	0.0
BNP Paribas SA	4.63%	03/13/2027	13,920	15,909,180	0.1
BNP Paribas SA(d)	6.75%	03/14/2022	25,631	26,543,773	0.1
BNP Paribas SA(d)	7.63%	03/30/2021	34,234	34,323,278	0.1
BPCE SA	4.63%	07/11/2024	20,050	22,306,417	0.1
BPCE SA	5.15%	07/21/2024	28,583	32,268,904	0.1
BPCE SA	5.70%	10/22/2023	50,404	56,577,977	0.2
Capital One Financial Corp.	3.75%	03/09/2027	19,128	21,368,266	0.1
CIT Bank NA	2.97%	09/27/2025	2,736	2,917,727	0.0
Citigroup, Inc.	3.11%	04/08/2026	30,734	32,997,612	0.1
Citigroup, Inc.(d)	3.88%	02/18/2026	24,915	24,801,191	0.1
Citigroup, Inc., Series W(d)	4.00%	12/10/2025	16,145	16,191,243	0.1
Citigroup, Inc., Series Q(d) (e)	4.29%	05/15/2021	3,706	3,693,004	0.0
Citigroup, Inc., Series V(d)	4.70%	01/30/2025	9,977	10,099,498	0.0
Citigroup, Inc., Series U(d)	5.00%	09/12/2024	26,500	27,250,903	0.1
Citigroup, Inc.	5.50%	09/13/2025	13,703	16,148,791	0.1
Citigroup, Inc.(d)	5.95%	01/30/2023	14,902	15,459,156	0.1
Citigroup, Inc., Series P(d)	5.95%	05/15/2025	10,465	11,373,325	0.0
Commerzbank AG	8.13%	09/19/2023	12,284	14,173,952	0.0
Commonwealth Bank of Australia	4.50%	12/09/2025	28,018	31,686,727	0.1
Cooperatieve Rabobank UA	3.75%	07/21/2026	26,078	28,847,466	0.1
Cooperatieve Rabobank UA	4.63%	12/01/2023	14,004	15,505,479	0.1
Credit Agricole SA	4.38%	03/17/2025	4,798	5,309,195	0.0
Credit Agricole SA(d)	8.13%	12/23/2025	41,187	50,078,078	0.2
Credit Suisse Group AG	4.55%	04/17/2026	510	585,111	0.0
Danske Bank A/S	5.00%	01/12/2022	2,692	2,791,963	0.0
Danske Bank A/S	5.38%	01/12/2024	46,478	52,111,198	0.1
Discover Bank	3.45%	07/27/2026	21,166	23,234,785	0.1
Discover Bank	4.25%	03/13/2026	2,575	2,916,013	0.0
Discover Bank	4.68%	08/09/2028	42,248	45,129,380	0.2
Discover Financial Services	4.10%	02/09/2027	2,455	2,765,537	0.0
DNB Bank ASA(d)	6.50%	03/26/2022	63,959	66,523,340	0.2
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	4.25%	10/21/2025	1,500	1,683,400	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(d)	5.00%	11/10/2022	15,687	15,693,001	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(d)	5.30%	11/10/2026	1,910	2,111,187	0.0
HSBC Holdings PLC(d)	6.38%	03/30/2025	10,483	11,485,228	0.0
HSBC Holdings PLC(d)	6.50%	03/23/2028	17,335	19,361,128	0.1
HSBC Holdings PLC(d)	6.88%	06/01/2021	36,245	36,758,708	0.1
ING Groep NV	4.63%	01/06/2026	5,000	5,745,146	0.0
ING Groep NV(d)	6.75%	04/16/2024	31,733	34,769,017	0.1
ING Groep NV(d)	6.88%	04/16/2022	3,000	3,125,233	0.0
Intesa Sanpaolo SpA	3.13%	07/14/2022	15,957	16,452,927	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	3.38%	01/12/2023	11,410	11,932,082	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series S(d)	6.75%	02/01/2024	13,340	14,707,350	0.1
Lloyds Banking Group PLC	3.87%	07/09/2025	18,225	19,949,772	0.1
Lloyds Banking Group PLC	4.50%	11/04/2024	17,820	19,861,231	0.1
Lloyds Banking Group PLC	4.58%	12/10/2025	22,665	25,479,232	0.1
Lloyds Banking Group PLC(d)	7.50%	06/27/2024	25,585	28,523,632	0.1
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.	4.60%	03/27/2024	22,608	24,846,615	0.1
Morgan Stanley	5.00%	11/24/2025	15,300	17,834,148	0.1
Nationwide Building Society	4.36%	08/01/2024	27,210	29,543,227	0.1
Natwest Group PLC, Series U(d) (e)	2.57%	09/30/2027	15,700	15,535,232	0.1
Natwest Group PLC(d)	8.63%	08/15/2021	68,473	70,558,201	0.3
Nordea Bank Abp(d)	6.63%	03/26/2026	59,046	67,560,658	0.3
Santander Holdings USA, Inc.	4.40%	07/13/2027	51,158	57,236,750	0.2
Societe Generale SA	4.25%	04/14/2025	11,148	12,108,844	0.0
Societe Generale SA	4.25%	08/19/2026	17,260	18,960,297	0.1
Societe Generale SA	4.75%	11/24/2025	22,112	24,682,451	0.1
Standard Chartered PLC(d) (e)	1.72%	01/30/2027	34,013	31,825,250	0.2
Standard Chartered PLC	4.30%	02/19/2027	1,500	1,648,801	0.0
Standard Chartered PLC	5.20%	01/26/2024	4,628	5,107,483	0.0
Standard Chartered PLC	5.70%	01/25/2022	9,510	9,903,064	0.0
Standard Chartered PLC(d)	7.50%	04/02/2022	12,693	13,301,744	0.0
Standard Chartered PLC(d)	7.75%	04/02/2023	3,200	3,477,090	0.0
Svenska Handelsbanken AB(d)	4.75%	03/01/2031	13,600	14,421,568	0.1
Svenska Handelsbanken AB(d)	5.25%	03/01/2021	14,520	14,520,000	0.1
Swedbank AB, Series NC5(d)	5.63%	09/17/2024	13,600	14,542,305	0.1
Swedbank AB(d)	6.00%	03/17/2022	5,200	5,367,936	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
UBS AG . . . . .	5.13%	05/15/2024	USD 7,742	\$ 8,549,039	0.0%
UBS AG/Stamford CT . . . . .	7.63%	08/17/2022	14,464	15,870,523	0.1
UBS Group AG(d) . . . . .	6.88%	03/22/2021	5,000	5,010,466	0.0
UBS Group AG(d) . . . . .	7.00%	01/31/2024	12,992	14,213,147	0.1
UBS Group AG(d) . . . . .	7.00%	02/19/2025	28,847	32,946,133	0.1
UBS Group AG(d) . . . . .	7.13%	08/10/2021	10,000	10,244,766	0.0
UniCredit SpA . . . . .	4.63%	04/12/2027	1,425	1,607,297	0.0
UniCredit SpA . . . . .	6.57%	01/14/2022	82,677	86,610,959	0.3
UniCredit SpA . . . . .	7.83%	12/04/2023	24,650	28,878,221	0.1
Wells Fargo & Co., Series U(d) . . . . .	5.88%	06/15/2025	13,500	14,850,338	0.1
				<u>2,107,402,797</u>	<u>7.8</u>
<b>MAKLER</b>					
Charles Schwab Corp. (The), Series G(d) . . . . .	5.38%	06/01/2025	41,119	<u>45,299,392</u>	<u>0.2</u>
<b>FINANZEN</b>					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust . . . . .	2.88%	08/14/2024	3,072	3,196,095	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust . . . . .	3.30%	01/23/2023	162	168,366	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust . . . . .	3.88%	01/23/2028	8,178	8,712,133	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust . . . . .	4.45%	10/01/2025	12,253	13,384,338	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust . . . . .	6.50%	07/15/2025	3,140	3,674,431	0.0
Aircastle Ltd. . . . .	2.85%	01/26/2028	8,142	7,821,747	0.0
Aircastle Ltd. . . . .	4.13%	05/01/2024	4,820	5,076,135	0.0
Aircastle Ltd. . . . .	4.25%	06/15/2026	1,132	1,198,164	0.0
Aircastle Ltd. . . . .	4.40%	09/25/2023	12,230	12,998,093	0.1
Aircastle Ltd. . . . .	5.00%	04/01/2023	996	1,064,934	0.0
Aircastle Ltd. . . . .	5.25%	08/11/2025	46,031	50,282,708	0.2
Aviation Capital Group LLC . . . . .	1.95%	01/30/2026	2,054	2,014,045	0.0
Aviation Capital Group LLC . . . . .	2.88%	01/20/2022	2,000	2,032,428	0.0
Aviation Capital Group LLC . . . . .	3.50%	11/01/2027	8,286	8,596,218	0.0
Aviation Capital Group LLC . . . . .	3.88%	05/01/2023	14,972	15,719,941	0.1
Aviation Capital Group LLC . . . . .	4.13%	08/01/2025	117	125,117	0.0
Aviation Capital Group LLC . . . . .	4.38%	01/30/2024	35,753	38,345,785	0.2
Aviation Capital Group LLC . . . . .	4.88%	10/01/2025	4,985	5,483,088	0.0
Aviation Capital Group LLC . . . . .	5.50%	12/15/2024	30,672	34,544,000	0.1
GE Capital Funding LLC . . . . .	4.40%	05/15/2030	26,675	30,329,693	0.1
Synchrony Financial . . . . .	3.95%	12/01/2027	18,633	20,433,170	0.1
Synchrony Financial . . . . .	4.25%	08/15/2024	22,544	24,722,009	0.1
Synchrony Financial . . . . .	4.38%	03/19/2024	5,587	6,124,311	0.0
Synchrony Financial . . . . .	4.50%	07/23/2025	6,395	7,132,937	0.0
Synchrony Financial . . . . .	5.15%	03/19/2029	1,500	1,769,727	0.0
				<u>304,949,613</u>	<u>1.1</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
ACE Capital Trust II . . . . .	9.70%	04/01/2030	27,094	41,492,055	0.2
Allstate Corp. (The), Series B . . . . .	5.75%	08/15/2053	35,856	38,328,265	0.1
Allstate Corp. (The) . . . . .	6.50%	05/15/2057	8,665	11,353,955	0.0
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd. . . . .	5.63%	08/15/2052	21,351	24,337,765	0.1
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd. . . . .	5.75%	08/15/2050	18,619	20,917,434	0.1
Centene Corp. . . . .	5.38%	08/15/2026	10,453	11,005,479	0.0
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co., Ltd. . . . .	5.63%	06/24/2046	3,300	3,811,584	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(e) . . . . .	2.32%	02/12/2047	26,670	25,151,225	0.1
Liberty Mutual Group, Inc. . . . .	7.80%	03/15/2037	7,135	9,137,031	0.0
MetLife Capital Trust IV . . . . .	7.88%	12/15/2037	11,997	16,840,789	0.1
MetLife, Inc. . . . .	6.40%	12/15/2036	7,456	9,484,591	0.0
MetLife, Inc. . . . .	10.75%	08/01/2039	8,590	14,504,189	0.1
Nationwide Mutual Insurance Co.(e) . . . . .	2.51%	12/15/2024	1,000	997,876	0.0
Prudential Financial, Inc. . . . .	5.20%	03/15/2044	42,601	45,336,319	0.2
Prudential Financial, Inc. . . . .	5.63%	06/15/2043	47,823	51,203,014	0.2
Prudential Financial, Inc. . . . .	5.88%	09/15/2042	5,247	5,526,227	0.0
Swiss Re Finance Luxembourg SA . . . . .	5.00%	04/02/2049	7,290	8,378,908	0.0
Voya Financial, Inc. . . . .	5.65%	05/15/2053	64,054	68,348,598	0.3
				<u>406,155,304</u>	<u>1.5</u>
<b>SONSTIGE FINANZWERTE</b>					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust . . . . .	4.45%	04/03/2026	6,125	<u>6,688,032</u>	<u>0.0</u>
<b>REITS</b>					
American Tower Corp. . . . .	4.40%	02/15/2026	18,691	21,131,520	0.1
Brixmor Operating Partnership LP . . . . .	4.05%	07/01/2030	13,285	14,645,730	0.1
EPR Properties . . . . .	5.25%	07/15/2023	6,580	6,826,376	0.0
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc. . . . .	5.25%	06/01/2025	14,960	16,896,831	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc. . . . .	5.38%	04/15/2026	5,190	5,944,291	0.0
Kite Realty Group LP . . . . .	4.00%	10/01/2026	2,785	2,935,101	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp. . . . .	4.63%	08/01/2029	14,064	15,127,610	0.1
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp. . . . .	5.00%	10/15/2027	7,408	7,867,982	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp. . . . .	5.25%	08/01/2026	15,081	15,668,055	0.1
Omega Healthcare Investors, Inc. . . . .	4.50%	01/15/2025	3,865	4,207,590	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Omega Healthcare Investors, Inc. ....	5.25%	01/15/2026	USD 5,503	\$ 6,246,317	0.0%
Regency Centers LP. ....	3.60%	02/01/2027	10,680	11,671,281	0.0
Sabra Health Care LP. ....	4.80%	06/01/2024	27,053	29,609,575	0.1
SITE Centers Corp. ....	3.63%	02/01/2025	13,265	13,827,828	0.1
SITE Centers Corp. ....	4.70%	06/01/2027	18,600	20,555,415	0.1
Spirit Realty LP. ....	4.00%	07/15/2029	14,882	16,467,048	0.1
Spirit Realty LP. ....	4.45%	09/15/2026	27,056	30,318,463	0.1
STORE Capital Corp. ....	4.63%	03/15/2029	4,573	5,173,913	0.0
Susa Partnership LP. ....	7.50%	12/01/2027	6,000	7,286,809	0.0
VEREIT Operating Partnership LP. ....	3.40%	01/15/2028	7,691	8,281,651	0.0
VEREIT Operating Partnership LP. ....	4.63%	11/01/2025	12,000	13,680,942	0.0
VEREIT Operating Partnership LP. ....	4.88%	06/01/2026	13,118	15,225,635	0.1
WP Carey, Inc. ....	4.25%	10/01/2026	3,000	3,396,767	0.0
				<u>292,992,730</u>	<u>1.1</u>
				<u>3,163,487,868</u>	<u>11.7</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Arconic Corp. ....	6.00%	05/15/2025	29,005	30,989,818	0.1
Dow Chemical Co. (The) ....	4.55%	11/30/2025	5,000	5,727,914	0.0
Glencore Funding LLC. ....	4.00%	03/27/2027	5,000	5,595,243	0.0
Glencore Funding LLC. ....	4.13%	05/30/2023	4,500	4,836,461	0.0
Glencore Funding LLC. ....	4.13%	03/12/2024	29,221	31,832,078	0.1
Glencore Funding LLC. ....	4.63%	04/29/2024	2,142	2,379,604	0.0
Huntsman International LLC. ....	4.50%	05/01/2029	13,936	15,706,987	0.1
MEGlobal Canada ULC. ....	5.00%	05/18/2025	5,875	6,522,558	0.1
MEGlobal Canada ULC. ....	5.88%	05/18/2030	3,112	3,781,037	0.0
Rohm & Haas Co. ....	7.85%	07/15/2029	22,000	30,102,865	0.1
				<u>137,474,565</u>	<u>0.5</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
General Electric Co. ....	3.45%	05/01/2027	5,197	5,684,973	0.0
General Electric Co., Series D(d) (e) ....	3.52%	06/15/2021	41,196	39,062,237	0.1
Westinghouse Air Brake Technologies Corp. ....	3.20%	06/15/2025	1,975	2,098,314	0.0
Westinghouse Air Brake Technologies Corp. ....	4.40%	03/15/2024	15,188	16,570,296	0.1
				<u>63,415,820</u>	<u>0.2</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Discovery Communications LLC. ....	3.95%	03/20/2028	1,500	1,668,575	0.0
Omnicom Group, Inc. ....	4.20%	06/01/2030	7,263	8,369,223	0.0
Time Warner Entertainment Co. LP. ....	8.38%	07/15/2033	15,020	22,236,263	0.1
ViacomCBS, Inc. ....	4.00%	01/15/2026	15,132	16,894,824	0.1
				<u>49,168,885</u>	<u>0.2</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
AT&T, Inc. ....	6.45%	06/15/2034	10,741	14,120,930	0.1
AT&T, Inc. ....	7.13%	12/15/2031	3,042	4,123,190	0.0
AT&T, Inc. ....	7.63%	04/15/2031	5,000	6,579,734	0.0
British Telecommunications PLC. ....	5.13%	12/04/2028	18,590	22,205,765	0.1
British Telecommunications PLC. ....	9.63%	12/15/2030	14,260	22,364,305	0.1
Qwest Corp. ....	6.75%	12/01/2021	2,000	2,075,240	0.0
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC. ....	4.74%	03/20/2025	17,245	18,658,569	0.1
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC. ....	5.15%	03/20/2028	9,140	10,609,959	0.0
				<u>100,737,692</u>	<u>0.4</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
General Motors Co. ....	6.13%	10/01/2025	3,702	4,401,121	0.0
General Motors Co. ....	6.25%	10/02/2043	7,450	9,920,925	0.1
General Motors Co. ....	6.80%	10/01/2027	5,262	6,643,648	0.0
General Motors Financial Co., Inc. ....	3.50%	11/07/2024	2,733	2,955,422	0.0
General Motors Financial Co., Inc. ....	3.70%	05/09/2023	965	1,021,301	0.0
General Motors Financial Co., Inc. ....	3.95%	04/13/2024	5,180	5,619,612	0.0
General Motors Financial Co., Inc. ....	4.00%	10/06/2026	5,490	6,078,016	0.0
General Motors Financial Co., Inc. ....	4.15%	06/19/2023	7,901	8,480,281	0.0
General Motors Financial Co., Inc. ....	5.10%	01/17/2024	32,000	35,613,629	0.1
General Motors Financial Co., Inc. ....	5.20%	03/20/2023	4,237	4,618,097	0.0
General Motors Financial Co., Inc. ....	5.25%	03/01/2026	20,949	24,220,417	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc. ....	3.35%	06/08/2025	27,028	28,612,331	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc. ....	4.05%	02/04/2022	6,940	7,165,720	0.0
Hyundai Capital America. ....	5.88%	04/07/2025	79,779	92,951,839	0.4
Lear Corp. ....	3.50%	05/30/2030	10,754	11,415,566	0.1
Lear Corp. ....	3.80%	09/15/2027	16,668	18,353,611	0.1
Nissan Motor Acceptance Corp. ....	2.60%	09/28/2022	1,432	1,469,009	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp. ....	2.80%	01/13/2022	1,319	1,341,029	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp. ....	3.45%	03/15/2023	2,099	2,204,308	0.0



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Nissan Motor Acceptance Corp. ....	3.88%	09/21/2023	USD 7,299	\$ 7,817,948	0.0%
Nissan Motor Co., Ltd. ....	4.35%	09/17/2027	20,699	22,753,829	0.1
				<u>303,657,659</u>	<u>1.1</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Genting New York LLC/GENNY Capital, Inc. ....	3.30%	02/15/2026	17,897	17,997,019	0.1
James Hardie International Finance DAC .....	5.00%	01/15/2028	510	542,213	0.0
Lennar Corp. ....	4.50%	04/30/2024	750	823,702	0.0
Marriott International, Inc./MD, Series EE .....	5.75%	05/01/2025	8,578	9,883,041	0.1
MDC Holdings, Inc. ....	6.00%	01/15/2043	3,723	4,947,551	0.0
Owens Corning .....	7.00%	12/01/2036	1,449	2,003,904	0.0
PulteGroup, Inc. ....	5.00%	01/15/2027	5,635	6,588,975	0.0
PulteGroup, Inc. ....	7.88%	06/15/2032	2,595	3,730,948	0.0
				<u>46,517,353</u>	<u>0.2</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
Ross Stores, Inc. ....	4.70%	04/15/2027	14,291	16,444,957	0.1
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Altria Group, Inc. ....	4.80%	02/14/2029	38,826	45,360,103	0.1
Zimmer Biomet Holdings, Inc. ....	3.55%	03/20/2030	21,350	23,340,021	0.1
				<u>68,700,124</u>	<u>0.2</u>
<b>ENERGIE</b>					
Boardwalk Pipelines LP. ....	4.45%	07/15/2027	6,893	7,748,610	0.0
Boardwalk Pipelines LP. ....	4.80%	05/03/2029	19,313	21,857,191	0.1
Boardwalk Pipelines LP. ....	4.95%	12/15/2024	14,272	15,982,310	0.1
Boardwalk Pipelines LP. ....	5.95%	06/01/2026	2,580	3,044,234	0.0
Cenovus Energy, Inc. ....	5.38%	07/15/2025	19,194	21,696,458	0.1
Cenovus Energy, Inc. ....	6.75%	11/15/2039	428	551,829	0.0
Continental Resources, Inc./OK .....	5.75%	01/15/2031	28,213	31,885,848	0.1
Enable Midstream Partners LP .....	4.40%	03/15/2027	71,587	77,972,705	0.3
Enable Midstream Partners LP .....	4.95%	05/15/2028	6,435	7,187,633	0.0
Energy Transfer Operating LP .....	4.25%	03/15/2023	6,000	6,354,214	0.0
Energy Transfer Operating LP .....	4.75%	01/15/2026	7,390	8,245,295	0.0
Energy Transfer Operating LP .....	5.50%	06/01/2027	23,075	26,905,398	0.1
Energy Transfer Operating LP .....	8.25%	11/15/2029	2,000	2,698,980	0.0
Energy Transfer Partners LP/Regency Energy Finance Corp. ....	4.50%	11/01/2023	11,707	12,684,533	0.1
Eni SpA .....	4.25%	05/09/2029	12,712	14,433,631	0.1
Eni SpA, Series X-R .....	4.75%	09/12/2028	1,500	1,756,306	0.0
Hess Corp. ....	7.30%	08/15/2031	45,274	59,031,388	0.2
Hess Corp. ....	7.88%	10/01/2029	16,239	21,658,226	0.1
Husky Energy, Inc. ....	4.40%	04/15/2029	8,488	9,325,925	0.0
Kinder Morgan Energy Partners LP .....	7.30%	08/15/2033	9,000	12,409,729	0.1
Marathon Oil Corp. ....	3.85%	06/01/2025	16,103	17,371,323	0.1
Marathon Oil Corp. ....	4.40%	07/15/2027	1,500	1,691,862	0.0
Marathon Oil Corp. ....	6.80%	03/15/2032	10,144	12,973,064	0.1
Marathon Petroleum Corp. ....	4.70%	05/01/2025	33,139	37,581,921	0.1
ONEOK Partners LP .....	4.90%	03/15/2025	5,360	5,997,140	0.0
ONEOK, Inc. ....	4.35%	03/15/2029	21,411	23,609,204	0.1
ONEOK, Inc. ....	5.85%	01/15/2026	33,260	39,264,829	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp. ....	3.60%	11/01/2024	860	919,723	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp. ....	4.50%	12/15/2026	9,649	10,660,211	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp. ....	4.65%	10/15/2025	25,384	28,047,321	0.1
Suncor Energy, Inc. ....	7.15%	02/01/2032	6,100	8,297,187	0.0
Sunoco Logistics Partners Operations LP .....	3.90%	07/15/2026	2,467	2,676,791	0.0
Tennessee Gas Pipeline Co. ....	7.00%	10/15/2028	19,360	24,951,489	0.1
				<u>577,472,508</u>	<u>2.1</u>
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Booking Holdings, Inc. ....	4.63%	04/13/2030	11,630	13,809,591	0.1
Expedia Group, Inc. ....	6.25%	05/01/2025	7,776	9,110,990	0.0
				<u>22,920,581</u>	<u>0.1</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Autodesk, Inc. ....	3.50%	06/15/2027	8,474	9,388,730	0.1
Broadcom, Inc. ....	3.50%	02/15/2041	58,617	57,844,856	0.2
Broadcom, Inc. ....	4.11%	09/15/2028	12,958	14,327,760	0.1
Broadcom, Inc. ....	5.00%	04/15/2030	17,736	20,551,442	0.1
Dell International LLC/EMC Corp. ....	4.90%	10/01/2026	25,766	29,677,747	0.1
Dell International LLC/EMC Corp. ....	5.85%	07/15/2025	6,238	7,328,466	0.0
Leidos, Inc. ....	7.13%	07/01/2032	2,000	2,737,571	0.0
NXP BV/NXP Funding LLC .....	4.88%	03/01/2024	25,179	28,052,980	0.1
NXP BV/NXP Funding LLC .....	5.35%	03/01/2026	24,052	28,275,511	0.1
NXP BV/NXP Funding LLC .....	5.55%	12/01/2028	1,500	1,825,730	0.0
VMware, Inc. ....	4.50%	05/15/2025	31,904	35,825,415	0.1
				<u>235,836,208</u>	<u>0.9</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN</b>					
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025	USD 38,037	\$ 44,193,523	0.2%
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.50%	10/20/2025	26,708	28,443,778	0.1
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	31,075	34,299,031	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/ Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	59,148	64,599,008	0.2
Southwest Airlines Co.	4.75%	05/04/2023	28,086	30,529,696	0.1
Southwest Airlines Co.	5.25%	05/04/2025	29,206	33,433,169	0.1
				<u>235,498,205</u>	<u>0.8</u>
<b>TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN</b>					
BNSF Funding Trust I	6.61%	12/15/2055	5,597	6,439,011	0.0
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Ashtead Capital, Inc.	5.25%	08/01/2026	15,460	16,284,119	0.1
				<u>1,880,567,687</u>	<u>6.9</u>
<b>VERSORGBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Enel Finance International NV	3.63%	05/25/2027	11,791	12,992,705	0.0
Enel Finance International NV	4.63%	09/14/2025	42,500	48,398,949	0.2
NRG Energy, Inc.	3.75%	06/15/2024	13,265	14,322,740	0.1
				<u>75,714,394</u>	<u>0.3</u>
				<u>5,119,769,949</u>	<u>18.9</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG</b>					
<b>STAATSANLEIHEN</b>					
<b>ANGOLA</b>					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	17,946	17,458,093	0.1
Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025	12,861	13,636,679	0.0
				<u>31,094,772</u>	<u>0.1</u>
<b>BRASILIEN</b>					
Brazilian Government International Bond	8.25%	01/20/2034	15,326	20,407,527	0.1
<b>KOLUMBIEN</b>					
Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	4,454	4,421,987	0.0
Colombia Government International Bond	4.13%	05/15/2051	24,469	23,421,421	0.1
				<u>27,843,408</u>	<u>0.1</u>
<b>COSTA RICA</b>					
Costa Rica Government International Bond	4.25%	01/26/2023	18,005	17,869,963	0.1
Costa Rica Government International Bond	4.38%	04/30/2025	5,510	5,337,813	0.0
Costa Rica Government International Bond	6.13%	02/19/2031	19,688	19,823,355	0.1
Costa Rica Government International Bond	7.00%	04/04/2044	21,065	20,498,878	0.1
Costa Rica Government International Bond	7.16%	03/12/2045	28,154	27,626,112	0.1
				<u>91,156,121</u>	<u>0.4</u>
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>					
Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030	75,271	75,741,444	0.3
Dominican Republic International Bond	4.88%	09/23/2032	19,203	19,467,041	0.1
Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027	33,150	37,045,125	0.1
Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	8,000	9,017,500	0.0
Dominican Republic International Bond	6.88%	01/29/2026	45,042	52,473,930	0.2
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	2,096	2,536,815	0.0
				<u>196,281,855</u>	<u>0.7</u>
<b>ECUADOR</b>					
Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	3,678	1,526,525	0.0
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2030	12,724	7,475,582	0.0
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2035	26,864	12,223,156	0.1
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2040	9,839	4,132,218	0.0
				<u>25,357,481</u>	<u>0.1</u>
<b>ÄGYPTEN</b>					
Egypt Government International Bond	4.55%	11/20/2023	6,150	6,303,750	0.0
Egypt Government International Bond	5.75%	05/29/2024	62,050	65,617,875	0.2
Egypt Government International Bond	6.13%	01/31/2022	41,994	43,083,219	0.2
Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	9,640	10,227,438	0.0
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	6,969	7,204,273	0.0
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	64,615	72,752,452	0.3
Egypt Government International Bond	7.60%	03/01/2029	19,783	21,748,936	0.1
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	62,112	66,149,280	0.3
				<u>293,087,223</u>	<u>1.1</u>
<b>EL SALVADOR</b>					
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	23,539	22,862,254	0.1
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	15,000	14,643,750	0.1
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	9,532	8,817,100	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	21,967	22,735,845	0.1
				<u>69,058,949</u>	<u>0.3</u>



		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>GHANA</b>						
	Ghana Government International Bond . . . . .	6.38%	02/11/2027	USD 53,977	\$ 55,461,367	0.2%
	Ghana Government International Bond . . . . .	7.88%	08/07/2023	7,300	8,059,656	0.1
	Ghana Government International Bond . . . . .	7.88%	03/26/2027	34,165	37,165,114	0.2
	Ghana Government International Bond . . . . .	8.13%	01/18/2026	7,000	7,899,063	0.0
	Ghana Government International Bond . . . . .	8.13%	03/26/2032	7,000	7,131,250	0.0
	Ghana Government International Bond . . . . .	10.75%	10/14/2030	4,326	5,646,782	0.0
					<u>121,363,232</u>	<u>0.5</u>
<b>GUATEMALA</b>						
	Guatemala Government Bond . . . . .	6.13%	06/01/2050	5,185	6,256,027	0.0
<b>HONDURAS</b>						
	Honduras Government International Bond . . . . .	6.25%	01/19/2027	15,391	17,209,062	0.0
	Honduras Government International Bond . . . . .	7.50%	03/15/2024	16,388	17,852,677	0.1
					<u>35,061,739</u>	<u>0.1</u>
<b>ELFENBEINKÜSTE</b>						
	Ivory Coast Government International Bond . . . . .	6.13%	06/15/2033	18,113	19,443,173	0.1
	Ivory Coast Government International Bond . . . . .	6.38%	03/03/2028	39,769	44,205,729	0.1
					<u>63,648,902</u>	<u>0.2</u>
<b>KENIA</b>						
	Kenya Government International Bond . . . . .	6.88%	06/24/2024	22,435	24,853,773	0.1
	Kenya Government International Bond . . . . .	7.00%	05/22/2027	19,297	21,317,155	0.1
	Kenya Government International Bond . . . . .	7.25%	02/28/2028	11,890	13,142,166	0.0
					<u>59,313,094</u>	<u>0.2</u>
<b>MEXIKO</b>						
	Mexico Government International Bond . . . . .	3.90%	04/27/2025	6,294	6,978,472	0.0
	Mexico Government International Bond . . . . .	4.75%	04/27/2032	15,488	17,365,920	0.1
					<u>24,344,392</u>	<u>0.1</u>
<b>MONGOLEI</b>						
	Mongolia Government International Bond . . . . .	5.13%	12/05/2022	1,692	1,756,508	0.0
<b>NAMIBIA</b>						
	Namibia International Bonds . . . . .	5.25%	10/29/2025	11,420	12,062,375	0.1
<b>NIGERIA</b>						
	Nigeria Government International Bond . . . . .	6.50%	11/28/2027	67,881	72,547,819	0.3
	Nigeria Government International Bond . . . . .	7.63%	11/21/2025	50,425	57,756,350	0.2
	Nigeria Government International Bond . . . . .	7.63%	11/28/2047	13,971	14,224,224	0.1
	Nigeria Government International Bond . . . . .	7.70%	02/23/2038	12,210	12,507,619	0.0
	Nigeria Government International Bond . . . . .	7.88%	02/16/2032	5,591	6,017,314	0.0
					<u>163,053,326</u>	<u>0.6</u>
<b>PAKISTAN</b>						
	Pakistan Government International Bond . . . . .	6.88%	12/05/2027	589	627,285	0.0
<b>PANAMA</b>						
	Panama Notas del Tesoro . . . . .	3.75%	04/17/2026	32,190	35,197,753	0.1
<b>PERU</b>						
	Peruvian Government International Bond . . . . .	2.39%	01/23/2026	1,120	1,162,350	0.0
	Peruvian Government International Bond . . . . .	2.78%	01/23/2031	3,069	3,115,994	0.0
					<u>4,278,344</u>	<u>0.0</u>
<b>SENEGAL</b>						
	Senegal Government International Bond . . . . .	6.25%	05/23/2033	43,004	45,611,117	0.2
	Senegal Government International Bond . . . . .	6.75%	03/13/2048	36,542	37,261,421	0.1
	Senegal Government International Bond . . . . .	8.75%	05/13/2021	1,404	1,418,479	0.0
					<u>84,291,017</u>	<u>0.3</u>
<b>SÜDAFRIKA</b>						
	Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	4.30%	10/12/2028	1,836	1,813,624	0.0
	Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	4.85%	09/30/2029	26,842	27,085,256	0.1
	Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	5.65%	09/27/2047	26,967	24,801,213	0.1
	Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	5.75%	09/30/2049	63,767	58,506,222	0.1
	Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	5.88%	09/16/2025	17,700	19,669,125	0.1
	Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	5.88%	06/22/2030	18,326	19,677,542	0.1
	Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	6.30%	06/22/2048	14,391	14,085,191	0.1
					<u>165,638,173</u>	<u>0.6</u>
<b>UKRAINE</b>						
	Ukraine Government International Bond . . . . .	7.25%	03/15/2033	56,094	56,935,410	0.2
	Ukraine Government International Bond . . . . .	7.38%	09/25/2032	68,051	69,986,200	0.3
	Ukraine Government International Bond . . . . .	8.99%	02/01/2024	10,000	11,050,000	0.0
					<u>137,971,610</u>	<u>0.5</u>
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>						
	Abu Dhabi Government International Bond . . . . .	2.50%	04/16/2025	14,382	15,208,965	0.1
	Abu Dhabi Government International Bond . . . . .	3.13%	04/16/2030	26,198	28,385,533	0.1
	Emirate of Dubai Government International Bonds, Series E . . . . .	5.25%	01/30/2043	8,135	9,060,356	0.0
					<u>52,654,854</u>	<u>0.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>URUGUAY</b>					
Uruguay Government International Bond	7.63%	03/21/2036	USD 7,989	\$ 12,325,706	0.0%
Uruguay Government International Bond	7.88%	01/15/2033	11,680	17,830,484	0.1
				<u>30,156,190</u>	<u>0.1</u>
				<u>1,751,962,157</u>	<u>6.5</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Anglo American Capital PLC	3.63%	09/11/2024	900	980,451	0.0
Anglo American Capital PLC	4.88%	05/14/2025	41,899	47,744,185	0.2
Anglo American Capital PLC	5.38%	04/01/2025	5,254	6,092,883	0.0
Braskem America Finance Co.	7.13%	07/22/2041	13,000	14,719,250	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	20,153	20,459,325	0.1
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	2,018	2,179,440	0.0
CSN Resources SA	7.63%	02/13/2023	20,460	21,188,888	0.1
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026	21,361	23,022,886	0.1
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	5.13%	05/15/2024	8,685	9,477,506	0.0
GTL Trade Finance, Inc./Gerdau Holdings, Inc.	5.89%	04/29/2024	1,431	1,602,720	0.0
GUSAP III LP	4.25%	01/21/2030	9,269	10,014,356	0.0
HTA Group Ltd./Mauritius	7.00%	12/18/2025	20,951	22,332,457	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	24,497	26,181,169	0.1
Minsur SA	6.25%	02/07/2024	3,000	3,331,875	0.0
Nexa Resources SA	5.38%	05/04/2027	23,815	26,241,153	0.1
Sasol Financing USA LLC	5.88%	03/27/2024	8,684	9,316,304	0.0
SASOL Financing USA LLC	6.50%	09/27/2028	10,000	11,226,000	0.1
Suzano Austria GmbH	7.00%	03/16/2047	6,557	8,579,834	0.0
Vedanta Resources Finance Ii P.	8.95%	03/11/2025	20,226	20,226,000	0.1
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	4,160	4,269,200	0.0
				<u>289,185,882</u>	<u>1.1</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Cemex SAB de CV	5.20%	09/17/2030	5,600	6,097,000	0.0
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	6,522	7,318,662	0.0
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	26,107	27,299,046	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	14,202	15,907,663	0.1
Usiminas International Sarl	5.88%	07/18/2026	11,294	12,182,373	0.0
				<u>68,804,744</u>	<u>0.2</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Prosus NV	4.03%	08/03/2050	7,314	6,771,963	0.1
VTR Finance NV	6.38%	07/15/2028	6,173	6,733,081	0.0
Weibo Corp.	3.50%	07/05/2024	28,740	30,353,300	0.1
				<u>43,858,344</u>	<u>0.2</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Kenbourne Invest SA	6.88%	11/26/2024	8,726	9,384,578	0.0
MTN Mauritius Investments Ltd.	5.37%	02/13/2022	8,533	8,743,658	0.0
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	33,419	35,281,137	0.1
VTR Comunicaciones SpA	5.13%	01/15/2028	10,229	10,945,030	0.1
				<u>64,354,403</u>	<u>0.2</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
Falabella SA	3.75%	10/30/2027	8,500	9,211,763	0.0
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026	10,132	10,578,748	0.0
BRF SA	4.88%	01/24/2030	27,471	28,501,163	0.2
Cosan Ltd.	5.50%	09/20/2029	12,838	13,740,672	0.1
Inretail Pharma SA	5.38%	05/02/2023	13,691	14,106,008	0.1
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	2.43%	07/01/2031	10,259	10,323,119	0.0
Minerva Luxembourg SA	6.50%	09/20/2026	5,825	6,094,406	0.0
NBM US Holdings, Inc.	6.63%	08/06/2029	10,000	11,164,376	0.0
Ulker Biskuvi Sanayi AS	6.95%	10/30/2025	3,907	4,242,758	0.0
				<u>98,751,250</u>	<u>0.4</u>
<b>ENERGIE</b>					
BPRL International Singapore Pte Ltd.	4.38%	01/18/2027	13,221	13,778,265	0.1
Ecopetrol SA	5.88%	09/18/2023	6,743	7,476,301	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	05/28/2045	2,852	3,064,702	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	24,762	30,170,021	0.1
Geopark Ltd.	5.50%	01/17/2027	1,718	1,751,286	0.0
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	4,306	3,544,479	0.0
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	2,624	2,745,360	0.0
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026	4,339	4,659,001	0.0
Medco Platinum Road Pte Ltd.	6.75%	01/30/2025	14,356	15,024,451	0.1
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	11,537	12,549,500	0.0
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	8,487	9,102,308	0.0
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030	1,478	1,381,468	0.0
Petrobras Global Finance BV	7.38%	01/17/2027	33,486	40,847,027	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Petrobras Global Finance BV . . . . .	8.75%	05/23/2026	USD 14,377	\$ 18,487,923	0.1%
Raizen Fuels Finance SA . . . . .	5.30%	01/20/2027	16,179	18,186,720	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd. . . . .	4.00%	08/15/2026	25,480	27,613,950	0.1
				<u>210,382,762</u>	<u>0.8</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Baidu, Inc. . . . .	3.43%	04/07/2030	345	369,984	0.0
<b>TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN</b>					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd. . . . .	4.35%	04/05/2036	4,629	5,039,824	0.0
Lima Metro Line 2 Finance Ltd. . . . .	5.88%	07/05/2034	9,857	11,815,904	0.1
				<u>16,855,728</u>	<u>0.1</u>
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Rumo Luxembourg SARL . . . . .	7.38%	02/09/2024	8,088	8,378,662	0.0
				<u>810,153,522</u>	<u>3.0</u>
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Banco de Credito del Peru . . . . .	3.13%	07/01/2030	20,748	21,173,334	0.1
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand . . . . .	5.38%	04/17/2025	23,905	27,085,560	0.1
BBVA Bancomer SA/Texas . . . . .	5.88%	09/13/2034	22,485	25,122,491	0.1
				<u>73,381,385</u>	<u>0.3</u>
<b>FINANZEN</b>					
Huarong Finance II Co., Ltd. . . . .	5.00%	11/19/2025	12,192	13,540,740	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd. . . . .	5.50%	01/16/2025	24,037	26,827,621	0.1
				<u>40,368,361</u>	<u>0.2</u>
<b>SONSTIGE FINANZWERTE</b>					
OEC Finance Ltd.(b) . . . . .	4.38%	10/25/2029	4,629	919,603	0.0
OEC Finance Ltd.(b) . . . . .	7.13%	12/26/2046	11,095	2,362,062	0.0
				<u>3,281,665</u>	<u>0.0</u>
<b>REITS</b>					
Trust Fibra Uno . . . . .	4.87%	01/15/2030	29,764	32,145,120	0.1
				<u>149,176,531</u>	<u>0.6</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
AES Gener SA . . . . .	6.35%	10/07/2079	12,300	13,161,000	0.0
AES Panama Generation Holdings SRL . . . . .	4.38%	05/31/2030	7,524	7,964,154	0.0
Cemig Geracao e Transmissao SA . . . . .	9.25%	12/05/2024	5,146	5,924,332	0.0
Consortio Transmantaro SA . . . . .	4.38%	05/07/2023	30,911	32,717,362	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP . . . . .	4.25%	07/18/2029	24,989	25,543,443	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP . . . . .	4.38%	02/15/2031	19,852	20,249,040	0.1
Engie Energia Chile SA . . . . .	4.50%	01/29/2025	12,529	13,711,863	0.1
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA . . . . .	7.25%	05/03/2023	5,987	6,210,016	0.0
LLPL Capital Pte Ltd. . . . .	6.88%	02/04/2039	5,850	6,960,986	0.0
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. . . . .	6.75%	04/24/2033	12,927	14,489,870	0.1
				<u>146,932,066</u>	<u>0.5</u>
				<u>2,858,224,276</u>	<u>10.6</u>
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-3A, Class M1B(e) . . . . .	1.97%	10/25/2028	4,778	4,804,399	0.0
Series 2019-1A, Class M2(e) . . . . .	2.82%	03/25/2029	13,043	13,108,043	0.1
Series 2019-2A, Class M1C(e) . . . . .	2.12%	04/25/2029	51,941	52,168,760	0.2
Series 2019-3A, Class M1C(e) . . . . .	2.07%	07/25/2029	69,349	70,092,262	0.3
Series 2019-4A, Class M1B(e) . . . . .	2.12%	10/25/2029	3,890	3,905,796	0.0
Series 2019-4A, Class M1C(e) . . . . .	2.62%	10/25/2029	25,958	26,250,799	0.1
Series 2019-4A, Class M2(e) . . . . .	2.97%	10/25/2029	40,849	41,184,647	0.2
Series 2020-3A, Class M2(e) . . . . .	4.97%	10/25/2030	4,250	4,380,004	0.0
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2018-R07, Class 1M2(e) . . . . .	2.52%	04/25/2031	38,171	38,219,446	0.1
Series 2019-R01, Class 2M2(e) . . . . .	2.57%	07/25/2031	58,017	58,053,253	0.2
Series 2019-R03, Class 1M2(e) . . . . .	2.27%	09/25/2031	23,754	23,792,260	0.1
Series 2019-R04, Class 2M2(e) . . . . .	2.22%	06/25/2039	20,904	20,904,169	0.1
Series 2019-R05, Class 1M2(e) . . . . .	2.12%	07/25/2039	25,288	25,282,313	0.1
Series 2019-R06, Class 2M2(e) . . . . .	2.22%	09/25/2039	48,605	48,630,678	0.2
Series 2019-R07, Class 1M2(e) . . . . .	2.22%	10/25/2039	20,134	20,133,727	0.1
Eagle RE Ltd., Series 2018-1, Class M1(e) . . . . .	1.83%	11/25/2028	2,145	2,155,494	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2013-DN2, Class M2(e) . . . . .	4.38%	11/25/2023	12,309	12,385,832	0.0
Series 2014-DN4, Class M3(e) . . . . .	4.68%	10/25/2024	16,493	16,904,972	0.1
Series 2014-HQ1, Class M3(e) . . . . .	4.22%	08/25/2024	7,181	7,259,059	0.0
Series 2014-HQ2, Class M3(e) . . . . .	3.88%	09/25/2024	3,069	3,164,755	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2014-HQ3, Class M3(e)	4.88%	10/25/2024	USD 3,040	\$ 3,080,695	0.0%
Series 2015-DNA1, Class M3(e)	3.42%	10/25/2027	5,037	5,139,109	0.0
Series 2015-DNA3, Class M3(e)	4.83%	04/25/2028	15,431	16,056,528	0.1
Series 2015-HQA1, Class M3(e)	4.82%	03/25/2028	22,583	23,333,568	0.1
Series 2015-HQA2, Class M3(e)	4.92%	05/25/2028	24,339	25,248,634	0.1
Series 2016-DNA1, Class M3(e)	5.68%	07/25/2028	34,127	35,837,674	0.1
Series 2016-DNA3, Class M3(e)	5.13%	12/25/2028	63,959	67,235,614	0.3
Series 2016-DNA4, Class M3(e)	3.93%	03/25/2029	47,790	49,654,410	0.2
Series 2016-HQA1, Class M3(e)	6.48%	09/25/2028	34,505	36,635,050	0.1
Series 2016-HQA2, Class M3(e)	5.28%	11/25/2028	15,652	16,389,074	0.1
Series 2017-DNA2, Class M2(e)	3.58%	10/25/2029	15,257	15,770,040	0.1
Series 2017-DNA3, Class B1(e)	4.58%	03/25/2030	9,000	9,483,520	0.0
Series 2017-DNA3, Class M2(e)	2.62%	03/25/2030	10,335	10,526,145	0.0
Series 2017-HQA1, Class M2(e)	3.68%	08/25/2029	64,760	66,532,991	0.3
Series 2017-HQA3, Class M2(e)	2.47%	04/25/2030	50,687	51,311,327	0.2
Series 2018-DNA1, Class M2(e)	1.93%	07/25/2030	14,096	14,069,447	0.1
Series 2018-HQA1, Class M2(e)	2.42%	09/25/2030	46,784	46,898,016	0.2
Series 2018-HQA2, Class M2(e)	2.43%	10/25/2048	28,000	28,071,750	0.1
Series 2019-DNA1, Class M2(e)	2.78%	01/25/2049	62,400	62,879,535	0.2
Series 2019-DNA2, Class M2(e)	2.58%	03/25/2049	24,850	24,997,977	0.1
Series 2019-DNA3, Class M2(e)	2.18%	07/25/2049	27,534	27,573,433	0.1
Series 2019-FTR2, Class M2(e)	2.28%	11/25/2048	13,128	13,072,336	0.1
Series 2019-HQA1, Class M2(e)	2.48%	02/25/2049	46,604	46,659,935	0.2
Series 2019-HQA2, Class M2(e)	2.18%	04/25/2049	35,003	34,917,801	0.1
Series 2019-HQA3, Class M2(e)	1.98%	09/25/2049	4,809	4,790,538	0.0
Federal National Mortgage Association					
Connecticut Avenue Securities					
Series 2013-C01, Class M2(e)	5.38%	10/25/2023	3,132	3,237,757	0.0
Series 2014-C01, Class M2(e)	4.53%	01/25/2024	2,265	2,322,873	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(e)	5.03%	11/25/2024	15,351	15,804,158	0.1
Series 2014-C04, Class 2M2(e)	5.13%	11/25/2024	2,761	2,810,331	0.0
Series 2015-C01, Class 1M2(e)	4.43%	02/25/2025	10,856	11,096,452	0.0
Series 2015-C01, Class 2M2(e)	4.68%	02/25/2025	2,522	2,541,082	0.0
Series 2015-C02, Class 1M2(e)	4.13%	05/25/2025	33,685	34,400,620	0.1
Series 2015-C02, Class 2M2(e)	4.13%	05/25/2025	11,135	11,319,575	0.0
Series 2015-C03, Class 1M2(e)	5.13%	07/25/2025	22,393	22,943,466	0.1
Series 2015-C03, Class 2M2(e)	5.13%	07/25/2025	5,447	5,554,990	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(e)	5.83%	04/25/2028	53,576	56,868,845	0.2
Series 2015-C04, Class 2M2(e)	5.68%	04/25/2028	27,964	29,397,976	0.1
Series 2016-C01, Class 1M2(e)	6.88%	08/25/2028	16,977	17,988,564	0.1
Series 2016-C01, Class 2M2(e)	7.08%	08/25/2028	9,740	10,326,301	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(e)	6.13%	09/25/2028	38,996	41,071,129	0.2
Series 2016-C03, Class 1M2(e)	5.43%	10/25/2028	19,097	20,087,436	0.1
Series 2016-C03, Class 2M2(e)	6.03%	10/25/2028	28,135	29,565,379	0.1
Series 2016-C04, Class 1M2(e)	4.38%	01/25/2029	26,690	27,758,264	0.1
Series 2016-C05, Class 2M2(e)	4.57%	01/25/2029	22,212	23,154,985	0.1
Series 2016-C06, Class 1M2(e)	4.38%	04/25/2029	27,957	29,096,643	0.1
Series 2016-C07, Class 2M2(e)	4.47%	05/25/2029	15,971	16,636,752	0.1
Series 2017-C01, Class 1M2(e)	3.68%	07/25/2029	22,474	23,190,479	0.1
Series 2017-C02, Class 2B1(e)	5.62%	09/25/2029	16,013	17,091,923	0.1
Series 2017-C02, Class 2M2(e)	3.77%	09/25/2029	30,454	31,323,481	0.1
Series 2017-C03, Class 1B1(e)	4.97%	10/25/2029	10,420	11,308,346	0.0
Series 2017-C06, Class 1M2(e)	2.77%	02/25/2030	6,753	6,825,112	0.0
Series 2017-C07, Class 1B1(e)	4.12%	05/25/2030	5,472	5,621,678	0.0
Series 2018-C02, Class 2M2(e)	2.32%	08/25/2030	37,012	37,012,359	0.1
Series 2018-C04, Class 2M2(e)	2.68%	12/25/2030	37,058	37,368,743	0.1
Series 2018-C05, Class 1M2(e)	2.48%	01/25/2031	36,927	36,927,287	0.1
Series 2018-C06, Class 1M2(e)	2.13%	03/25/2031	11,667	11,686,690	0.0
Series 2018-C06, Class 2M2(e)	2.23%	03/25/2031	8,581	8,562,559	0.0
Home Re Ltd., Series 2018-1, Class M1(e)	1.73%	10/25/2028	5,641	5,650,953	0.0
Oaktown Re II Ltd., Series 2018-1A, Class M1(e)	1.68%	07/25/2028	380	380,170	0.0
Oaktown Re III Ltd.					
Series 2019-1A, Class M1B(e)	2.08%	07/25/2029	3,141	3,157,739	0.0
Series 2019-1A, Class M2(e)	2.68%	07/25/2029	23,910	24,058,994	0.1
Oaktown Re V Ltd., Series 2020-2A, Class M2(e)	5.38%	10/25/2030	4,014	4,108,936	0.0
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-1R, Class A(e)	2.13%	03/27/2024	15,869	15,161,360	0.1
Series 2019-2R, Class A(e)	2.88%	05/27/2023	33,313	32,225,989	0.1
Series 2019-3R, Class A(e)	2.83%	10/27/2022	13,889	13,892,705	0.1
Radnor Re Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(e)	2.08%	02/25/2029	12,742	12,775,520	0.1
Series 2019-2, Class M1B(e)	1.88%	06/25/2029	31,085	31,066,759	0.1
Series 2020-1, Class M1B(e)	1.58%	02/25/2030	30,146	30,034,614	0.1
Series 2020-1, Class M1C(e)	1.88%	02/25/2030	8,262	8,267,799	0.0
Triangle Re Ltd., Series 2020-1, Class M1C(e)	4.63%	10/25/2030	19,080	19,573,632	0.1
				<u>2,070,203,220</u>	<u>7.7</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE</b>					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-1A, Class B1(e) . . . . .	4.37%	04/25/2028	USD 2,270	\$ 2,292,249	0.0%
Series 2018-1A, Class M2(e) . . . . .	3.02%	04/25/2028	3,400	3,425,215	0.0
Series 2019-2A, Class M2(e) . . . . .	3.22%	04/25/2029	5,000	5,034,761	0.0
Eagle Re Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(e) . . . . .	1.92%	04/25/2029	1,278	1,279,711	0.0
Series 2019-1, Class M2(e) . . . . .	3.42%	04/25/2029	5,236	5,276,232	0.0
Series 2020-1, Class M2(e) . . . . .	2.12%	01/25/2030	15,704	14,820,770	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp.,					
Series 2020-DNA1, Class M1(e) . . . . .	0.83%	01/25/2050	1,143	1,142,934	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 3119, Class PI(e) (f) . . . . .	7.09%	02/15/2036	5,143	1,337,659	0.0
Series 3725, Class CS(e) (f) . . . . .	5.89%	05/15/2040	36,462	5,145,468	0.0
Series 3898, Class NS(e) (f) . . . . .	5.82%	07/15/2041	8,310	1,536,799	0.0
Series 3921, Class SB(e) (f) . . . . .	6.45%	09/15/2041	17,131	4,225,112	0.0
Series 3928, Class SE(e) (f) . . . . .	6.47%	09/15/2041	15,425	3,688,272	0.0
Series 4125, Class SA(e) (f) . . . . .	6.04%	11/15/2042	10,190	2,047,533	0.0
Series 4248, Class SL(e) (f) . . . . .	5.94%	05/15/2041	3,009	552,994	0.0
Series 4292, Class S(e) (f) . . . . .	5.94%	01/15/2044	4,311	823,125	0.0
Series 4317, Class SD(e) (f) . . . . .	7.09%	08/15/2035	9,600	2,268,219	0.0
Series 4372, Class JS(e) (f) . . . . .	5.99%	08/15/2044	24,726	5,053,694	0.0
Series 4373, Class SA(e) (f) . . . . .	6.04%	08/15/2044	13,625	3,107,543	0.0
Series 4494, Class SL(e) (f) . . . . .	6.11%	07/15/2045	45,062	10,579,431	0.1
Series 4495, Class SA(e) (f) . . . . .	6.04%	07/15/2045	11,149	2,527,599	0.0
Series 4570, Class ST(e) (f) . . . . .	5.89%	04/15/2046	12,034	2,866,211	0.0
Series 4585, Class DS(e) (f) . . . . .	5.89%	05/15/2046	22,266	5,355,418	0.0
Series 4593, Class SA(e) (f) . . . . .	5.89%	06/15/2046	15,645	3,741,929	0.0
Series 4656, Class SK(e) (f) . . . . .	5.94%	02/15/2047	12,793	2,686,466	0.0
Series 4707, Class LS(e) (f) . . . . .	6.04%	08/15/2047	17,416	3,324,667	0.0
Series 4719, Class SA(e) (f) . . . . .	6.04%	09/15/2047	14,628	2,851,882	0.0
Series 4719, Class SB(e) (f) . . . . .	6.04%	09/15/2047	24,511	5,783,066	0.0
Series 4727, Class AS(e) (f) . . . . .	6.09%	11/15/2047	22,944	5,070,963	0.0
Series 4735, Class SA(e) (f) . . . . .	6.09%	12/15/2047	35,964	9,093,781	0.1
Series 4736, Class LS(e) (f) . . . . .	6.09%	12/15/2047	15,771	3,463,720	0.0
Series 4736, Class SM(e) (f) . . . . .	6.09%	12/15/2047	33,403	6,975,774	0.1
Series 4754, Class QS(e) (f) . . . . .	6.04%	02/15/2048	22,172	4,463,070	0.0
Series 4767, Class SB(e) (f) . . . . .	6.09%	03/15/2048	9,857	1,868,050	0.0
Series 4824, Class KS(e) (f) . . . . .	6.09%	09/15/2048	9,989	1,769,263	0.0
Series 4906, Class SA(e) (f) . . . . .	5.93%	09/25/2049	44,706	9,303,130	0.1
Series 4906, Class SN(e) (f) . . . . .	5.93%	09/25/2049	33,277	7,555,115	0.1
Series 4927, Class SJ(e) (f) . . . . .	5.93%	11/25/2049	28,678	5,976,734	0.0
Series 4932, Class SM(e) (f) . . . . .	5.93%	06/25/2049	45,048	7,383,095	0.1
Series 4981, Class HS(e) (f) . . . . .	5.98%	06/25/2050	137,888	23,578,733	0.1
Series 4981, Class JS(e) (f) . . . . .	5.98%	06/25/2050	234,739	38,059,351	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2016-HQA3, Class M3(e) . . . . .	3.98%	03/25/2029	3,097	3,199,338	0.0
Series 2017-DNA1, Class B1(e) . . . . .	5.08%	07/25/2029	1,500	1,618,536	0.0
Series 2017-DNA2, Class B1(e) . . . . .	5.27%	10/25/2029	2,809	3,046,319	0.0
Series 2020-HQA2, Class M2(e) . . . . .	3.23%	03/25/2050	2,754	2,772,959	0.0
Federal National Mortgage Association					
Connecticut Avenue Securities,					
Series 2014-C03, Class 2M2(e) . . . . .	3.03%	07/25/2024	1,187	1,200,165	0.0
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2005-58, Class IK(e) (f) . . . . .	5.88%	07/25/2035	9,144	2,121,160	0.0
Series 2006-8, Class JH(e) (f) . . . . .	6.48%	03/25/2036	12,852	3,001,018	0.0
Series 2011-146, Class SA(e) (f) . . . . .	5.88%	01/25/2042	13,421	2,637,777	0.0
Series 2012-122, Class LS(e) (f) . . . . .	5.98%	11/25/2042	11,043	2,618,676	0.0
Series 2012-122, Class MS(e) (f) . . . . .	5.98%	11/25/2042	12,720	2,947,471	0.0
Series 2012-17, Class ES(e) (f) . . . . .	6.43%	03/25/2041	1,986	265,383	0.0
Series 2012-17, Class SE(e) (f) . . . . .	5.83%	03/25/2042	10,199	2,606,814	0.0
Series 2012-7, Class QS(e) (f) . . . . .	5.88%	02/25/2042	16,256	3,377,209	0.0
Series 2012-70, Class HS(e) (f) . . . . .	5.88%	07/25/2042	19,108	3,996,608	0.0
Series 2013-15, Class SA(e) (f) . . . . .	6.03%	03/25/2043	10,462	2,382,956	0.0
Series 2013-4, Class ST(e) (f) . . . . .	6.03%	02/25/2043	11,019	2,191,167	0.0
Series 2013-62, Class SA(e) (f) . . . . .	6.58%	06/25/2043	16,914	4,000,645	0.0
Series 2014-17, Class SB(e) (f) . . . . .	5.93%	04/25/2044	12,676	3,036,824	0.0
Series 2014-28, Class SB(e) (f) . . . . .	5.93%	05/25/2044	12,172	2,766,052	0.0
Series 2014-35, Class CS(e) (f) . . . . .	6.03%	06/25/2044	17,326	3,506,974	0.0
Series 2014-40, Class HS(e) (f) . . . . .	6.58%	07/25/2044	7,837	2,072,338	0.0
Series 2014-78, Class SA(e) (f) . . . . .	5.98%	12/25/2044	6,444	1,374,464	0.0
Series 2014-88, Class BS(e) (f) . . . . .	6.03%	01/25/2045	12,494	2,773,357	0.0
Series 2015-26, Class SH(e) (f) . . . . .	6.33%	05/25/2045	17,068	3,444,944	0.0
Series 2015-57, Class AS(e) (f) . . . . .	6.13%	08/25/2045	59,189	11,671,180	0.1



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2015-90, Class SL(e) (f) . . . . .	6.03%	12/25/2045	USD 13,889	\$ 3,316,669	0.0%
Series 2016-29, Class SA(e) (f) . . . . .	5.88%	05/25/2046	17,552	3,829,556	0.0
Series 2016-60, Class SA(e) (f) . . . . .	5.98%	09/25/2046	36,521	7,055,911	0.1
Series 2016-65, Class AS(e) (f) . . . . .	5.98%	09/25/2046	15,781	3,481,768	0.0
Series 2016-89, Class SH(e) (f) . . . . .	5.88%	12/25/2046	8,524	1,676,657	0.0
Series 2017-105, Class SE(e) (f) . . . . .	6.03%	01/25/2048	59,134	13,790,913	0.1
Series 2017-109, Class SJ(e) (f) . . . . .	6.08%	01/25/2048	5,858	1,035,359	0.0
Series 2017-112, Class SA(e) (f) . . . . .	6.03%	01/25/2048	19,231	3,359,941	0.0
Series 2017-20, Class SJ(e) (f) . . . . .	5.98%	04/25/2047	38,866	8,649,770	0.1
Series 2017-26, Class TS(e) (f) . . . . .	5.83%	04/25/2047	11,762	2,806,932	0.0
Series 2017-35, Class LS(e) (f) . . . . .	6.03%	05/25/2047	38,355	9,316,870	0.1
Series 2017-38, Class DS(e) (f) . . . . .	6.08%	05/25/2047	19,299	2,321,491	0.0
Series 2017-38, Class SE(e) (f) . . . . .	5.98%	05/25/2047	30,316	6,339,635	0.0
Series 2017-49, Class SP(e) (f) . . . . .	6.03%	07/25/2047	10,291	2,478,892	0.0
Series 2017-81, Class CS(e) (f) . . . . .	6.08%	10/25/2047	14,130	2,743,621	0.0
Series 2017-85, Class HS(e) (f) . . . . .	6.08%	11/25/2047	18,791	4,413,882	0.0
Series 2018-13, Class SG(e) (f) . . . . .	6.03%	03/25/2048	12,942	2,537,802	0.0
Series 2018-28, Class PS(e) (f) . . . . .	6.08%	05/25/2048	22,937	4,640,083	0.0
Series 2018-28, Class SB(e) (f) . . . . .	6.08%	05/25/2048	23,130	4,984,387	0.0
Series 2018-30, Class SA(e) (f) . . . . .	6.08%	05/25/2048	24,786	4,831,073	0.0
Series 2018-32, Class SB(e) (f) . . . . .	6.08%	05/25/2048	21,206	4,930,273	0.0
Series 2018-39, Class AS(e) (f) . . . . .	6.08%	06/25/2048	12,060	2,646,052	0.0
Series 2018-45, Class SL(e) (f) . . . . .	6.08%	06/25/2048	14,564	3,576,107	0.0
Series 2018-47, Class SD(e) (f) . . . . .	6.08%	07/25/2048	35,590	6,567,690	0.0
Series 2018-63, Class KS(e) (f) . . . . .	6.08%	09/25/2048	10,753	1,806,346	0.0
Series 2018-96, Class SC(e) (f) . . . . .	5.93%	10/25/2035	8,297	1,624,168	0.0
Series 2019-13, Class SA(e) (f) . . . . .	5.88%	04/25/2049	23,577	3,896,437	0.0
Series 2019-25, Class SA(e) (f) . . . . .	5.93%	06/25/2049	46,235	10,275,813	0.1
Series 2019-31, Class SJ(e) (f) . . . . .	5.98%	07/25/2049	8,456	1,993,747	0.0
Series 2019-37, Class US(e) (f) . . . . .	5.93%	07/25/2049	20,821	3,229,417	0.0
Series 2019-38, Class SM(e) (f) . . . . .	5.93%	07/25/2049	11,557	2,378,793	0.0
Series 2019-42, Class SQ(e) (f) . . . . .	5.93%	08/25/2049	36,304	6,665,036	0.0
Series 2019-48, Class SA(e) (f) . . . . .	6.08%	12/25/2039	30,802	7,607,786	0.1
Series 2019-48, Class SM(e) (f) . . . . .	5.93%	07/25/2039	12,007	3,009,399	0.0
Series 2019-60, Class SJ(e) (f) . . . . .	5.93%	10/25/2049	31,628	6,669,077	0.1
Series 2019-65, Class SY(e) (f) . . . . .	5.93%	11/25/2049	20,053	4,414,619	0.0
Series 2020-26, Class GS(e) (f) . . . . .	5.88%	05/25/2050	18,299	3,350,485	0.0
<b>Government National Mortgage Association</b>					
Series 2014-160, Class SP(e) (f) . . . . .	5.49%	10/20/2044	21,138	4,092,397	0.0
Series 2017-103, Class SL(e) (f) . . . . .	6.09%	07/20/2047	28,151	5,689,428	0.0
Series 2017-115, Class SA(e) (f) . . . . .	6.09%	07/20/2047	19,805	4,391,944	0.0
Series 2017-122, Class SA(e) (f) . . . . .	6.09%	08/20/2047	25,967	5,619,343	0.0
Series 2017-134, Class SE(e) (f) . . . . .	6.09%	09/20/2047	13,169	2,534,099	0.0
Series 2017-149, Class SG(e) (f) . . . . .	6.09%	10/20/2047	18,850	3,788,728	0.0
Series 2017-52, Class SN(e) (f) . . . . .	6.04%	04/20/2047	7,740	1,397,401	0.0
Series 2020-47, Class SG(e) (f) . . . . .	5.89%	02/20/2049	23,147	4,413,691	0.0
<b>Home Re Ltd.</b>					
Series 2018-1, Class M2(e) . . . . .	3.13%	10/25/2028	1,062	1,071,449	0.0
Series 2019-1, Class M2(e) . . . . .	3.38%	05/25/2029	5,400	5,298,260	0.0
<b>Radnor Re Ltd.</b>					
Series 2018-1, Class M2(e) . . . . .	2.83%	03/25/2028	9,240	9,311,475	0.1
Series 2019-1, Class M2(e) . . . . .	3.33%	02/25/2029	12,181	12,295,449	0.1
				<u>530,122,193</u>	<u>2.0</u>
<b>FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE</b>					
<b>Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs</b>					
Series 4398, Class IO(g) . . . . .	6.00%	10/15/2037	19,372	4,178,228	0.0
Series 4913, Class IO(g) . . . . .	6.00%	04/15/2041	8,898	2,067,733	0.0
Series 4933, Class IO(g) . . . . .	5.00%	03/15/2049	10,947	1,897,162	0.0
Series 4941, Class IO(g) . . . . .	4.00%	12/15/2047	45,865	6,634,271	0.1
Series 4976, Class MI(g) . . . . .	4.50%	05/25/2050	52,816	8,582,059	0.1
Series 4981, Class MI(g) . . . . .	5.00%	06/25/2050	52,609	8,314,901	0.1
Series 4987, Class IC(g) . . . . .	4.50%	06/25/2050	208,862	30,869,837	0.1
Series 4993, Class LI(g) . . . . .	5.00%	07/25/2050	25,760	3,895,931	0.0
Series 5008, Class AI(g) . . . . .	3.50%	09/25/2050	20,372	3,632,030	0.0
Series 5011, Class MI(g) . . . . .	3.00%	09/25/2050	18,512	2,996,155	0.0
Series 5013, Class JI(g) . . . . .	4.00%	09/25/2050	48,619	6,508,012	0.1
Series 5015, Class BI(g) . . . . .	4.00%	09/25/2050	31,474	5,438,388	0.0
Series 5018, Class AI(g) . . . . .	4.00%	10/25/2050	16,528	2,860,217	0.0
Series 5018, Class GI(g) . . . . .	4.50%	10/25/2050	31,890	4,976,043	0.0
Series 5024, Class DI(g) . . . . .	4.00%	10/25/2050	7,725	1,277,792	0.0
Series 5030, Class EI(g) . . . . .	3.50%	10/25/2050	7,335	1,312,117	0.0
Series 5036, Class IT(g) . . . . .	4.00%	03/25/2050	11,106	1,797,573	0.0
Series 5040, Class AI(g) . . . . .	3.50%	11/25/2050	3,026	483,476	0.0
Series 5043, Class IO(g) . . . . .	5.00%	11/25/2050	25,605	4,854,129	0.0
Series 5049, Class CI(g) . . . . .	3.50%	12/25/2050	37,834	5,360,719	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 5052, Class IK(g) . . . . .	4.00%	12/25/2050	USD 33,679	\$ 5,199,792	0.0%
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2010-109, Class IM(g) . . . . .	5.50%	09/25/2040	3,379	553,666	0.0
Series 2014-37, Class AI(g) . . . . .	5.50%	07/25/2044	6,366	1,113,698	0.0
Series 2015-22, Class EI(g) . . . . .	6.00%	04/25/2045	27,902	5,296,231	0.0
Series 2016-11, Class GI(g) . . . . .	5.00%	03/25/2046	5,741	1,062,461	0.0
Series 2016-26, Class IO(g) . . . . .	5.00%	05/25/2046	20,327	3,434,264	0.0
Series 2016-33, Class NI(g) . . . . .	5.00%	07/25/2034	22,656	3,784,108	0.0
Series 2016-34, Class AI(g) . . . . .	5.00%	06/25/2046	20,421	3,468,534	0.0
Series 2016-37, Class BI(g) . . . . .	5.00%	06/25/2046	36,302	6,277,092	0.0
Series 2016-64, Class BI(e) (g) . . . . .	5.00%	09/25/2046	34,198	5,670,382	0.0
Series 2018-54, Class IO(g) . . . . .	5.50%	08/25/2048	11,987	2,271,212	0.0
Series 2020-89, Class KI(g) . . . . .	4.00%	12/25/2050	113,147	18,343,639	0.1
Government National Mortgage Association					
Series 2015-62, Class GI(g) . . . . .	6.50%	05/20/2045	22,438	5,075,912	0.0
Series 2019-57, Class IO(g) . . . . .	5.50%	05/20/2049	7,630	1,503,710	0.0
				<u>170,991,474</u>	<u>0.6</u>
				<u>2,771,316,887</u>	<u>10.3</u>
<b>BEHÖRDEN</b>					
<b>SCHULDVERSCHREIBUNGEN VON BEHÖRDEN</b>					
Federal Home Loan Banks . . . . .	3.25%	06/09/2028	34,000	38,689,529	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. . . . .	6.25%	07/15/2032	119,285	176,118,932	0.7
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series GDIF . . . . .	6.75%	09/15/2029	8,750	12,546,510	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. . . . .	6.75%	03/15/2031	65,181	96,446,732	0.4
Federal National Mortgage Association . . . . .	6.25%	05/15/2029	120,037	164,679,080	0.6
Federal National Mortgage Association . . . . .	6.63%	11/15/2030	358,671	521,396,206	1.9
Federal National Mortgage Association . . . . .	7.13%	01/15/2030	142,912	209,730,868	0.8
Federal National Mortgage Association . . . . .	7.25%	05/15/2030	15,000	22,334,567	0.1
Tennessee Valley Authority . . . . .	7.13%	05/01/2030	19,383	28,677,297	0.1
				<u>1,270,619,721</u>	<u>4.7</u>
<b>INVESTMENTGESELLSCHAFTEN</b>					
<b>FONDS UND INVESTMENTTRUSTS</b>					
AB FCPI I - Emerging Markets Debt Portfolio - Class SA . . . . .			606,807	53,477,884	0.2
AB FCPI I - Mortgage Income Portfolio - Class SA . . . . .			1,036,759	83,656,044	0.3
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT . . . . .			3,012,657	324,643,933	1.2
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT . . . . .			3,688,454	56,064,503	0.2
				<u>517,842,364</u>	<u>1.9</u>
<b>HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN</b>					
<b>FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT</b>					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019 . . . . .	3.50%	09/01/2049	USD 7,590	8,240,917	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019 . . . . .	4.00%	08/01/2049	1,081	1,177,797	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019 . . . . .	5.00%	11/01/2049	8,148	9,311,346	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2019 . . . . .	3.50%	10/01/2049	6,392	6,968,136	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019 . . . . .	4.00%	09/01/2049	6,446	7,048,727	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019 . . . . .	4.00%	10/01/2049	10,684	11,721,249	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2021 . . . . .	3.00%	03/01/2051	225,053	234,125,548	0.9
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2021, TBA . . . . .	4.50%	03/01/2051	102,045	110,973,513	0.4
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2021, TBA . . . . .	5.00%	03/01/2051	100,693	111,422,903	0.4
				<u>500,990,136</u>	<u>1.9</u>
<b>QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE</b>					
<b>QUASI-STAATSANLEIHEN</b>					
<b>ASERBAIDSCHAN</b>					
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic . . . . .	6.95%	03/18/2030	21,241	26,776,936	0.1
<b>BAHRAIN</b>					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The) . . . . .	7.50%	10/25/2027	25,539	29,058,593	0.1
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The), Series FEB . . . . .	7.63%	11/07/2024	2,487	2,773,005	0.0
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The) . . . . .	8.38%	11/07/2028	4,380	5,187,563	0.0
				<u>37,019,161</u>	<u>0.1</u>
<b>CHILE</b>					
Corp. Nacional del Cobre de Chile . . . . .	3.75%	01/15/2031	5,181	5,679,671	0.0
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA . . . . .	3.65%	05/07/2030	2,991	3,290,100	0.0
				<u>8,969,771</u>	<u>0.0</u>
<b>INDONESIEN</b>					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT . . . . .	4.75%	05/15/2025	5,426	5,934,688	0.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT . . . . .	5.45%	05/15/2030	4,342	4,971,590	0.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT . . . . .	5.71%	11/15/2023	1,065	1,177,823	0.0
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara . . . . .	3.88%	07/17/2029	17,819	18,771,203	0.1
				<u>30,855,304</u>	<u>0.1</u>
<b>KASACHSTAN</b>					
KazMunayGas National Co. JSC . . . . .	4.75%	04/24/2025	1,395	1,577,222	0.0



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>MALAYSIA</b>					
Petronas Capital Ltd. ....	3.50%	04/21/2030	USD 20,679	\$ 22,661,719	0.1%
<b>MEXIKO</b>					
Petroleos Mexicanos .....	5.95%	01/28/2031	71,699	69,081,986	0.3
Petroleos Mexicanos .....	6.49%	01/23/2027	10,352	10,830,780	0.0
Petroleos Mexicanos .....	6.50%	01/23/2029	1,590	1,598,944	0.0
Petroleos Mexicanos .....	6.75%	09/21/2047	61,080	53,460,270	0.2
Petroleos Mexicanos .....	6.84%	01/23/2030	43,122	43,337,610	0.2
Petroleos Mexicanos .....	6.95%	01/28/2060	29,146	25,502,750	0.1
Petroleos Mexicanos .....	7.69%	01/23/2050	34,014	32,309,899	0.1
				<u>236,122,239</u>	<u>0.9</u>
<b>PANAMA</b>					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA. ....	6.00%	11/18/2048	5,756	6,583,275	0.0
<b>SÜDAFRIKA</b>					
Eskom Holdings SOC Ltd. ....	6.35%	08/10/2028	11,899	12,787,706	0.1
<b>TRINIDAD &amp; TOBAGO</b>					
Trinidad Generation UnLtd. ....	5.25%	11/04/2027	16,768	17,412,520	0.1
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>					
DP World Salaam(d) .....	6.00%	10/01/2025	20,172	21,957,924	0.1
MDGH - GMTN BV, Series G. ....	2.88%	05/21/2030	16,037	16,839,111	0.0
				<u>38,797,035</u>	<u>0.1</u>
				<u>439,562,888</u>	<u>1.6</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>ENERGIE</b>					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC .....	7.63%	11/08/2026	14,994	15,275,137	0.1
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
DP World Crescent Ltd. ....	3.88%	07/18/2029	798	843,885	0.0
DP World PLC .....	5.63%	09/25/2048	3,267	3,885,688	0.0
				<u>4,729,573</u>	<u>0.0</u>
				<u>20,004,710</u>	<u>0.1</u>
				<u>459,567,598</u>	<u>1.7</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>					
<b>NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS</b>					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E. ....	4.65%	02/10/2036	12,568	13,204,418	0.1
Banc of America Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-UBS7, Class AS. ....	3.99%	09/15/2048	2,340	2,574,676	0.0
Series 2016-UB10, Class C. ....	4.87%	07/15/2049	2,354	2,479,766	0.0
Benchmark Mortgage Trust, Series 2019-B11, Class XA(g). ....	1.05%	05/15/2052	222,497	14,833,772	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust,					
Series 2017-C1, Class XA(g) .....	1.01%	11/15/2050	7,923	368,810	0.0
CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(g) .....	1.01%	02/10/2050	104,288	4,898,364	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust,					
Series 2016-C4, Class AM .....	3.69%	05/10/2058	390	423,480	0.0
CGMS Commercial Mortgage Trust,					
Series 2017-B1, Class C .....	4.17%	08/15/2050	9,500	9,798,517	0.1
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2013-GC11, Class D. ....	4.42%	04/10/2046	1,201	1,215,967	0.0
Series 2013-GC11, Class XA(g) .....	1.36%	04/10/2046	7,963	181,519	0.0
Series 2013-GC17, Class C. ....	5.11%	11/10/2046	3,895	3,999,133	0.0
Series 2013-GC17, Class D. ....	5.11%	11/10/2046	5,540	4,974,616	0.0
Series 2015-GC29, Class XA(g) .....	1.04%	04/10/2048	31,777	1,170,994	0.0
Series 2016-C3, Class XA(g) .....	1.14%	11/15/2049	188,177	8,008,458	0.1
Series 2016-P3, Class XA(g) .....	1.70%	04/15/2049	123,089	7,753,990	0.0
Series 2017-P7, Class XA(g) .....	1.11%	04/14/2050	93,103	4,755,342	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-CR2, Class G .....	4.25%	08/15/2045	8,500	2,835,410	0.0
Series 2012-CR5, Class C .....	4.32%	12/10/2045	620	617,907	0.0
Series 2013-CR6, Class C .....	3.78%	03/10/2046	1,888	1,877,978	0.0
Series 2013-CR6, Class D. ....	4.09%	03/10/2046	2,600	2,281,544	0.0
Series 2014-CR15, Class XA(g) .....	0.93%	02/10/2047	8,546	182,836	0.0
Series 2014-CR16, Class D. ....	4.94%	04/10/2047	12,900	12,046,150	0.1
Series 2014-LC17, Class B .....	4.49%	10/10/2047	3,622	3,988,848	0.0
Series 2014-UBS6, Class AM .....	4.05%	12/10/2047	390	425,786	0.0
Series 2015-CR27, Class XA(g) .....	0.91%	10/10/2048	25,532	928,705	0.0
Series 2015-LC21, Class XA(g) .....	0.69%	07/10/2048	76,843	1,924,937	0.0
Series 2016-DC2, Class XA(g) .....	0.96%	02/10/2049	1,826	70,439	0.0
GS Mortgage Securities Corp. II,					
Series 2013-GC10, Class XA(g) .....	1.49%	02/10/2046	30,196	762,781	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class D. ....	5.35%	08/10/2044	3,699	2,259,859	0.0
Series 2012-GC6, Class B. ....	5.65%	01/10/2045	6,000	6,123,151	0.0

**AB FCPI**  
**American Income Portfolio**

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2012-GCJ7, Class A4	3.38%	05/10/2045	USD 601	\$ 608,728	0.0%
Series 2012-GCJ9, Class AS	3.12%	11/10/2045	10,000	10,319,951	0.1
Series 2013-GC12, Class C	4.18%	06/10/2046	2,930	2,917,306	0.0
Series 2013-GC13, Class D	4.08%	07/10/2046	17,538	11,305,000	0.1
Series 2014-GC22, Class C	4.69%	06/10/2047	993	1,045,769	0.0
Series 2016-GS3, Class XA(g)	1.22%	10/10/2049	118,917	6,482,116	0.0
Series 2017-GS5, Class XA(g)	0.81%	03/10/2050	141,881	6,057,711	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(g)	1.12%	08/10/2050	84,120	4,544,589	0.0
<b>JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b>					
Series 2010-C2, Class A3	4.07%	11/15/2043	2,957	2,955,556	0.0
Series 2012-C6, Class E	5.14%	05/15/2045	5,000	3,136,582	0.0
Series 2012-C8, Class AS	3.42%	10/15/2045	1,500	1,547,809	0.0
Series 2012-C8, Class C	4.62%	10/15/2045	9,963	9,137,278	0.1
Series 2012-LC9, Class B	3.81%	12/15/2047	2,000	2,049,416	0.0
Series 2012-LC9, Class E	4.42%	12/15/2047	10,881	8,561,722	0.1
Series 2013-C10, Class B	3.67%	12/15/2047	2,513	2,599,584	0.0
Series 2013-LC11, Class B	3.50%	04/15/2046	11,410	11,397,239	0.1
Series 2016-JP2, Class XA(g)	1.79%	08/15/2049	63,899	4,909,951	0.0
<b>JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust</b>					
Series 2013-C15, Class AS	4.42%	11/15/2045	11,115	12,038,819	0.1
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	9,170	9,628,174	0.1
Series 2014-C22, Class XA(g)	0.83%	09/15/2047	59,034	1,447,831	0.0
Series 2014-C24, Class B	4.12%	11/15/2047	1,355	1,393,905	0.0
Series 2014-C24, Class C	4.41%	11/15/2047	455	437,418	0.0
Series 2014-C26, Class C	4.38%	01/15/2048	4,926	5,151,334	0.0
<b>JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust,</b>					
Series 2017-C5, Class XA(g)	0.93%	03/15/2050	141,691	6,377,570	0.0
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(g)	1.43%	07/12/2050	44,906	2,819,470	0.0
<b>Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust</b>					
Series 2013-C9, Class B	3.71%	05/15/2046	6,310	6,492,380	0.0
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	4,304	4,208,443	0.0
<b>Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2011-C3, Class C</b>					
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C1, Class D	5.57%	05/10/2045	10,900	8,613,797	0.1
Series 2017-C1, Class XA(g)	1.52%	06/15/2050	55,560	4,073,289	0.0
Series 2017-C2, Class XA(g)	1.06%	08/15/2050	47,966	2,459,126	0.0
Series 2017-C4, Class XA(g)	1.05%	10/15/2050	64,551	3,602,485	0.0
Series 2017-C6, Class XA(g)	1.01%	12/15/2050	42,933	2,340,318	0.0
Series 2018-C10, Class XA(g)	0.95%	05/15/2051	131,425	6,871,379	0.0
Series 2018-C15, Class XA(g)	0.94%	12/15/2051	107,491	6,125,002	0.0
<b>UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2012-C4, Class XA(g)	1.60%	12/10/2045	3,323	66,599	0.0
Series 2013-C5, Class C	4.08%	03/10/2046	1,798	1,761,634	0.0
Series 2013-C6, Class D	4.31%	04/10/2046	8,381	6,216,701	0.0
<b>Wells Fargo Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2015-C28, Class B	4.09%	05/15/2048	2,802	2,991,866	0.0
Series 2015-LC20, Class C	4.06%	04/15/2050	7,415	7,528,224	0.0
Series 2015-LC20, Class XA(g)	1.31%	04/15/2050	34,097	1,238,623	0.0
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	5,156	5,657,733	0.0
Series 2016-C32, Class XA(g)	1.21%	01/15/2059	116,138	5,775,001	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(g)	1.65%	10/15/2049	89,883	6,268,236	0.0
Series 2016-LC25, Class XA(g)	0.97%	12/15/2059	139,925	5,108,550	0.0
Series 2017-C38, Class XA(g)	1.02%	07/15/2050	36,537	1,813,736	0.0
Series 2018-C48, Class XA(g)	0.95%	01/15/2052	12,991	787,930	0.0
<b>WF-RBS Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2011-C3, Class C	5.34%	03/15/2044	6,900	6,839,871	0.0
Series 2012-C7, Class AS	4.09%	06/15/2045	265	265,525	0.0
Series 2012-C7, Class XA(g)	1.30%	06/15/2045	7,670	73,647	0.0
Series 2012-C8, Class XA(g)	1.79%	08/15/2045	8,196	130,731	0.0
Series 2013-C11, Class B	3.71%	03/15/2045	1,758	1,828,542	0.0
Series 2013-C14, Class B	3.84%	06/15/2046	360	375,750	0.0
Series 2014-C22, Class XA(g)	0.80%	09/15/2057	44,109	986,436	0.0
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	6,846	7,035,342	0.0
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	9,035	7,996,512	0.1
Series 2014-LC14, Class C	4.34%	03/15/2047	853	886,205	0.0
				367,129,980	1.4
<b>NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS</b>					
DBWF Mortgage Trust, Series 2018-GLKS, Class E(e)	3.13%	12/19/2030	9,010	8,931,281	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class D(e)	4.11%	05/15/2036	9,789	6,677,248	0.0
Starwood Retail Property Trust, Series 2014-STAR, Class A(e)	1.58%	11/15/2027	36,183	26,775,522	0.1
				42,384,051	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>STAATLICHE CMBS</b>					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates					
Series K072, Class A2	3.44%	12/25/2027	USD 12,923	\$ 14,655,793	0.1%
Series K073, Class A2	3.35%	01/25/2028	11,000	12,422,022	0.0
				<u>27,077,815</u>	<u>0.1</u>
				436,591,846	1.6
<b>SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE</b>					
<b>BAHRAIN</b>					
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	16,444	16,361,780	0.1
Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031	18,000	18,180,000	0.1
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	16,489	18,179,123	0.0
Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028	20,898	23,693,212	0.1
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030	7,799	8,868,925	0.0
CBB International Sukuk Programme Co. SPC	4.50%	03/30/2027	3,414	3,548,426	0.0
CBB International Sukuk Programme Co. SPC	6.25%	11/14/2024	9,317	10,271,993	0.1
				<u>99,103,459</u>	<u>0.4</u>
<b>OMAN</b>					
Oman Government International Bond	4.75%	06/15/2026	47,000	47,749,062	0.2
Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	60,335	62,522,144	0.2
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	17,194	18,096,685	0.1
Oman Government International Bond	6.50%	03/08/2047	5,000	4,718,750	0.0
				<u>133,086,641</u>	<u>0.5</u>
				232,190,100	0.9
<b>ABS-ANLEIHEN</b>					
<b>AUTOS – FESTVERZINSLICH</b>					
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC,					
Series 2019-2A, Class C	4.24%	09/22/2025	4,000	4,307,930	0.0
CPS Auto Receivables Trust					
Series 2016-B, Class E	8.14%	05/15/2023	2,000	2,031,749	0.0
Series 2016-C, Class E	8.39%	09/15/2023	8,840	8,951,282	0.1
CPS Auto Trust					
Series 2016-D, Class E	6.86%	04/15/2024	1,687	1,714,554	0.0
Series 2017-A, Class E	7.07%	04/15/2024	6,800	7,013,895	0.0
Exeter Automobile Receivables Trust					
Series 2016-3A, Class D	6.40%	07/17/2023	4,260	4,327,083	0.0
Series 2017-1A, Class D	6.20%	11/15/2023	11,000	11,317,870	0.1
Series 2017-3A, Class D	5.28%	10/15/2024	11,280	11,763,742	0.1
Series 2018-4A, Class E	5.38%	07/15/2025	13,125	13,965,995	0.1
First Investors Auto Owner Trust, Series 2018-1A, Class E	5.35%	07/15/2024	3,100	3,255,375	0.0
Flagship Credit Auto Trust					
Series 2016-3, Class E	6.25%	10/15/2023	3,400	3,450,508	0.0
Series 2016-4, Class E	6.44%	01/16/2024	3,435	3,532,959	0.0
Series 2017-1, Class E	6.46%	12/15/2023	6,260	6,471,309	0.0
Series 2018-2, Class E	5.51%	11/17/2025	3,850	4,090,227	0.0
Series 2018-3, Class D	4.15%	12/16/2024	2,550	2,689,238	0.0
Series 2018-4, Class E	5.51%	03/16/2026	10,085	10,966,909	0.1
Series 2019-1, Class E	5.06%	06/15/2026	5,339	5,635,658	0.0
Series 2019-2, Class E	4.52%	12/15/2026	5,677	6,002,110	0.0
Series 2019-3, Class E	3.84%	12/15/2026	5,230	5,495,722	0.0
				<u>116,984,115</u>	<u>0.5</u>
<b>SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS</b>					
CLUB Credit Trust, Series 2017-P2, Class C	4.91%	01/15/2024	5,519	5,566,730	0.0
Consumer Loan Underlying Bond CLUB Credit Trust,					
Series 2019-P2, Class B	2.83%	10/15/2026	6,150	6,238,698	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust					
Series 2018-P1, Class C	5.21%	07/15/2025	14,065	14,370,227	0.1
Series 2018-P2, Class C	5.21%	10/15/2025	5,500	5,556,752	0.0
Marlette Funding Trust					
Series 2017-3A, Class D	5.03%	12/15/2024	2,398	2,399,170	0.0
Series 2018-1A, Class D	4.85%	03/15/2028	17,860	17,875,642	0.1
Series 2018-2A, Class C	4.37%	07/17/2028	3,176	3,215,984	0.0
Series 2018-3A, Class C	4.63%	09/15/2028	26,752	27,138,301	0.1
Series 2018-4A, Class C	4.91%	12/15/2028	10,475	10,703,496	0.1
SoFi Consumer Loan Program LLC					
Series 2017-4, Class B	3.59%	05/26/2026	4,750	4,819,655	0.0
Series 2017-6, Class C	4.02%	11/25/2026	9,855	10,148,385	0.0
SoFi Consumer Loan Program Trust, Series 2018-2, Class C	4.25%	04/26/2027	6,200	6,435,399	0.0
				<u>114,468,439</u>	<u>0.4</u>
				231,452,554	0.9

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Consolidated Energy Finance SA .....	6.88%	06/15/2025	USD 8,756	\$ 8,935,006	0.0%
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Melco Resorts Finance Ltd.....	5.38%	12/04/2029	12,622	13,294,500	0.1
Melco Resorts Finance Ltd.....	5.63%	07/17/2027	9,002	9,471,933	0.0
MGM China Holdings Ltd.....	5.25%	06/18/2025	8,970	9,413,680	0.0
MGM China Holdings Ltd.....	5.38%	05/15/2024	4,527	4,664,259	0.0
MGM China Holdings Ltd.....	5.88%	05/15/2026	4,869	5,134,361	0.0
Studio City Finance Ltd.....	5.00%	01/15/2029	30,884	31,347,260	0.1
Wynn Macau Ltd.....	4.88%	10/01/2024	953	962,530	0.0
Wynn Macau Ltd.....	5.50%	01/15/2026	30,257	31,592,207	0.1
Wynn Macau Ltd.....	5.50%	10/01/2027	4,203	4,365,866	0.0
Wynn Macau Ltd.....	5.63%	08/26/2028	16,758	17,566,293	0.1
				<u>127,812,889</u>	<u>0.4</u>
<b>ENERGIE</b>					
Leviathan Bond Ltd.....	6.13%	06/30/2025	5,318	5,816,680	0.0
Leviathan Bond Ltd.....	6.50%	06/30/2027	12,964	14,343,925	0.1
				<u>20,160,605</u>	<u>0.1</u>
				<u>156,908,500</u>	<u>0.5</u>
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd/ Highlands Holdings Bond Co-Issuer, Inc.(b) .....	7.63%	10/15/2025	18,026	19,184,154	0.1
				<u>176,092,654</u>	<u>0.6</u>
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
AGL CLO Ltd., Series 2020-9A, Class D(e) .....	3.94%	01/20/2034	4,250	4,300,396	0.0
AGL CLO Ltd., Series 2021-10A, Class D(e) .....	3.09%	04/15/2034	6,750	6,751,431	0.0
Apidos CLO, Series 2017-26A, Class D(e) .....	6.32%	07/18/2029	5,450	5,378,545	0.0
Apidos CLO, Series 2021-35A, Class D(e) .....	2.84%	04/20/2034	6,000	6,000,642	0.0
Ballyrock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class C(e) .....	3.80%	01/20/2034	8,330	8,343,495	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(e) .....	1.97%	04/26/2031	11,000	10,859,244	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class B(e) .....	3.27%	07/23/2032	8,000	8,003,768	0.0
CBAM Ltd., Series 2017-3A, Class E1(e) .....	6.72%	10/17/2029	11,221	11,023,311	0.1
CIFC Funding Ltd., Series 2017-3A, Class A1(e) .....	1.44%	07/20/2030	560	560,122	0.0
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(e) .....	6.52%	07/18/2030	4,717	4,680,981	0.0
Dryden CLO Ltd., Series 2018-57A, Class A(e) .....	1.20%	05/15/2031	25,195	25,218,053	0.1
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(e) .....	3.29%	07/15/2030	1,500	1,500,294	0.0
Goldentree Loan Opportunities Ltd., Series 2015-11A, Class AR2(e) .....	1.29%	01/18/2031	600	600,128	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(e) .....	2.97%	10/20/2030	6,000	5,915,256	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-31A, Class C(e) .....	2.92%	04/20/2031	3,250	3,253,065	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class D(e) .....	3.82%	01/20/2032	1,000	1,007,404	0.0
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class D(e) .....	5.42%	01/20/2031	2,750	2,533,625	0.0
Romark CLO Ltd., Series 2019-3A, Class A2(e) .....	2.31%	07/15/2032	28,050	28,124,781	0.1
Southwick Park CLO LLC, Series 2019-4A, Class A1(e) .....	1.52%	07/20/2032	4,540	4,551,582	0.0
Symphony CLO Ltd., Series 2021-26A, Class A(e) .....	1.50%	04/20/2029	5,105	5,106,031	0.0
THL Credit Wind River CLO Ltd., Series 2017-4A, Class A(e) .....	1.33%	11/20/2030	6,898	6,904,524	0.0
Venture CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(e) .....	4.22%	07/20/2030	17,169	17,178,981	0.1
Voya CLO Ltd., Series 2016-3A, Class A1R(e) .....	1.41%	10/18/2031	3,000	3,000,510	0.0
				<u>170,796,169</u>	<u>0.6</u>
<b>REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN</b>					
<b>ISRAEL</b>					
Israel Government International Bond.....	2.75%	07/03/2030	43,932	46,816,518	0.2
<b>KATAR</b>					
Qatar Government International Bond.....	3.40%	04/16/2025	8,394	9,162,576	0.0
Qatar Government International Bond.....	3.75%	04/16/2030	16,175	18,267,640	0.1
				<u>27,430,216</u>	<u>0.1</u>
<b>SAUDI-ARABIEN</b>					
Saudi Government International Bond .....	2.90%	10/22/2025	16,949	18,119,540	0.0
Saudi Government International Bond .....	3.25%	10/26/2026	21,000	22,844,063	0.1
Saudi Government International Bond .....	3.25%	10/22/2030	21,344	22,811,400	0.1
				<u>63,775,003</u>	<u>0.2</u>
				<u>138,021,737</u>	<u>0.5</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN</b>					
VEREINIGTE STAATEN					
State of California, Series 2010 .....	7.60%	11/01/2040	USD 1,600	\$ 2,767,680	0.0%
State of Illinois, Series 2010 .....	7.35%	07/01/2035	7,675	9,430,887	0.0
				<u>12,198,567</u>	<u>0.0</u>
<b>VORZUGSAKTIEN</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
VERSICHERUNGEN					
Hartford Financial Services Group, Inc. (The) .....	7.88%		80,075	2,164,427	0.0
				<u>27,184,563,781</u>	<u>100.6</u>
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
Apidos CLO XXIII, Series 2015-23A, Class ER(e) .....	6.44%	04/15/2033	USD 2,248	2,213,918	0.0
Bain Capital Credit CLO, Series 2019-2A, Class C(e) .....	2.97%	10/17/2032	4,750	4,765,832	0.0
CBAM Ltd., Series 2018-7A, Class B1(e) .....	1.82%	07/20/2031	7,726	7,727,437	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2019-1A, Class C(e) .....	2.92%	04/20/2032	2,600	2,603,601	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2019-3A, Class B(e) .....	2.87%	07/16/2032	4,050	4,064,215	0.0
Goldentree Loan Management US CLO 7 Ltd., Series 2020-7A, Class B(e) .....	2.86%	04/20/2031	18,500	18,533,559	0.1
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A1(e) .....	1.25%	04/26/2031	22,100	22,084,375	0.1
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2018-1A, Class A2(e) .....	2.02%	07/21/2031	7,424	7,424,958	0.0
ICG US CLO Ltd., Series 2015-1A, Class CR(e) .....	3.32%	10/19/2028	2,500	2,497,688	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-33A, Class C(e) .....	2.68%	10/16/2032	12,500	12,556,287	0.1
Northwoods Capital Ltd., Series 2018-12BA, Class B(e) .....	2.07%	06/15/2031	5,400	5,312,768	0.0
OCP CLO Ltd., Series 2017-13A, Class A1A(e) .....	1.50%	07/15/2030	25,000	25,004,575	0.1
Octagon Investment Partners 38 Ltd., Series 2018-1A, Class B(e)	2.17%	07/20/2030	3,900	3,890,402	0.0
OZLM Ltd., Series 2014-7RA, Class BR(e) .....	2.42%	07/17/2029	9,000	9,001,341	0.0
OZLM Ltd., Series 2014-7RA, Class CR(e) .....	3.22%	07/17/2029	10,500	10,158,624	0.1
OZLM Ltd., Series 2017-16A, Class B(e) .....	2.74%	05/16/2030	5,000	5,002,185	0.0
OZLM Ltd., Series 2018-18A, Class B(e) .....	1.79%	04/15/2031	3,000	2,996,733	0.0
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class A(e) .....	1.26%	04/15/2031	9,625	9,604,489	0.1
Romark CLO III Ltd., Series 2019-3A, Class B(e) .....	3.04%	07/15/2032	3,500	3,511,288	0.0
Sound Point CLO XIX Ltd., Series 2018-1A, Class A(e) .....	1.24%	04/15/2031	34,104	34,103,898	0.1
TICP CLO IX Ltd., Series 2017-9A, Class B(e) .....	1.82%	01/20/2031	1,550	1,550,561	0.0
Venture CLO Ltd., Series 2017-29A, Class C(e) .....	2.69%	09/07/2030	2,300	2,261,786	0.0
Vibrant CLO XI Ltd., Series 2019-11A, Class B(e) .....	2.82%	07/20/2032	3,000	3,001,989	0.0
Voya CLO Ltd., Series 2016-3A, Class BR(e) .....	2.42%	10/18/2031	10,000	9,937,770	0.1
				<u>209,810,279</u>	<u>0.8</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-CR3, Class D .....	4.75%	10/15/2045	3,971	2,824,241	0.0
Series 2012-CR3, Class E .....	4.75%	10/15/2045	2,959	1,526,900	0.0
Series 2015-PC1, Class C .....	4.32%	07/10/2050	11,346	11,126,015	0.1
CSAIL Commercial Mortgage Trust, Series 2015-C1, Class D ...	3.76%	04/15/2050	12,290	8,422,648	0.1
DBUBS Mortgage Trust, Series 2011-LC2A, Class E .....	5.46%	07/10/2044	9,558	7,976,609	0.1
Grantor Trust CGCMT, Series 2015-GC17(h) .....	4.34%	09/15/2048	105	4,455,893	0.0
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(h) .....	4.32%	03/10/2047	143	4,675,192	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(h) .....	4.00%	04/15/2050	207	5,027,317	0.0
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(h) .....	4.00%	11/15/2047	222	5,918,026	0.0
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(h) .....	3.40%	10/15/2047	125	3,073,983	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2013-GC13, Class E(h) .....	3.49%	07/10/2046	231	9,992,285	0.0
Series 2013-GC13, Class F(h) .....	3.49%	07/10/2046	80	3,651,838	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2014-C21, Class D .....	4.66%	08/15/2047	6,797	6,040,853	0.0
WF-RBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E .....	5.19%	06/15/2044	8,030	4,866,475	0.0
Series 2012-C7, Class E .....	4.80%	06/15/2045	8,500	1,488,320	0.0
Series 2012-C9, Class E .....	4.81%	11/15/2045	5,000	4,403,950	0.0
				<u>85,470,545</u>	<u>0.3</u>
<b>STAMMAKTIEN</b>					
Mt. Logan Re Ltd. (Preference Shares) (Series 1)(h) .....			68,787	69,249,564	0.3
<b>SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>ENERGIE</b>					
Empresa Electrica Cochrane SpA .....	5.50%	05/14/2027	USD 11,007	11,643,276	0.1



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	USD 8,603	\$ 8,939,055	0.0%
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Industrias Penoles SAB de CV	5.65%	09/12/2049	4,016	4,696,712	0.0
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Tonon Luxembourg SA(b) (c) (h)	6.50%	10/31/2024	4,577	137,779	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(i)	10.50%	01/28/2022	3,700	40,400	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(e)	11.75%	02/09/2022	31,238	156,580	0.0
				<u>334,759</u>	<u>0.0</u>
				<u>25,613,802</u>	<u>0.1</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	3.75%	01/14/2028	7,817	8,300,677	0.0
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	7,314	7,537,709	0.0
				<u>15,838,386</u>	<u>0.0</u>
				<u>41,452,188</u>	<u>0.1</u>
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
JP Morgan Madison Avenue Securities Trust, Series 2015-CH1, Class M2(e)	5.62%	10/25/2025	890	817,065	0.0
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R, Class A(e)	2.48%	02/27/2023	35,215	34,769,418	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust, Series 2015-WF1, Class 1M2(e)	5.38%	11/25/2025	973	955,838	0.0
				<u>36,542,321</u>	<u>0.1</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
ABN AMRO Bank NV	4.80%	04/18/2026	7,000	8,024,426	0.0
ABN AMRO Bank NV	7.75%	05/15/2023	7,651	8,679,389	0.1
				<u>16,703,815</u>	<u>0.1</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
AIG Life Holdings, Inc.	8.13%	03/15/2046	354	518,543	0.0
				<u>17,222,358</u>	<u>0.1</u>
				<u>459,747,255</u>	<u>1.7</u>
<b>Gesamtanlagen</b>				<u>\$ 27,644,311,036</u>	<u>102.3%</u>
(Kosten \$27,488,610,523)					
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(j)	0.00 %	–		201,823,094	0.8
Bank of Nova Scotia, Toronto(j)	0.00 %	–		34,308	0.0
BBH, Grand Cayman(j)	(0.30)%	–		145	0.0
BBH, Grand Cayman(j)	0.01 %	–		5,454	0.0
BBH, Grand Cayman(j)	0.07 %	–		1,500	0.0
BNP Paribas, Paris(j)	(0.06)%	–		60,384	0.0
BNP Paribas, Paris(j)	2.80 %	–		242,547	0.0
HSBC Continental Europe, Paris(j)	(0.71)%	–		97,220	0.0
Sumitomo, Tokyo(j)	0.00 %	–		40,723	0.0
<b>Termineinlagen insgesamt</b>				<u>202,305,375</u>	<u>0.8</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b>				<u>(835,848,060)</u>	<u>(3.1)</u>
<b>Nettovermögen</b>				<u>\$ 27,010,768,351</u>	<u>100.0%</u>

**TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Long</b>					
U.S. Long Bond (CBT) Futures	06/21/2021	2,551	\$ 409,687,211	\$ 406,167,031	\$ (3,520,180)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	06/21/2021	13,487	1,812,199,586	1,789,977,781	(22,221,805)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	06/21/2021	61	11,576,078	11,532,813	(43,265)
<b>Short</b>					
U.S. 10 Yr Ultra Bond Futures	06/21/2021	1,735	258,064,219	255,641,406	2,422,813
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	06/30/2021	1,990	439,665,781	439,323,596	342,185
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	06/30/2021	3,764	470,926,711	466,618,375	4,308,336
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures+	06/21/2021	81	10,885,547	10,750,219	135,328
					<u>\$ (18,576,588)</u>
				Wertsteigerung	\$ 7,208,662
				Wertminderung	\$ (25,785,250)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.



DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	85,861	CAD	109,918	03/05/2021	\$ 512,309
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	24,450	CHF	21,971	03/05/2021	(294,242)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	170,634	EUR	141,991	03/05/2021	695,434
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	18,511	JPY	1,943,338	03/05/2021	(279,942)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	174,962	NZD	243,022	03/05/2021	634,600
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	32,021	PLN	118,758	03/05/2021	(324,144)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	229,407	SGD	305,777	03/05/2021	(88,919)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	110,041	ZAR	1,646,112	03/05/2021	(1,291,673)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	953,849	AUD	1,231,325	03/12/2021	(6,372,690)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	2,345	AUD	3,054	03/12/2021	5,318
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	165,585	CAD	210,131	03/12/2021	(461,204)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	110,409	CNH	710,295	03/12/2021	(870,925)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	267,984	GBP	193,481	03/12/2021	1,587,649
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	851,486	AUD	1,077,716	03/25/2021	(22,153,573)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	165,585	CAD	208,859	03/25/2021	(1,453,919)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	110,726	CNH	716,898	03/25/2021	(286,778)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	176,353	EUR	145,098	03/25/2021	(1,175,426)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	267,983	GBP	190,377	03/25/2021	(2,705,280)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	258,481	SGD	341,541	03/25/2021	(2,359,643)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD	85,460	ZAR	1,258,024	03/25/2021	(2,607,024)
						\$ (39,290,072)
					Wertsteigerung	\$ 3,435,310
					Wertminderung	\$ (42,725,382)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Verkaufskontrakte</b>					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 5,000	\$ (336,500)	\$ (260,780)
Goldman Sachs International/(INTRCONX)	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(336,500)	(260,780)
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 33, 5 Year Index	12/20/2024	44,507	(3,896,967)	120,532
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 33, 5 Year Index	12/20/2024	12,193	1,067,598	173,057
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 33, 5 Year Index	12/20/2024	175,488	15,365,386	18,135,589
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 34, 5 Year Index	06/20/2025	470,328	39,231,228	16,414,409
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	12/20/2025	36,379	3,015,910	(174,938)
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	12/20/2025	1,512,852	125,419,213	69,453,466
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	12/20/2025	10,749	891,119	(49,002)
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Republic of Colombia	06/21/2025	24,264	(142,692)	1,109,660
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Russian Federation	06/20/2025	24,264	143,623	1,117,697
Insgesamt				\$ 180,421,418	\$ 105,778,910
				Wertsteigerung	\$ 106,524,410
				Wertminderung	\$ (745,500)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	USD 453,010	04/20/2023	2.850%	3 Month LIBOR	\$ (25,142,956)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	58,460	06/28/2026	1.460%	3 Month LIBOR	(1,600,127)
Insgesamt					\$ (26,743,083)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Verkaufskontrakte</b>						
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 5,000	\$ (2,156,500)	\$ (97,917)	\$ (2,058,583)
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,180,000)	(387,944)	(5,792,056)
Citigroup Global Markets, Inc	BondABS.Towd	04/25/2057	47,975	(293,156)	0	(293,156)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	500	(33,650)	291	(33,941)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 10,000	\$ (673,000)	\$ (191,852)	\$ (481,148)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(673,000)	(177,265)	(495,735)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	20,000	(1,346,000)	(395,932)	(950,068)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,626	(701,294)	(305,494)	(395,800)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,253	(1,403,019)	(616,033)	(786,986)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,253	(1,403,019)	(613,135)	(789,884)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,253	(1,403,019)	(600,591)	(802,428)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,667	(2,012,877)	(557,474)	(1,455,403)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(100,338)	(2,056,162)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(107,571)	(2,048,929)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(107,571)	(2,048,929)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(97,975)	(2,058,525)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(815,443)	(1,341,057)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(739,144)	(1,417,356)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(839,644)	(1,316,856)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	8,000	(3,450,400)	(1,530,594)	(1,919,806)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	257	(63,530)	(31,545)	(31,985)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	311	(76,879)	(19,197)	(57,682)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	366	(90,475)	(44,755)	(45,720)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	840	(207,648)	(110,905)	(96,743)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,933	(477,838)	(121,172)	(356,666)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,000	(494,400)	(201,210)	(293,190)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(434,458)	(801,542)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(305,871)	(930,129)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(1,506,322)	270,322
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(1,617,055)	381,055
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,000	(1,483,200)	(493,291)	(989,909)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,679	(1,651,049)	(1,766,539)	115,490
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,663	(2,141,494)	(763,276)	(1,378,218)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,689	(2,395,121)	(598,059)	(1,797,062)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(603,002)	(1,868,998)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(626,861)	(1,845,139)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,003,705)	(1,468,295)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,018,531)	(1,453,469)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,015,956)	(1,456,044)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(947,642)	(1,524,358)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(858,717)	(1,613,283)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(3,061,630)	589,630
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(3,037,330)	565,330
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(996,935)	(1,475,065)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	12,524	(3,095,933)	(3,066,339)	(29,594)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	12,524	(3,095,933)	(3,035,675)	(60,258)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(3,708,000)	(2,137,101)	(1,570,899)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(3,708,000)	(1,384,053)	(2,323,947)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(3,708,000)	(1,226,826)	(2,481,174)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	16,698	(4,127,744)	(4,047,405)	(80,339)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	18,067	(4,466,162)	(1,132,550)	(3,333,612)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,337	(4,780,106)	(1,676,511)	(3,103,595)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,000	(4,944,000)	(1,852,607)	(3,091,393)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,000	(4,944,000)	(1,864,894)	(3,079,106)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,180,000)	(473,524)	(5,706,476)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,180,000)	(2,341,446)	(3,838,554)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,180,000)	(2,341,442)	(3,838,558)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,180,000)	(2,170,791)	(4,009,209)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,180,000)	(1,670,563)	(4,509,437)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	30,000	(7,416,000)	(2,480,645)	(4,935,355)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	34,700	(8,577,840)	(2,131,594)	(6,446,246)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	50,000	(12,360,000)	(4,682,893)	(7,677,107)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	50,000	(12,360,000)	(3,323,265)	(9,036,735)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	2,477	(166,702)	(96,184)	(70,518)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,640	(244,972)	(146,208)	(98,764)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	4,465	(300,495)	(170,801)	(129,694)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	4,853	(326,607)	(192,198)	(134,409)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	4,955	(333,472)	(196,056)	(137,416)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,100	(679,730)	(103,848)	(575,882)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	12,387	(833,645)	(480,999)	(352,646)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,500	(1,940,850)	(415,515)	(1,525,335)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(93,136)	(2,063,364)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,500	(4,097,350)	(910,052)	(3,187,298)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	10,000	(4,313,000)	(200,676)	(4,112,324)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,340	(578,448)	(29,915)	(548,533)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,614	(1,634,981)	(532,780)	(1,102,201)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 7,600	\$ (1,878,720)	\$ (302,237)	\$ (1,576,483)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(53,957)	(2,418,043)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(526,235)	(1,945,765)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(531,035)	(1,940,965)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,266,098)	(1,205,902)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	11,544	(2,853,677)	(643,016)	(2,210,661)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,000	(4,944,000)	(1,600,443)	(3,343,557)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,180,000)	(953,857)	(5,226,143)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	34,200	(8,454,240)	(693,140)	(7,761,100)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(336,500)	(190,667)	(145,833)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	318	(78,610)	(32,841)	(45,769)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,082	(1,009,070)	(421,569)	(587,501)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,159	(1,028,105)	(290,219)	(737,886)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(770,466)	(1,701,534)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,426	(4,802,107)	(1,401,907)	(3,400,200)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	2,500	(168,250)	1,457	(169,707)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(336,500)	(98,983)	(237,517)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,269	(1,409,920)	(625,954)	(783,966)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	82,500	(35,582,250)	(15,536,269)	(20,045,981)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,290	(1,060,488)	(304,168)	(756,320)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(677,363)	(558,637)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(702,301)	(533,699)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,385,914)	(1,086,086)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	11,154	(2,757,269)	(798,199)	(1,959,070)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	11,300	(2,793,360)	(1,209,537)	(1,583,823)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,000	(4,944,000)	(1,272,678)	(3,671,322)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,000	(4,944,000)	(2,709,451)	(2,234,549)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	98,466	(24,340,795)	(11,725,452)	(12,615,343)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	234,658	(58,007,458)	(25,655,595)	(32,351,863)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(336,500)	(106,257)	(230,243)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(336,500)	(53,046)	(283,454)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(336,500)	(46,854)	(289,646)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	7,042	(473,927)	(276,246)	(197,681)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	8,283	(557,446)	(174,690)	(382,756)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(673,000)	(374,108)	(298,892)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(673,000)	(413,796)	(259,204)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	25,000	(1,682,500)	(887,579)	(794,921)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	374	(161,306)	(71,555)	(89,751)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,012	(867,776)	(382,520)	(485,256)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,246	(1,400,000)	(611,812)	(788,188)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,246	(1,400,000)	(609,376)	(790,624)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(743,737)	(1,412,763)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(748,279)	(1,408,221)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,000	(3,019,100)	(914,857)	(2,104,243)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	10,000	(4,313,000)	(1,788,488)	(2,524,512)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	12,470	(5,378,311)	(2,321,506)	(3,056,805)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	12,979	(5,597,843)	(2,400,326)	(3,197,517)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,500	(865,200)	(379,961)	(485,239)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(567,519)	(668,481)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(510,596)	(725,404)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(760,830)	(475,170)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(667,568)	(568,432)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(544,111)	(691,889)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(544,765)	(691,235)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(503,026)	(732,974)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(475,665)	(760,335)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(437,928)	(798,072)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,452	(1,594,934)	(851,853)	(743,081)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,500	(1,606,800)	(709,044)	(897,756)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,972	(1,723,478)	(888,344)	(835,134)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,227,751)	(1,244,249)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,032,292)	(1,439,708)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,521,660)	(950,340)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,518,133)	(953,867)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,544,430)	(927,570)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(1,509,131)	(962,869)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	12,870	(3,181,462)	(894,387)	(2,287,075)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(3,708,000)	(919,389)	(2,788,611)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,180,000)	(3,367,419)	(2,812,581)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,180,000)	(2,309,603)	(3,870,397)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	30,000	(7,416,000)	(2,605,546)	(4,810,454)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	50,000	(12,360,000)	(4,551,948)	(7,808,052)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 50,000	\$ (12,360,000)	\$ (4,200,954)	\$ (8,159,046)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	325	(21,895)	(13,090)	(8,805)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(673,000)	(191,852)	(481,148)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,333	(1,006,223)	(280,447)	(725,776)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(90,734)	(2,065,766)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(95,381)	(2,061,119)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,000	(2,156,500)	(85,573)	(2,070,927)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	10,000	(4,313,000)	(190,961)	(4,122,039)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	10,000	(4,313,000)	(195,643)	(4,117,357)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,236,000)	(702,301)	(533,699)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,529	(1,613,969)	(447,815)	(1,166,154)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,700	(1,903,440)	(1,007,173)	(896,267)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(133,509)	(2,338,491)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(154,664)	(2,317,336)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,472,000)	(107,677)	(2,364,323)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(3,708,000)	(208,205)	(3,499,795)
Insgesamt				<u>\$(537,907,467)</u>	<u>\$ (200,326,086)</u>	<u>\$ (337,581,381)</u>
					Wertsteigerung	\$ 1,921,827
					Wertminderung	\$ (339,503,208)

#### INFLATIONS-SWAPS (VPI)

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Deutsche Bank AG	USD 65,000	01/15/2026	1.578%	CPI#	\$ 4,111,957
Swaps insgesamt					<u>\$(254,433,597)</u>

# Variabler Zinssatz auf Basis der gemäß Verbraucherpreisindex ermittelten Inflationsrate.

- Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für offene OTC-Derivate zu dienen.
- Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- Not leidend.
- Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2021.
- Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- Notleidendes fälliges Wertpapier.
- Tagesgeld.

#### Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- CAD – Canadian Dollar
- CHF – Swiss Franc
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- JPY – Japanese Yen
- NZD – New Zealand Dollar
- PLN – Polish Zloty
- SGD – Singapore Dollar
- USD – United States Dollar
- ZAR – South African Rand



Glossar:

ABS	– Asset-Backed Securities
CBT	– Chicago Board of Trade
CDX-CMBX.NA	– North American Commercial Mortgage-Backed Index
CDX-NAHY	– North American High Yield Credit Default Swap Index
CLO	– Collateralized Loan Obligations
CMBS	– Commercial Mortgage-Backed Securities
CME	– Chicago Mercantile Exchange
CPI	– Consumer Price Index
INTRCONX	– Inter-Continental Exchange
JSC	– Joint Stock Company
LIBOR	– London Interbank Offered Rate
REIT	– Real Estate Investment Trust
REMICs	– Real Estate Mortgage Investment Conduits
TBA	– To Be Announced

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>					
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV	3.75%	01/15/2025	EUR 3,149	€ 3,199,038	0.2%
Chemours Co. (The)	4.00%	05/15/2026	8,375	8,509,424	0.4
INEOS Group Holdings SA	5.38%	08/01/2024	6,530	6,598,935	0.3
INEOS Quattro Finance 1 PLC	3.75%	07/15/2026	5,128	5,208,056	0.2
Kleopatra Finco Sarl	4.25%	03/01/2026	7,650	7,553,593	0.4
Kraton Polymers LLC/Kraton Polymers Capital Corp.	5.25%	05/15/2026	17,075	17,558,850	0.8
Kronos International, Inc.	3.75%	09/15/2025	16,748	16,981,451	0.8
LANXESS AG	4.50%	12/06/2076	6,207	6,618,306	0.3
Nouryon Holding BV	6.50%	10/01/2026	8,139	8,491,762	0.4
OCI NV	3.13%	11/01/2024	6,493	6,613,826	0.3
OCI NV	3.63%	10/15/2025	10,558	11,005,469	0.5
Schoeller Packaging BV	6.38%	11/01/2024	7,446	7,730,471	0.4
Sealed Air Corp.	4.50%	09/15/2023	6,910	7,515,989	0.4
SGL Carbon SE	4.63%	09/30/2024	11,315	11,301,369	0.5
Solvay Finance SAC(A)	5.87%	06/03/2024	8,000	9,006,589	0.4
Solvay SA(a)	4.25%	12/04/2023	4,000	4,284,223	0.2
Synthomer PLC	3.88%	07/01/2025	1,344	1,395,818	0.1
				<u>139,573,169</u>	<u>6.6</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
ARD Finance SA(b)	5.00%	06/30/2027	17,200	17,800,173	0.8
Ellaktor Value PLC	6.38%	12/15/2024	6,914	6,435,320	0.3
Mauser Packaging Solutions Holding Co.	4.75%	04/15/2024	21,627	21,706,949	1.0
Paprec Holding SA	4.00%	03/31/2025	10,544	10,648,030	0.5
Rebecca Bidco GmbH	5.75%	07/15/2025	5,552	5,794,212	0.3
Rolls-Royce PLC	4.63%	02/16/2026	2,380	2,548,318	0.1
Sofima Holding SpA	3.75%	01/15/2028	1,600	1,606,270	0.1
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	10,564	10,798,312	0.5
Vertical Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	5,098	5,330,405	0.3
				<u>82,667,989</u>	<u>3.9</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Altice Financing SA	3.00%	01/15/2028	12,145	11,555,589	0.6
Banjay Entertainment SASU	3.50%	03/01/2025	7,958	7,914,064	0.4
Summer BidCo BV(b)	9.00%	11/15/2025	6,806	6,962,485	0.3
UPCB Finance IV Ltd.	4.00%	01/15/2027	3,825	3,897,033	0.2
UPCB Finance VII Ltd.	3.63%	06/15/2029	8,300	8,483,013	0.4
Virgin Media Secured Finance PLC	5.00%	04/15/2027	GBP 17,850	21,511,136	1.0
Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC	4.88%	07/15/2028	9,199	10,940,722	0.5
Ziggo Bond Co. BV	3.38%	02/28/2030	EUR 4,350	4,323,312	0.2
				<u>75,587,354</u>	<u>3.6</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Altice France Holding SA	4.00%	02/15/2028	5,760	5,372,388	0.3
Altice France Holding SA	8.00%	05/15/2027	6,000	6,551,384	0.3
Altice France SA/France	5.88%	02/01/2027	4,635	4,960,600	0.2
Arqiva Broadcast Finance PLC	6.75%	09/30/2023	GBP 5,834	6,954,987	0.3
eircom Finance DAC	3.50%	05/15/2026	EUR 7,216	7,325,262	0.4
Telecom Italia SpA/Milano	4.00%	04/11/2024	5,881	6,366,182	0.3
Telecom Italia SpA/Milano, Series E	3.63%	05/25/2026	2,778	3,068,344	0.1
Telefonica Europe BV(a)	3.75%	03/15/2022	1,900	1,949,087	0.1
Telefonica Europe BV(a)	4.38%	12/14/2024	9,400	10,152,452	0.5
Telefonica Europe BV(a)	5.88%	03/31/2024	7,100	7,950,472	0.4
United Group BV	4.00%	11/15/2027	3,540	3,495,901	0.2
United Group BV	4.88%	07/01/2024	4,990	5,081,281	0.2
Vodafone Group PLC	4.88%	10/03/2078	GBP 6,800	8,547,421	0.4
				<u>77,775,761</u>	<u>3.7</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
Adient Global Holdings Ltd.	3.50%	08/15/2024	EUR 4,720	4,803,456	0.2
Faurecia SE	3.13%	06/15/2026	9,956	10,231,913	0.5
Ford Motor Credit Co. LLC	4.54%	03/06/2025	GBP 6,650	8,216,479	0.4
Garrett LX I SARRL/Garrett Borrowing LLC(c)	5.13%	10/15/2026	EUR 8,495	9,092,034	0.4
Gestamp Automocion SA	3.25%	04/30/2026	6,536	6,585,165	0.3
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.63%	05/15/2025	9,861	10,031,144	0.5
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.75%	09/15/2026	6,498	6,612,619	0.3
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	11/15/2024	3,971	4,245,674	0.2
Jaguar Land Rover Automotive PLC	6.88%	11/15/2026	3,070	3,437,946	0.2
LKQ European Holdings BV	4.13%	04/01/2028	2,000	2,120,000	0.1
Tenneco, Inc.	5.00%	07/15/2024	9,090	9,288,159	0.5
				<u>74,664,589</u>	<u>3.6</u>



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG</b>					
Carnival Corp. ....	10.13%	02/01/2026	EUR 4,900	€ 5,702,032	0.2%
CPUK Finance Ltd. ....	4.88%	08/28/2025	GBP 3,550	4,120,860	0.2
Dometic Group AB ....	3.00%	05/08/2026	EUR 3,830	4,006,656	0.2
Explorer II AS ....	3.38%	02/24/2025	2,070	1,825,061	0.1
				<u>15,654,609</u>	<u>0.7</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Cirsa Finance International SARL. ....	6.25%	12/20/2023	2,800	2,790,849	0.1
International Game Technology PLC ....	3.50%	07/15/2024	7,693	7,926,968	0.4
International Game Technology PLC ....	3.50%	06/15/2026	4,130	4,191,956	0.2
International Game Technology PLC ....	4.75%	02/15/2023	18,370	19,103,206	0.9
LHMC Finco 2 SARL(b) ....	7.25%	10/02/2025	6,652	5,782,200	0.3
Scientific Games International, Inc. ....	3.38%	02/15/2026	9,600	9,604,378	0.4
				<u>49,399,557</u>	<u>2.3</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
eG Global Finance PLC. ....	4.38%	02/07/2025	3,724	3,660,042	0.2
Marks & Spencer PLC. ....	4.50%	07/10/2027	GBP 5,100	6,181,540	0.3
				<u>9,841,582</u>	<u>0.5</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Cheplapharm Arzneimittel GmbH. ....	4.38%	01/15/2028	EUR 3,897	4,020,168	0.2
International Design Group SpA ....	6.50%	11/15/2025	1,035	1,077,527	0.1
IQVIA, Inc. ....	3.25%	03/15/2025	6,570	6,629,670	0.3
Laboratoire Eimer Selarl. ....	5.00%	02/01/2029	2,131	2,168,293	0.1
Nidda BondCo GmbH. ....	7.25%	09/30/2025	3,860	4,009,300	0.2
Premier Foods Finance PLC. ....	6.25%	10/15/2023	GBP 2,795	3,318,593	0.1
Rossini SARL. ....	6.75%	10/30/2025	EUR 3,780	4,016,081	0.2
Sigma Holdco BV. ....	5.75%	05/15/2026	3,863	3,775,283	0.2
Spectrum Brands, Inc. ....	4.00%	10/01/2026	4,289	4,403,041	0.2
				<u>33,417,956</u>	<u>1.6</u>
<b>ENERGIE</b>					
Rubis Terminal Infra SAS. ....	5.63%	05/15/2025	7,113	7,528,781	0.4
UGI International LLC. ....	3.25%	11/01/2025	9,342	9,532,624	0.4
				<u>17,061,405</u>	<u>0.8</u>
<b>SONSTIGE INDUSTRIEWERTE</b>					
Belden, Inc. ....	3.38%	07/15/2027	12,371	12,571,868	0.6
Belden, Inc. ....	3.88%	03/15/2028	4,639	4,812,614	0.2
Parts Europe SA. ....	6.50%	07/16/2025	6,445	6,732,413	0.3
ProGroup AG. ....	3.00%	03/31/2026	7,449	7,510,444	0.4
SPIE SA. ....	2.63%	06/18/2026	5,900	6,071,254	0.3
Stena International SA. ....	3.75%	02/01/2025	4,441	4,198,103	0.2
				<u>41,896,696</u>	<u>2.0</u>
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>					
eDreams ODIGEO SA. ....	5.50%	09/01/2023	8,306	8,079,294	0.4
Intertrust Group BV. ....	3.38%	11/15/2025	18,270	18,645,114	0.9
Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH. ....	6.00%	07/30/2026	3,793	3,942,572	0.2
Verisure Midholding AB. ....	5.25%	02/15/2029	6,733	6,918,618	0.3
				<u>37,585,598</u>	<u>1.8</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Boxer Parent Co., Inc. ....	6.50%	10/02/2025	6,856	7,298,488	0.3
Brunello Bidco SpA. ....	3.50%	02/15/2028	2,807	2,786,951	0.1
Playtech PLC. ....	3.75%	10/12/2023	5,558	5,634,181	0.3
Playtech PLC. ....	4.25%	03/07/2026	1,033	1,066,573	0.1
				<u>16,786,193</u>	<u>0.8</u>
<b>TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN</b>					
Getlink SE. ....	3.50%	10/30/2025	3,572	3,695,247	0.2
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Avis Budget Finance PLC. ....	4.13%	11/15/2024	2,559	2,563,505	0.1
Avis Budget Finance PLC. ....	4.50%	05/15/2025	1,611	1,601,832	0.1
Avis Budget Finance PLC. ....	4.75%	01/30/2026	5,728	5,706,583	0.3
CMA CGM SA. ....	5.25%	01/15/2025	5,900	5,933,156	0.3
CMA CGM SA. ....	7.50%	01/15/2026	5,000	5,381,763	0.2
Kapla Holding SAS. ....	3.38%	12/15/2026	1,657	1,641,135	0.1
Loxam SAS. ....	3.75%	07/15/2026	2,737	2,755,669	0.1
Loxam SAS. ....	6.00%	04/15/2025	9,851	9,861,811	0.5
Modulaire Global Finance PLC. ....	6.50%	02/15/2023	18,520	18,795,164	0.9
				<u>54,240,618</u>	<u>2.6</u>
				<u>729,848,323</u>	<u>34.7</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Abanca Corp. Bancaria SA(a) .....	6.00%	01/20/2026	EUR 5,600	€ 5,598,287	0.3%
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(a) .....	5.88%	05/24/2022	6,200	6,366,241	0.3
Banco de Credito Social Cooperativo SA .....	7.75%	06/07/2027	5,400	5,517,144	0.3
Banco de Sabadell SA .....	5.63%	05/06/2026	7,100	8,337,625	0.4
Bank of Ireland .....	10.00%	12/19/2022	6,205	7,254,279	0.4
Bank of Ireland Group PLC(a) .....	7.50%	05/19/2025	5,500	6,322,560	0.3
Bankia SA .....	3.75%	02/15/2029	8,500	9,131,685	0.4
CaixaBank SA(a) .....	5.88%	10/09/2027	4,600	5,056,754	0.2
CaixaBank SA(a) .....	6.75%	06/13/2024	9,800	10,696,666	0.5
Intesa Sanpaolo SpA, Series E. ....	6.63%	09/13/2023	9,295	10,582,591	0.5
				<u>74,863,832</u>	<u>3.6</u>
<b>MAKLER</b>					
LHC3 PLC(b) .....	4.13%	08/15/2024	9,074	9,198,386	0.4
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Intesa Sanpaolo Vita SpA(a) .....	4.75%	12/17/2024	1,700	1,850,964	0.1
Unipol Gruppo SpA .....	3.25%	09/23/2030	2,003	2,133,360	0.1
UnipolSai Assicurazioni SpA. ....	3.88%	03/01/2028	5,290	5,620,238	0.3
				<u>9,604,562</u>	<u>0.5</u>
<b>SONSTIGE FINANZWERTE</b>					
Intrum AB .....	4.88%	08/15/2025	20,850	21,648,516	1.0
Motion Finco SARL. ....	7.00%	05/15/2025	5,825	6,157,145	0.3
				<u>27,805,661</u>	<u>1.3</u>
<b>REITS</b>					
ADLER Group SA. ....	3.25%	08/05/2025	3,300	3,448,316	0.2
ADLER Real Estate AG. ....	3.00%	04/27/2026	7,600	7,941,295	0.4
Iron Mountain UK PLC .....	3.88%	11/15/2025	GBP 14,740	17,220,519	0.8
Peach Property Finance GmbH .....	3.50%	02/15/2023	EUR 2,701	2,740,878	0.1
Peach Property Finance GmbH .....	4.38%	11/15/2025	2,000	2,078,561	0.1
				<u>33,429,569</u>	<u>1.6</u>
				<u>154,902,010</u>	<u>7.4</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
ContourGlobal Power Holdings SA. ....	3.13%	01/01/2028	3,257	3,311,604	0.1
EDP - Energias de Portugal SA .....	4.50%	04/30/2079	9,700	10,585,410	0.5
Orano SA .....	3.38%	04/23/2026	9,200	9,901,242	0.5
Orano SA .....	4.88%	09/23/2024	2,000	2,264,689	0.1
				<u>26,062,945</u>	<u>1.2</u>
				<u>910,813,278</u>	<u>43.3</u>
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>					
<b>FRANKREICH</b>					
French Republic Government Bond OAT .....	4.00%	04/25/2055	7,385	14,649,700	0.7
French Republic Government Bond OAT .....	8.50%	04/25/2023	79,101	94,749,870	4.5
				<u>109,399,570</u>	<u>5.2</u>
<b>DEUTSCHLAND</b>					
Bundesrepublik Deutschland .....	6.25%	01/04/2030	10,000	15,991,433	0.8
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 97 .....	6.50%	07/04/2027	89,115	129,591,571	6.1
				<u>145,583,004</u>	<u>6.9</u>
<b>ITALIEN</b>					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro .....	4.75%	09/01/2044	31,329	51,600,843	2.5
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro .....	7.25%	11/01/2026	12,162	16,976,396	0.8
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro .....	9.00%	11/01/2023	59,304	73,888,465	3.5
				<u>142,465,704</u>	<u>6.8</u>
<b>NIEDERLANDE</b>					
Netherlands Government Bond .....	7.50%	01/15/2023	16,000	18,473,933	0.9
				<u>18,473,933</u>	<u>0.9</u>
<b>SPANIEN</b>					
Spain Government Bond .....	4.20%	01/31/2037	13,532	20,516,444	1.0
Spain Government Bond .....	5.15%	10/31/2044	22,710	42,066,363	2.0
Spain Government Bond .....	5.75%	07/30/2032	15,153	24,036,187	1.1
Spain Government Bond .....	5.90%	07/30/2026	17,506	23,250,922	1.1
Spain Government Bond .....	6.00%	01/31/2029	22,821	33,325,448	1.6
				<u>143,195,364</u>	<u>6.8</u>
				<u>559,117,575</u>	<u>26.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
ABN AMRO Bank NV, Series E	7.13%	07/06/2022	EUR 15,473	€ 16,940,150	0.8%
Barclays Bank PLC, Series E	10.00%	05/21/2021	GBP 12,121	14,279,804	0.7
BNP Paribas SA(a)	6.13%	06/17/2022	EUR 13,735	14,425,412	0.7
CaixaBank SA	3.50%	02/15/2027	10,000	10,275,178	0.5
Cooperatieve Rabobank UA(a)	4.38%	06/29/2027	30,600	33,668,485	1.6
Erste Group Bank AG(a)	4.25%	10/15/2027	18,600	19,298,931	0.9
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	7.13%	08/07/2025	GBP 11,430	16,651,779	0.8
HSBC Holdings PLC(a)	6.00%	09/29/2023	EUR 5,281	5,737,696	0.3
HSBC Holdings PLC	6.75%	09/11/2028	GBP 7,050	10,622,413	0.5
HSBC Holdings PLC, Series E(a)	4.75%	07/04/2029	EUR 15,365	17,021,519	0.8
KBC Group NV(a)	4.25%	10/24/2025	6,600	6,885,028	0.3
Lloyds Banking Group PLC	2.71%	12/03/2035	GBP 10,214	11,782,276	0.5
UBS Group AG(a)	5.75%	02/19/2022	EUR 18,745	19,448,955	0.9
UniCredit SpA(a)	7.50%	06/03/2026	4,780	5,532,207	0.3
UniCredit SpA, Series E	6.95%	10/31/2022	34,379	37,964,574	1.8
				<u>240,534,407</u>	<u>11.4</u>
<b>FINANZEN</b>					
GE Capital UK Funding Unlimited. Co.	5.88%	01/18/2033	GBP 7,405	11,433,142	0.5
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
ASR Nederland NV	3.38%	05/02/2049	EUR 13,599	15,100,846	0.7
Assicurazioni Generali SpA(a)	6.27%	06/16/2026	GBP 3,000	3,930,600	0.2
Assicurazioni Generali SpA, Series E	5.50%	10/27/2047	EUR 12,804	15,511,221	0.7
CNP Assurances(a)	4.75%	06/27/2028	12,000	13,522,319	0.7
Credit Agricole Assurances SA(a)	4.25%	01/13/2025	1,900	2,088,942	0.1
Credit Agricole Assurances SA	4.75%	09/27/2048	5,200	6,323,846	0.3
Friends Life Holdings PLC, Series E	12.00%	05/21/2021	GBP 3,100	3,668,237	0.2
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	EUR 18,451	18,820,020	0.9
Storebrand Livsforsikring AS	6.88%	04/04/2043	4,370	4,873,423	0.2
Tryg Forsikring A/S(d)	3.20%	11/13/2045	NOK 61,000	6,153,026	0.3
				<u>89,992,480</u>	<u>4.3</u>
<b>REITS</b>					
Digital Stout Holding LLC	3.75%	10/17/2030	GBP 3,250	4,307,428	0.2
				<u>346,267,457</u>	<u>16.4</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Glencore Finance Europe Ltd.	3.13%	03/26/2026	5,430	6,695,662	0.3
INEOS Finance PLC	3.38%	03/31/2026	EUR 1,714	1,765,420	0.1
				<u>8,461,082</u>	<u>0.4</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Time Warner Cable LLC	5.25%	07/15/2042	GBP 10,160	14,990,643	0.7
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
AT&T, Inc.	5.50%	03/15/2027	3,750	5,301,591	0.3
AT&T, Inc., Series B(a)	2.88%	03/02/2025	EUR 3,200	3,160,000	0.2
AT&T, Inc., Series E	7.00%	04/30/2040	GBP 2,900	5,249,410	0.2
Orange SA	8.13%	11/20/2028	5,997	10,238,423	0.5
				<u>23,949,424</u>	<u>1.2</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
Fiat Chrysler Finance Europe SENC, Series G	4.75%	07/15/2022	EUR 2,905	3,091,059	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.88%	05/19/2023	5,195	5,624,391	0.3
Schaeffler AG	3.38%	10/12/2028	3,200	3,540,898	0.2
Volvo Treasury AB	4.85%	03/10/2078	2,740	2,960,126	0.1
				<u>15,216,474</u>	<u>0.7</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
James Hardie International Finance DAC	3.63%	10/01/2026	5,834	5,999,292	0.3
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Anheuser-Busch InBev SA/NV	9.75%	07/30/2024	GBP 11,922	17,902,244	0.8
Imperial Brands Finance PLC, Series E	9.00%	02/17/2022	3,145	3,924,447	0.2
				<u>21,826,691</u>	<u>1.0</u>
<b>ENERGIE</b>					
BP Capital Markets PLC(a)	3.25%	03/22/2026	EUR 2,295	2,421,628	0.1
<b>SONSTIGE INDUSTRIEWERTE</b>					
Travis Perkins PLC	3.75%	02/17/2026	GBP 742	905,968	0.0
Travis Perkins PLC	4.50%	09/07/2023	8,067	9,976,385	0.5
				<u>10,882,353</u>	<u>0.5</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Fidelity National Information Services, Inc.	3.36%	05/21/2031	6,800	8,770,672	0.4
				<u>112,518,259</u>	<u>5.3</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Kontrakte/ Nominalbetrag/ Nennwert (-)/(000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
EDP Finance BV, Series E .....	8.63%	01/04/2024	GBP 9,146 €	12,833,630	0.6%
Electricite de France SA(a) .....	5.38%	01/29/2025	EUR 8,000	8,930,000	0.4
Enel SpA(a) (e) .....	5.45%	01/10/2024	7,010	7,830,211	0.4
Engie SA(a) .....	3.25%	11/28/2024	3,800	4,130,126	0.2
Naturgy Finance BV(a) .....	3.38%	04/24/2024	2,600	2,730,291	0.2
Orsted AS(a) .....	6.25%	06/26/3013	2,330	2,626,942	0.1
				<u>39,081,200</u>	<u>1.9</u>
				497,866,916	23.6
<b>SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
RCS & RDS SA .....	3.25%	02/05/2028	1,000	1,010,625	0.1
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Sazka Group AS .....	3.88%	02/15/2027	7,285	7,196,214	0.3
Sazka Group AS .....	4.13%	11/20/2024	7,889	8,029,523	0.4
				<u>15,225,737</u>	<u>0.7</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV .....	4.50%	03/01/2025	3,495	3,644,280	0.2
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV .....	6.00%	01/31/2025	6,247	6,812,934	0.3
				<u>10,457,214</u>	<u>0.5</u>
				<u>26,693,576</u>	<u>1.3</u>
<b>GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN</b>					
<b>SWAPTIONS</b>					
iTraxx-XOVER Series 34, 5 Year Index, Goldman Sachs International Expiration: Apr 2021, Exercise Rate: 2.75% .....			182,532,100	25,753,615	1.2
<b>OPTIONEN AUF INDIZES</b>					
Euro STOXX 50 Price EUR Index Expiration: May 2021, Exercise Price: EUR 3,450(f) .....			6,900	684,124	0.0
				<u>26,437,739</u>	<u>1.2</u>
				<u>2,020,929,084</u>	<u>96.0</u>
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>STAMMAKTIE</b>					
K201640219 South Africa Ltd. A Shares(g) .....			18,654,746	15	0.0
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
PVH Corp. ....	3.13%	12/15/2027	EUR 4,165	4,656,973	0.2
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>FINANZEN</b>					
Lincoln Financing SARL .....	3.63%	04/01/2024	20,522	20,712,629	1.0
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Sarens Finance Co. NV .....	5.75%	02/21/2027	3,125	3,035,283	0.2
Vertical Holdco GmbH .....	6.63%	07/15/2028	2,596	2,760,068	0.1
				<u>5,795,351</u>	<u>0.3</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Summer BC Holdco A SARL .....	9.25%	10/31/2027	4,776	5,149,296	0.2
Summer BC Holdco B SARL .....	5.75%	10/31/2026	6,385	6,739,525	0.3
				<u>11,888,821</u>	<u>0.5</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Hellas Telecommunications/Luxembourg III(g) .....	8.50%	10/15/2049	641	0	0.0
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co. ....	4.38%	05/15/2026	13,994	14,513,791	0.7
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Boparan Finance PLC .....	7.63%	11/30/2025	GBP 2,349	2,728,239	0.1
Cheplapharm Arzneimittel GmbH .....	3.50%	02/11/2027	EUR 11,398	11,398,130	0.6
				<u>14,126,369</u>	<u>0.7</u>
				<u>46,324,332</u>	<u>2.2</u>
				<u>67,036,961</u>	<u>3.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
<b>REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN</b>					
<b>NIEDERLANDE</b>					
SNS Reaal NV(a) (g) .....	6.25%	12/31/2049	EUR 770	€ 1	0.0%
				71,693,950	3.4
<b>Gesamtanlagen</b>				€ 2,092,623,034	99.4%
(Kosten €2,119,797,205) .....					
<b>Termineinlagen</b>					
BBH, Grand Cayman(h) .....	(0.06)%	–		15,235	0.0
BBH, Grand Cayman(h) .....	0.07 %	–		34	0.0
BNP Paribas, Paris(h) .....	(0.06)%	–		267,172	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(h) .....	0.00 %	–		121,921	0.0
SEB, Stockholm(h) .....	0.00 %	–		825,430	0.1
Sumitomo Trust Bank, London(h) .....	0.00 %	–		272,138	0.0
Sumitomo, Tokyo(h) .....	(0.71)%	–		6,497,282	0.3
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....				7,999,212	0.4
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....				4,822,918	0.2
<b>Nettovermögen</b> .....				€ 2,105,445,164	100.0%

**TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
<b>Long</b>					
Euro Buxl 30 Yr Bond Futures .....	03/08/2021	716	€ 160,183,760	€ 150,231,120	€ (9,952,640)
Euro-BOBL Futures .....	03/08/2021	756	102,099,240	101,462,760	(636,480)
Euro-BTP Futures .....	03/08/2021	807	121,499,720	120,888,600	(611,120)
Euro-OAT Futures .....	03/08/2021	158	26,387,560	25,821,940	(565,620)
<b>Short</b>					
Euro-Bund Futures .....	03/08/2021	498	88,264,420	86,353,200	1,911,220
Euro-Schatz Futures .....	03/08/2021	209	23,475,415	23,443,530	31,885
					€ (9,822,755)
				Wertsteigerung	€ 1,943,105
				Wertminderung	€ (11,765,860)

**DEWISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)	
Brown Brothers Harriman & Co. ....	GBP 8,061	EUR 9,204	04/09/2021	€ (97,682)	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 180,062	AUD 284,462	03/05/2021	1,337,035	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 3,067	CHF 3,317	03/05/2021	(45,564)	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 34,760	HKD 324,109	03/05/2021	(129,965)	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 5	HKD 43	03/05/2021	18	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 5,272	SGD 8,453	03/05/2021	(19,393)	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 416,366	USD 500,909	03/05/2021	(1,231,660)	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 2,766	CNH 21,597	03/12/2021	(22,852)	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 416,353	USD 505,286	03/12/2021	2,334,883	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 2,833	CNH 22,315	03/25/2021	(2,713)	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 43,933	HKD 413,932	03/25/2021	273,117	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 9	PLN 42	03/25/2021	(41)	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 9,046	SGD 14,524	03/25/2021	(23,210)	
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 416,348	USD 506,037	03/25/2021	2,801,470	
Citibank, NA .....	EUR 1,970	GBP 1,713	04/09/2021	6,612	
JPMorgan Chase Bank, NA .....	GBP 1,334	EUR 1,523	04/09/2021	(16,620)	
Royal Bank of Scotland PLC .....	GBP 226,323	EUR 253,538	04/09/2021	(7,603,489)	
Standard Chartered Bank .....	NOK 50,532	EUR 4,885	04/15/2021	59,902	
				€ (2,380,152)	
				Wertsteigerung	€ 6,813,037
				Wertminderung	€ (9,193,189)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

**VERKAUFTE CREDIT-DEFAULT-SWAPTIONS**

Referenz-Obligation	Gegenpartei	Kauf-/Verkaufsschutz	Ausübungskurs	Fälligkeit	Nominalbetrag (000)	Prämien	Marktwert
Put - iTraxx-XOVER Series 34, 5 Year Index	Goldman Sachs International	Sell	400.00%	04/21/2021EUR	182,532	€ 310,305	€ <u>(25,621,848)</u>

**ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS**

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschlussdatum	Nominalbetrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
<b>Kaufkontrakte</b> Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 34, 5 Year Index	12/20/2025	EUR 95,716	€ <u>(9,967,714)</u>	€ <u>776,043</u>

- (a) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (b) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (c) Not leidend.
- (d) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2021.
- (e) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 28. Februar 2021.
- (f) Ein Kontrakt bezieht sich auf 1 Anteil.
- (g) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (h) Tagesgeld.

**Währungskürzel:**

- AUD – Australian Dollar
- CHF – Swiss Franc
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- HKD – Hong Kong Dollar
- NOK – Norwegian Krone
- PLN – Polish Zloty
- SGD – Singapore Dollar
- USD – United States Dollar

**Glossar:**

- BOBL – Bundesobligationen
- BTP – Buoni del Tesoro Poliennali
- INTRCONX – Inter-Continental Exchange
- OAT – Obligations Assimilables du Trésor
- REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>					
<b>STAATSANLEIHEN</b>					
Abu Dhabi Government International Bond	3.13%	09/30/2049	USD 2,801	\$ 2,700,339	0.3%
Abu Dhabi Government International Bond	3.88%	04/16/2050	2,109	2,313,257	0.3
Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049	8,217	7,903,727	0.9
Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048	8,355	8,206,177	0.9
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2030	20,774	7,556,449	0.8
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2035	46,280	14,809,526	1.6
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	01/09/2038	1,789	666,270	0.1
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2041	2,951	1,012,472	0.1
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	3,315	1,311,477	0.1
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	221	219,895	0.0
Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031	3,880	3,918,800	0.4
Bahrain Government International Bond	6.00%	09/19/2044	7,366	7,096,681	0.8
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	3,508	3,867,570	0.4
Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028	1,754	1,988,606	0.2
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030	3,951	4,493,028	0.5
Bermuda Government International Bond	3.38%	08/20/2050	897	920,380	0.1
CBB International Sukuk Programme Co. SPC	4.50%	03/30/2027	2,586	2,687,824	0.3
Chile Government International Bond	2.55%	01/27/2032	10,678	10,818,149	1.2
Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	1,493	1,482,269	0.2
Colombia Government International Bond	3.88%	04/25/2027	7,570	8,140,116	0.9
Colombia Government International Bond	5.00%	06/15/2045	2,855	3,075,370	0.3
Colombia Government International Bond	7.38%	09/18/2037	2,044	2,713,410	0.3
Costa Rica Government International Bond	7.00%	04/04/2044	1,518	1,477,204	0.2
Dominican Republic International Bond	5.30%	01/21/2041	1,009	990,081	0.1
Dominican Republic International Bond	5.50%	01/27/2025	423	463,185	0.1
Dominican Republic International Bond	5.88%	01/30/2060	4,612	4,463,552	0.5
Dominican Republic International Bond	6.40%	06/05/2049	450	475,172	0.1
Dominican Republic International Bond	6.50%	02/15/2048	8,072	8,594,157	1.0
Dominican Republic International Bond	6.85%	01/27/2045	5,781	6,398,844	0.7
Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	1,753	727,448	0.1
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2030	8,163	4,795,875	0.6
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2035	15,750	7,166,209	0.8
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2040	6,062	2,546,126	0.3
Egypt Government International Bond	3.88%	02/16/2026	2,534	2,476,985	0.3
Egypt Government International Bond	5.63%	04/16/2030	EUR 3,111	3,805,189	0.4
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	USD 3,693	4,158,087	0.5
Egypt Government International Bond	7.50%	02/16/2061	1,883	1,760,505	0.2
Egypt Government International Bond	7.90%	02/21/2048	7,077	6,975,268	0.8
Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047	3,162	3,276,622	0.4
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	2,114	2,247,446	0.2
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	3,135	3,044,869	0.3
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	11,529	10,664,325	1.2
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	944	929,840	0.1
El Salvador Government International Bond	7.75%	01/24/2023	2,961	2,994,311	0.3
Finance Department Government of Sharjah	4.00%	07/28/2050	1,063	972,645	0.1
Gabon Government International Bond	6.38%	12/12/2024	406	419,238	0.0
Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031	3,720	3,642,112	0.4
Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025	3,807	3,987,832	0.4
Ghana Government International Bond	7.63%	05/16/2029	2,108	2,200,225	0.2
Ghana Government International Bond	7.88%	03/26/2027	3,415	3,714,880	0.4
Ghana Government International Bond	7.88%	02/11/2035	5,221	5,106,791	0.6
Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032	1,700	1,731,875	0.2
Ghana Government International Bond	8.63%	06/16/2049	2,432	2,352,960	0.3
Ghana Government International Bond	8.75%	03/11/2061	559	535,068	0.1
Ghana Government International Bond	8.95%	03/26/2051	4,142	4,047,511	0.4
Guatemala Government Bond	4.38%	06/05/2027	2,936	3,168,127	0.3
Guatemala Government Bond	5.38%	04/24/2032	493	574,961	0.1
Guatemala Government Bond	6.13%	06/01/2050	4,859	5,862,687	0.6
Honduras Government International Bond	5.63%	06/24/2030	966	1,058,978	0.1
Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027	5,794	6,478,416	0.7
Honduras Government International Bond	7.50%	03/15/2024	3,086	3,361,811	0.4
Israel Government International Bond	3.88%	07/03/2050	2,277	2,500,300	0.3
Ivory Coast Government International Bond	5.38%	07/23/2024	3,925	4,198,523	0.5
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	2,450	2,629,922	0.3
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	4,615	5,129,861	0.6
Ivory Coast Government International Bond	6.63%	03/22/2048	EUR 1,873	2,387,692	0.3
Jamaica Government International Bond	7.63%	07/09/2025	USD 4,563	5,291,654	0.6
Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045	3,368	4,664,680	0.5
Kenya Government International Bond	6.88%	06/24/2024	2,457	2,721,895	0.3
Lebanon Government International Bond(a)	6.00%	01/27/2023	1,360	175,100	0.0
Lebanon Government International Bond(a)	6.65%	04/22/2024	3,748	482,555	0.1
Lebanon Government International Bond, Series E(a)	6.10%	10/04/2022	6,321	821,730	0.1
Lebanon Government International Bond, Series G(a)	1.00%	11/27/2026	1,719	221,321	0.0

**AB FCP I**  
**Emerging Markets Debt Portfolio**

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Lebanon Government International Bond, Series G(a)	6.20%	02/26/2025	USD 4,428	\$ 572,873	0.1%
Lebanon Government International Bond, Series G(a)	6.85%	03/23/2027	4,936	633,968	0.1
Mexico Government International Bond	5.00%	04/27/2051	3,181	3,437,468	0.4
Mongolia Government International Bond	5.13%	12/05/2022	1,383	1,435,727	0.2
Mongolia Government International Bond	5.63%	05/01/2023	1,971	2,080,021	0.2
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	4,366	4,666,162	0.5
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	2,932	2,985,143	0.3
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	2,993	3,065,954	0.3
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	3,296	3,547,320	0.4
Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	1,567	1,623,804	0.2
Oman Government International Bond	5.63%	01/17/2028	481	495,430	0.1
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	2,927	3,080,668	0.3
Oman Government International Bond	6.50%	03/08/2047	2,125	2,005,469	0.2
Oman Government International Bond	6.75%	01/17/2048	10,071	9,671,307	1.1
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	2,613	2,782,845	0.3
Pakistan Government International Bond	8.25%	04/15/2024	200	220,938	0.0
Panama Government International Bond	3.16%	01/23/2030	3,000	3,119,063	0.3
Panama Government International Bond	3.88%	03/17/2028	945	1,032,708	0.1
Panama Government International Bond	4.50%	04/16/2050	5,031	5,589,127	0.6
Panama Government International Bond	4.50%	04/01/2056	1,204	1,328,915	0.1
Panama Government International Bond	8.88%	09/30/2027	1,714	2,371,212	0.3
Panama Government International Bond	9.38%	04/01/2029	2,431	3,586,940	0.4
Paraguay Government International Bond	4.95%	04/28/2031	3,000	3,398,437	0.4
Paraguay Government International Bond	5.40%	03/30/2050	1,074	1,230,737	0.1
Peruvian Government International Bond	2.78%	01/23/2031	3,993	4,054,143	0.4
Peruvian Government International Bond	3.23%	07/28/2121	1,944	1,611,090	0.2
Petroamazonas EP	4.63%	12/06/2021	1,115	1,026,093	0.1
Philippine Government International Bond	3.70%	02/02/2042	4,252	4,505,791	0.5
Qatar Government International Bond	3.75%	04/16/2030	3,842	4,339,059	0.5
Qatar Government International Bond	4.40%	04/16/2050	8,225	9,633,531	1.1
Qatar Government International Bond	4.82%	03/14/2049	2,745	3,381,497	0.4
Qatar Government International Bond	5.10%	04/23/2048	5,017	6,379,429	0.7
Republic of Azerbaijan International Bond	4.75%	03/18/2024	3,090	3,352,650	0.4
Republic of South Africa Government International Bond	5.00%	10/12/2046	1,167	1,009,455	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	5.38%	07/24/2044	2,133	1,935,698	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	5.65%	09/27/2047	7,076	6,507,709	0.7
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	8,245	7,564,787	0.8
Russian Foreign Bond - Eurobond	4.75%	05/27/2026	9,600	10,974,000	1.2
Russian Foreign Bond - Eurobond	5.25%	06/23/2047	12,800	15,916,000	1.8
Rwanda International Government Bond	6.63%	05/02/2023	835	869,444	0.1
Saudi Government International Bond	3.25%	10/22/2030	3,413	3,647,644	0.4
Saudi Government International Bond	5.00%	04/17/2049	1,617	1,944,443	0.2
Saudi Government International Bond	5.25%	01/16/2050	4,323	5,394,293	0.6
Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR 789	998,376	0.1
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	USD 5,819	5,933,562	0.7
Serbia International Bond	2.13%	12/01/2030	1,135	1,069,738	0.1
Sri Lanka Government International Bond	6.20%	05/11/2027	1,443	825,216	0.1
Sri Lanka Government International Bond	6.85%	11/03/2025	5,158	3,002,923	0.3
Turkey Government International Bond	4.25%	03/13/2025	2,374	2,360,646	0.3
Turkey Government International Bond	4.75%	01/26/2026	3,725	3,729,656	0.4
Turkey Government International Bond	4.88%	04/16/2043	4,466	3,600,735	0.4
Turkey Government International Bond	5.75%	05/11/2047	4,881	4,267,824	0.5
Turkey Government International Bond	6.63%	02/17/2045	1,430	1,371,459	0.2
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2033	2,993	3,037,895	0.3
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032	4,595	4,725,670	0.5
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2024	2,294	2,476,803	0.3
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2025	3,943	4,272,240	0.5
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2026	8,390	9,050,712	1.0
Ukraine Government International Bond	8.99%	02/01/2024	1,750	1,933,750	0.2
Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2028	763	899,386	0.1
Ukraine Government International Bond, Series GDP(b)	0.00%	05/31/2040	5,368	5,866,217	0.6
Uruguay Government International Bond	4.38%	01/23/2031	4,895	5,666,125	0.6
Uruguay Government International Bond	4.98%	04/20/2055	743	905,486	0.1
Uruguay Government International Bond	5.10%	06/18/2050	2,094	2,579,865	0.3
Venezuela Government International Bond(c)	7.75%	10/13/2019	2,834	269,211	0.0
Venezuela Government International Bond(a)	9.00%	05/07/2023	5,842	555,028	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	09/15/2027	4,619	438,805	0.0
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	05/07/2028	8,171	776,264	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	11.95%	08/05/2031	762	72,362	0.0
Venezuela Government International Bond(a)	12.75%	08/23/2022	2,087	198,303	0.0
				487,667,791	54.0
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	4.00%	10/03/2049	1,500	1,690,312	0.2
AES Gener SA	6.35%	10/07/2079	1,162	1,243,340	0.1
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	1,353	1,432,150	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
AI Candelaria Spain SLU	7.50%	12/15/2028	USD 250	\$ 284,997	0.0%
Alibaba Group Holding Ltd.	2.70%	02/09/2041	1,811	1,696,223	0.2
Alibaba Group Holding Ltd.	3.40%	12/06/2027	1,076	1,173,028	0.1
Alpek SAB de CV	4.25%	09/18/2029	628	679,936	0.1
Autopistas del Sol SA/Costa Rica	7.38%	12/30/2030	2,206	2,175,444	0.2
Banco de Credito del Peru	3.13%	07/01/2030	1,175	1,199,087	0.1
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	3.73%	09/25/2034	2,429	2,504,906	0.3
Bank Mandiri Persero Tbk PT	4.75%	05/13/2025	2,000	2,211,250	0.2
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.	0.00%	06/05/2034	2,191	1,660,713	0.2
BOC Aviation Ltd.	3.88%	04/27/2026	1,590	1,721,175	0.2
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	600	598,590	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	2,246	2,325,849	0.3
BRF SA	5.75%	09/21/2050	1,077	1,099,402	0.1
Celulosa Arauco y Constitucion SA	4.20%	01/29/2030	1,088	1,175,725	0.2
Cemex SAB de CV	3.88%	07/11/2031	3,247	3,240,571	0.4
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	2,148	2,410,378	0.3
Cemig Geracao e Transmissao SA	9.25%	02/05/2024	1,959	2,255,299	0.3
Central American Bottling Corp.	5.75%	01/31/2027	2,103	2,223,292	0.2
Chile Electricity PEC SpA	0.00%	01/25/2028	3,495	2,877,212	0.3
China Cinda 2020 I Management Ltd.	3.00%	01/20/2031	1,289	1,287,334	0.1
CITIC Ltd.	2.85%	02/25/2030	1,415	1,427,381	0.2
Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025	973	992,892	0.1
Contemporary Ruiding Development Ltd.	2.63%	09/17/2030	2,820	2,826,016	0.3
CSN Resources SA	7.63%	02/13/2023	2,864	2,966,030	0.3
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	5,220	6,360,048	0.7
Ecopetrol SA	7.38%	09/18/2043	2,435	3,021,226	0.3
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	2,350	2,457,301	0.3
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	2,179	2,440,698	0.3
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	2,504	2,559,557	0.3
Enel Americas SA	4.00%	10/25/2026	4,469	4,933,418	0.5
Enel Chile SA	4.88%	06/12/2028	2,659	3,103,552	0.3
Enel Generacion Chile SA	4.25%	04/15/2024	1,844	1,984,605	0.2
Energuate Trust	5.88%	05/03/2027	3,311	3,510,695	0.4
First Abu Dhabi Bank PJSC(d)	4.50%	04/05/2026	2,247	2,376,905	0.3
GNL Quintero SA	4.63%	07/31/2029	4,600	4,996,750	0.6
Gran Tierra Energy International Holdings Ltd.	6.25%	02/15/2025	5,449	4,506,730	0.5
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	1,291	1,062,685	0.1
Grupo Energia Bogota SA ESP	4.88%	05/15/2030	724	808,274	0.1
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E	7.13%	10/10/2022	INR 160,000	2,163,163	0.2
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	USD 2,662	2,845,012	0.3
Inkia Energy Ltd.	5.88%	11/09/2027	1,179	1,246,424	0.1
Intercorp Financial Services, Inc.	4.13%	10/19/2027	1,268	1,353,590	0.2
Intercorp Peru Ltd.	3.88%	08/15/2029	1,246	1,305,964	0.1
Inversiones CMPC SA	3.85%	01/13/2030	1,118	1,212,331	0.1
Inversiones CMPC SA	4.38%	04/04/2027	1,847	2,057,558	0.2
Inversiones CMPC SA/Cayman Islands Branch	4.38%	05/15/2023	477	504,726	0.1
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	2.43%	07/01/2031	706	710,413	0.1
Klabin Austria GmbH	3.20%	01/12/2031	1,031	1,020,764	0.1
Kosmos Energy Ltd.	7.50%	03/01/2028	1,428	1,415,673	0.2
Leviathan Bond Ltd.	6.75%	06/30/2030	1,415	1,558,831	0.2
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA	7.25%	05/03/2023	2,170	2,250,832	0.3
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	1,137	1,237,909	0.1
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	4,039	4,842,247	0.5
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026	1,315	1,411,981	0.2
MercadoLibre, Inc.	3.13%	01/14/2031	200	197,129	0.0
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	591	642,350	0.1
National Central Cooling Co. PJSC	2.50%	10/21/2027	974	971,869	0.1
OCP SA	4.50%	10/22/2025	630	676,069	0.1
OCP SA	5.63%	04/25/2024	1,459	1,602,164	0.2
Odebrecht Holdeco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	3,385	96,481	0.0
OEC Finance Ltd.(e)	4.38%	10/25/2029	263	52,342	0.0
OEC Finance Ltd.	4.38%	10/25/2029	612	121,621	0.0
OEC Finance Ltd.(e)	5.25%	12/27/2033	1,419	283,050	0.0
OEC Finance Ltd.(e)	7.13%	12/26/2046	476	101,281	0.0
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	1,329	1,425,352	0.2
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030	3,150	2,944,266	0.3
Petrobras Global Finance BV	5.09%	01/15/2030	4,166	4,402,343	0.5
Petrobras Global Finance BV	6.75%	06/03/2050	1,436	1,564,114	0.2
Petrobras Global Finance BV	6.90%	03/19/2049	1,010	1,127,222	0.1
Prosus NV	3.68%	01/21/2030	2,435	2,554,467	0.3
Prosus NV	4.03%	08/03/2050	620	574,052	0.1
PTTEP Treasury Center Co., Ltd.	3.90%	12/06/2059	986	1,029,138	0.1
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.	0.00%	09/30/2036	1,535	1,140,828	0.1
SABIC Capital II BV	4.50%	10/10/2028	893	1,038,112	0.1
Shanghai Port Group BVI Development 2 Co., Ltd.	2.38%	07/13/2030	937	922,359	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SK Hynix, Inc. . . . .	2.38%	01/19/2031	USD 2,214	\$ 2,140,473	0.2%
Suzano Austria GmbH . . . . .	3.75%	01/15/2031	1,487	1,569,130	0.2
Tencent Holdings Ltd. . . . .	2.39%	06/03/2030	2,313	2,281,147	0.3
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd. . . . .	3.25%	08/15/2030	2,279	2,313,354	0.3
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd. . . . .	4.00%	08/15/2026	1,083	1,174,820	0.1
TransJamaican Highway Ltd. . . . .	5.75%	10/10/2036	2,130	2,127,337	0.2
Transportadora de Gas Internacional SA ESP . . . . .	5.55%	11/01/2028	2,311	2,629,485	0.3
Trust Fibra Uno . . . . .	4.87%	01/15/2030	4,201	4,537,080	0.5
Trust Fibra Uno . . . . .	6.39%	01/15/2050	209	235,386	0.0
Trust Fibra Uno . . . . .	6.95%	01/30/2044	316	376,336	0.0
Türkiye Vakıflar Bankası TAO . . . . .	6.50%	01/08/2026	3,117	3,233,887	0.4
Uep Penonome Ii SA . . . . .	6.50%	10/01/2038	3,738	3,836,122	0.4
Unifin Financiera SAB de CV . . . . .	9.88%	01/28/2029	1,763	1,842,335	0.2
Vedanta Resources Finance II PLC . . . . .	13.88%	01/21/2024	4,356	4,824,899	0.5
VEON Holdings BV . . . . .	3.38%	11/25/2027	2,689	2,743,375	0.3
Volcan Cia Minera SAA . . . . .	4.38%	02/11/2026	560	574,700	0.1
Weibo Corp. . . . .	3.38%	07/08/2030	1,938	1,952,110	0.2
YPF SA . . . . .	8.50%	03/23/2021	118	116,378	0.0
YPF SA . . . . .	8.75%	04/04/2024	2,490	2,075,415	0.2
				182,688,772	20.2
<b>QUASI-STAATSANLEIHEN</b>					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA . . . . .	6.00%	11/18/2048	3,696	4,226,762	0.5
Airport Authority(d) . . . . .	2.40%	03/08/2028	2,978	2,985,445	0.3
Banco Nacional De Panama . . . . .	2.50%	08/11/2030	2,321	2,237,165	0.2
CNAC HK Finbridge Co., Ltd. . . . .	3.88%	06/19/2029	4,087	4,104,881	0.5
Comision Federal de Electricidad . . . . .	3.35%	02/09/2031	1,328	1,304,760	0.1
Comision Federal de Electricidad . . . . .	4.68%	02/09/2051	1,193	1,130,368	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile . . . . .	3.00%	09/30/2029	4,192	4,374,090	0.5
Corp. Nacional del Cobre de Chile . . . . .	3.15%	01/14/2030	439	462,459	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile . . . . .	3.75%	01/15/2031	808	885,770	0.1
DP World Crescent Ltd. . . . .	3.88%	07/18/2029	2,475	2,617,312	0.3
DP World PLC . . . . .	5.63%	09/25/2048	1,706	2,029,074	0.2
DP World Salaam(d) . . . . .	6.00%	10/01/2025	2,195	2,389,334	0.3
Empresa de Transmision Electrica SA . . . . .	5.13%	05/02/2049	1,290	1,505,269	0.2
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA . . . . .	3.65%	05/07/2030	322	354,200	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd. . . . .	6.35%	08/10/2028	5,381	5,782,893	0.6
Eskom Holdings SOC Ltd. . . . .	6.75%	08/06/2023	5,131	5,359,329	0.6
Eskom Holdings SOC Ltd. . . . .	7.13%	02/11/2025	5,350	5,608,405	0.6
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT . . . . .	5.45%	05/15/2030	1,565	1,791,925	0.2
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT . . . . .	5.80%	05/15/2050	1,375	1,596,719	0.2
KazMunayGas National Co. JSC . . . . .	5.38%	04/24/2030	7,272	8,651,407	1.0
KazMunayGas National Co. JSC . . . . .	5.75%	04/19/2047	1,546	1,826,599	0.2
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC . . . . .	7.38%	07/19/2022	2,557	2,632,112	0.3
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC . . . . .	7.63%	11/08/2026	1,322	1,346,788	0.1
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The) . . . . .	7.50%	10/25/2027	3,015	3,430,505	0.4
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The), Series FEB . . . . .	7.63%	11/07/2024	2,935	3,272,525	0.4
Pertamina Persero PT . . . . .	4.15%	02/25/2060	1,900	1,825,188	0.2
Pertamina Persero PT . . . . .	5.63%	05/20/2043	455	525,383	0.1
Pertamina Persero PT . . . . .	6.00%	05/03/2042	3,625	4,335,273	0.5
Pertamina Persero PT . . . . .	6.45%	05/30/2044	1,854	2,340,675	0.3
Pertamina Persero PT . . . . .	6.50%	05/27/2041	2,782	3,531,401	0.4
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara . . . . .	3.88%	07/17/2029	3,131	3,298,313	0.4
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara . . . . .	4.88%	07/17/2049	590	620,238	0.1
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara . . . . .	6.15%	05/21/2048	5,416	6,615,982	0.7
Petroleos de Venezuela SA(a) . . . . .	5.38%	04/12/2027	7,377	295,092	0.0
Petroleos de Venezuela SA(a) . . . . .	5.50%	04/12/2037	8,347	333,880	0.0
Petroleos de Venezuela SA(a) . . . . .	9.00%	11/17/2021	9,326	373,043	0.0
Petroleos Mexicanos . . . . .	5.95%	01/28/2031	5,841	5,627,803	0.6
Petroleos Mexicanos . . . . .	6.50%	03/13/2027	4,652	4,861,456	0.5
Petroleos Mexicanos . . . . .	6.75%	09/21/2047	6,140	5,374,035	0.6
Petroleos Mexicanos . . . . .	6.84%	01/23/2030	2,493	2,505,465	0.3
Petroleos Mexicanos . . . . .	6.88%	08/04/2026	1,770	1,889,564	0.2
Petroleos Mexicanos . . . . .	6.95%	01/28/2060	6,285	5,499,375	0.6
Petroleos Mexicanos . . . . .	7.69%	01/23/2050	5,114	4,857,789	0.5
Petronas Capital Ltd. . . . .	4.55%	04/21/2050	1,507	1,808,754	0.2
Petronas Capital Ltd. . . . .	4.80%	04/21/2060	1,709	2,168,724	0.2
Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd. . . . .	4.10%	04/28/2045	3,176	3,503,525	0.4
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd. . . . .	2.70%	05/13/2030	4,221	4,269,805	0.5
Southern Gas Corridor CJSC . . . . .	6.88%	03/24/2026	2,311	2,762,367	0.3
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic . . . . .	6.95%	03/18/2030	3,165	3,989,878	0.4
Trinidad Generation UnLtd. . . . .	5.25%	11/04/2027	2,327	2,416,444	0.3
				147,535,548	16.3
<b>SCHATZWECHSEL</b>					
Egypt Treasury Bills . . . . .	0.00%	03/23/2021	EGP 160,000	10,113,325	1.1



	Zinssatz	Datum	Anteile/Kontrakte/ Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE</b>					
Egypt Government Bond, Series 5YR . . . . .	14.06%	01/12/2026	EGP 146,639	\$ 9,228,431	1.0%
Turkey Government Bond . . . . .	11.70%	11/13/2030	TRY 71,040	8,891,060	1.0
				<u>18,119,491</u>	<u>2.0</u>
<b>INVESTMENTGESELLSCHAFTEN</b>					
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S . . . . .			120,265	3,247,144	0.3
<b>GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN</b>					
<b>SWAPTIONS</b>					
CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index, Morgan Stanley & Co. International PLC Expiration: Apr 2021, Exercise Rate: 1.07% . . . . .			141,517	1,529,988	0.2
<b>REGIONALANLEIHEN</b>					
Provincia de Neuquen Argentina . . . . .	7.50%	04/27/2030	USD 2,798	1,521,334	0.2
<b>INFLATIONSGBUNDENE WERTPAPIERE</b>					
Fideicomiso PA Concesion Ruta al Mar . . . . .	6.75%	02/15/2044	COP 3,129,329	735,861	0.1
				<u>853,159,254</u>	<u>94.4</u>
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
Digicel Group 0.5 Ltd.(d) (e) . . . . .	7.00%	03/12/2021	USD 201	132,209	0.0
Digicel Group 0.5 Ltd.(e) . . . . .	8.00%	04/01/2025	447	364,162	0.0
Digicel Group 0.5 Ltd.(e) . . . . .	10.00%	04/01/2024	2,993	2,962,742	0.3
Empresa Electrica Cochran SpA . . . . .	5.50%	05/14/2027	1,581	1,672,193	0.2
Engie Energia Chile SA . . . . .	3.40%	01/28/2030	3,394	3,563,700	0.4
Tonon Luxembourg SA(a) (e) (f) . . . . .	6.50%	10/31/2024	1,516	45,620	0.0
USJ-Acucar e Alcool S/A(a) . . . . .	9.88%	11/09/2023	4,432	1,286,616	0.2
Virgolino de Oliveira Finance SA(c) . . . . .	10.50%	01/28/2018	1,016	11,094	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(c) . . . . .	10.88%	01/13/2020	2,474	494,800	0.1
Virgolino de Oliveira Finance SA(a) . . . . .	11.75%	02/09/2022	2,561	12,837	0.0
				<u>10,545,973</u>	<u>1.2</u>
<b>SCHATZWECHSEL</b>					
Egypt Treasury Bills Series 364D . . . . .	0.00%	05/04/2021	EGP 160,050	9,976,291	1.1
<b>QUASI-STAAITSANLEIHEN</b>					
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA . . . . .	4.70%	05/07/2050	USD 3,741	4,423,733	0.5
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA . . . . .	5.00%	01/25/2047	240	286,651	0.0
				<u>4,710,384</u>	<u>0.5</u>
<b>STAATSANLEIHEN</b>					
Ukraine Government International Bond . . . . .	6.75%	06/20/2026	EUR 1,222	1,571,622	0.2
				<u>26,804,270</u>	<u>3.0</u>
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten \$906,196,583) . . . . .				\$ 879,963,524	97.4%
<b>Termineinlagen</b>					
BBH, Grand Cayman(g) . . . . .	— %	—		393	0.0
BBH, Grand Cayman(g) . . . . .	0.01 %	—		268	0.0
BBH, Grand Cayman(g) . . . . .	0.07 %	—		298	0.0
BNP Paribas, Paris(g) . . . . .	2.80 %	—		63,368	0.0
National Australia Bank, London(g) . . . . .	(0.06)%	—		55,718	0.0
Sumitomo Trust Bank, London(g) . . . . .	(0.71)%	—		151,705	0.0
Sumitomo, Tokyo(g) . . . . .	— %	—		5,463,744	0.6
<b>Termineinlagen insgesamt</b> . . . . .				<u>5,735,494</u>	<u>0.6</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> . . . . .				<u>17,723,825</u>	<u>2.0</u>
<b>Nettovermögen</b> . . . . .				<u>\$ 903,422,843</u>	<u>100.0%</u>

**TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Long</b>					
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures . . . . .	06/21/2021	294	\$ 39,467,203	\$ 39,019,312	\$ (447,891)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures . . . . .	06/21/2021	80	15,180,867	15,125,000	(55,867)
					<u>\$ (503,758)</u>

**DEWISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Barclays Bank PLC	BRL 50,647	USD 9,319	03/02/2021	\$ 281,347
Barclays Bank PLC	USD 9,308	BRL 50,647	04/05/2021	(282,855)
BNP Paribas SA	USD 2,107	EUR 1,730	03/17/2021	(19,182)
BNP Paribas SA	ZAR 70,985	USD 4,843	04/08/2021	176,377
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 104,847	AUD 137,723	03/05/2021	1,124,550
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,561	CAD 1,997	03/05/2021	9,320
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 22	CNH 20	03/05/2021	(266)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,908	GBP 1,399	03/05/2021	40,322
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,778	NZD 6,637	03/05/2021	18,868
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,257	PLN 19,627	03/05/2021	(19,211)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 7,707	SGD 10,270	03/05/2021	(2,653)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 57,483	ZAR 860,906	03/05/2021	(607,822)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 246	CNH 1,583	03/12/2021	(1,960)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 184,103	EUR 151,476	03/25/2021	(1,226,708)
Citibank, NA	USD 9,362	BRL 50,647	03/02/2021	(324,409)
Citibank, NA	CLP 3,380,925	USD 4,833	03/18/2021	160,645
Citibank, NA	USD 4,568	CLP 3,379,405	03/18/2021	101,878
Credit Suisse International	USD 4,553	TRY 32,279	03/26/2021	(253,221)
Deutsche Bank AG	USD 6,890	INR 512,355	04/15/2021	(7,120)
HSBC Bank USA	TRY 13,714	USD 1,907	03/26/2021	80,651
HSBC Bank USA	IDR 83,580,165	USD 5,969	04/15/2021	202,771
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 5,911	IDR 83,580,165	04/15/2021	(144,941)
Morgan Stanley & Co. LLC	EUR 825	USD 1,006	03/17/2021	9,882
Morgan Stanley & Co. LLC	USD 761	EUR 626	03/17/2021	(5,407)
Morgan Stanley & Co. LLC	TRY 21,246	USD 2,988	03/26/2021	158,119
Morgan Stanley & Co. LLC	USD 4,770	TRY 36,483	03/26/2021	89,080
Royal Bank of Scotland PLC	TRY 16,538	USD 2,266	03/26/2021	63,539
Standard Chartered Bank	TRY 17,264	USD 2,295	03/26/2021	(4,513)
UBS AG	EUR 9,560	USD 11,678	03/17/2021	139,054
UBS AG	USD 4,751	RUB 353,223	03/24/2021	(30,241)
UBS AG	USD 4,697	ZAR 71,204	04/08/2021	(15,990)
UBS AG	MXN 93,086	USD 4,433	04/16/2021	6,030
UBS AG	USD 4,530	MXN 93,605	04/16/2021	(78,789)
				\$ (362,855)
			Wertsteigerung	\$ 2,662,433
			Wertminderung	\$ (3,025,288)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

**VERKAUFTE CREDIT-DEFAULT-SWAPTIONS**

Referenz-Obligation	Gegenpartei	Kauf-/Ver- aufschutz	Ausübungsk- skurs	Fälligkeit	Nominal- betrag (000)	Erhaltene Prämien	Marktwert
Call - CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	Morgan Stanley & Co. International PLC	Sell	110.00%	04/21/2021	USD 141,517	\$ 424,551	\$ (232,725)
Put - CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	Morgan Stanley & Co. International PLC	Sell	105.00%	04/21/2021	USD 141,517	\$ 679,282	\$ (940,168)
Insgesamt						<u>\$ 1,103,833</u>	<u>\$ (1,172,893)</u>

**ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS**

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Kaufkontrakte</b>					
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	CDX-EM Series 34, 5 Year Index	12/20/2025	USD 3,827	\$ 160,782	\$ (30,214)

**ZENTRAL ABGERECHNETE INFLATIONSSWAPS (CPI)**

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	USD 6,380	02/22/2051	CPI#	2.348%	\$ 299,881

# Variabler Zinssatz auf Basis der gemäß Verbraucherpreisindex ermittelten Inflationsrate.



ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	BRL 121,949	01/02/2023	1 Day CDI	4.935%	\$ (169,521)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	USD 10,110	02/22/2051	1.854%	3 Month LIBOR	120,188
Insgesamt					\$ (49,333)
				Wertsteigerung	\$ 120,188
				Wertminderung	\$ (169,521)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Verkaufskontrakte</b>						
Morgan Stanley & Co. International PLC	Ukraine International Bond	06/20/2025	USD 830	\$ (99,521)	\$ (196,712)	\$ 97,191
Swaps insgesamt						\$ 317,525

- (a) Not leidend.
- (b) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 28. Februar 2021.
- (c) Notleidendes fälliges Wertpapier.
- (d) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (e) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (f) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (g) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- BRL – Brazilian Real
- CAD – Canadian Dollar
- CLP – Chilean Peso
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- COP – Colombian Peso
- EGP – Egyptian Pound
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- IDR – Indonesian Rupiah
- INR – Indian Rupee
- MXN – Mexican Peso
- NZD – New Zealand Dollar
- PLN – Polish Zloty
- RUB – Russian Ruble
- SGD – Singapore Dollar
- TRY – Turkish Lira
- USD – United States Dollar
- ZAR – South African Rand

Glossar:

- CBT – Chicago Board of Trade
- CDI – Brazil CETIP Interbank Deposit Rate
- CDX-NAHY – North American High Yield Credit Default Swap Index
- CJSC – Closed Joint Stock Company

CME	– Chicago Mercantile Exchange
CPI	– Consumer Price Index
INTRCONX	– Inter-Continental Exchange
JSC	– Joint Stock Company
LCH	– London Clearing House
LIBOR	– London Interbank Offered Rate
PJSC	– Public Joint Stock Company

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>					
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-2A, Class B1(a)	2.77%	08/25/2028	USD 3,180	\$ 3,192,577	0.2%
Series 2018-2A, Class M1C(a)	1.72%	08/25/2028	5,494	5,503,174	0.4
Series 2019-1A, Class M1B(a)	1.87%	03/25/2029	8,000	8,022,733	0.6
Series 2019-1A, Class M2(a)	2.82%	03/25/2029	3,090	3,105,411	0.2
Series 2019-2A, Class M2(a)	3.22%	04/25/2029	2,000	2,013,904	0.2
Series 2019-3A, Class M1C(a)	2.07%	07/25/2029	6,115	6,180,870	0.5
Series 2019-4A, Class M1B(a)	2.12%	10/25/2029	5,000	5,020,303	0.4
Series 2019-4A, Class M2(a)	2.97%	10/25/2029	5,000	5,041,106	0.4
Series 2020-2A, Class M2(a)	6.12%	08/26/2030	2,004	2,120,545	0.2
Series 2020-3A, Class M2(a)	4.97%	10/25/2030	4,000	4,122,357	0.3
Series 2020-4A, Class M2B(a)	3.72%	06/25/2030	4,000	4,032,927	0.3
Chase Mortgage Finance Corp.,					
Series 2016-2, Class M4(b)	3.75%	12/25/2045	577	580,387	0.0
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2018-R07, Class 1B1(a)	4.47%	04/25/2031	4,014	4,114,349	0.3
Series 2019-HRP1, Class M2(a)	2.28%	11/25/2039	4,720	4,687,458	0.3
Series 2019-R01, Class 2B1(a)	4.47%	07/25/2031	1,191	1,207,899	0.1
Series 2019-R03, Class 1B1(a)	4.22%	09/25/2031	1,000	1,023,050	0.1
Series 2019-R04, Class 2B1(a)	5.37%	06/25/2039	2,000	2,044,939	0.2
Series 2019-R05, Class 1B1(a)	4.22%	07/25/2039	5,589	5,575,025	0.4
Series 2019-R06, Class 2B1(a)	3.87%	09/25/2039	1,500	1,472,831	0.1
Series 2019-R07, Class 1B1(a)	3.52%	10/25/2039	4,130	4,030,014	0.3
Series 2020-R01, Class 1B1(a)	3.37%	01/25/2040	5,250	5,094,217	0.4
Series 2020-R02, Class 2B1(a)	3.13%	01/25/2040	2,000	1,938,835	0.1
Series 2020-SBT1, Class 1B1(a)	6.87%	02/25/2040	2,750	2,696,047	0.2
Series 2020-SBT1, Class 1M2(a)	3.77%	02/25/2040	3,250	3,338,807	0.2
Series 2020-SBT1, Class 2B1(a)	6.72%	02/25/2040	2,850	2,835,839	0.2
Series 2020-SBT1, Class 2M2(a)	3.78%	02/25/2040	5,680	5,858,470	0.4
Eagle Re Ltd.					
Series 2018-1, Class M2(a)	3.13%	11/25/2028	6,000	6,052,567	0.4
Series 2019-1, Class M2(a)	3.42%	04/25/2029	2,000	2,015,522	0.2
Series 2020-1, Class M2(a)	2.12%	01/25/2030	5,000	4,718,639	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Series 2018-HQA2, Class M2(a)	2.43%	10/25/2048	3,000	3,007,688	0.2
Series 2018-SPI1, Class B(b)	3.73%	02/25/2048	1,250	1,142,743	0.1
Series 2019-DNA2, Class B1(a)	4.48%	03/25/2049	1,000	1,035,127	0.1
Series 2019-DNA2, Class M2(a)	2.58%	03/25/2049	3,575	3,596,692	0.3
Series 2019-DNA4, Class B1(a)	2.82%	10/25/2049	4,300	4,307,875	0.3
Series 2019-HQA1, Class B1(a)	4.52%	02/25/2049	2,800	2,891,290	0.2
Series 2019-HQA3, Class M2(a)	1.98%	09/25/2049	1,773	1,766,422	0.1
Series 2020-DNA1, Class B1(a)	2.43%	01/25/2050	4,000	3,975,190	0.3
Series 2020-DNA3, Class B1(a)	5.23%	06/25/2050	1,000	1,039,120	0.1
Series 2020-DNA5, Class B1(a)	4.84%	10/25/2050	3,600	3,733,918	0.3
Series 2020-DNA5, Class B2(a)	11.54%	10/25/2050	3,000	3,694,574	0.3
Series 2020-HQA3, Class B1(a)	5.87%	07/25/2050	1,000	1,060,080	0.1
Series 2020-HQA3, Class M2(a)	3.73%	07/25/2050	28	28,114	0.0
Series 2020-HQA5, Class B1(a)	4.04%	11/25/2050	1,500	1,549,060	0.1
Series 2021-DNA1, Class B1(a)	2.69%	01/25/2051	3,000	2,980,856	0.2
Series 2021-DNA1, Class B2(a)	4.79%	01/25/2051	3,000	2,971,327	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2015-DN1, Class M3(a)	4.28%	01/25/2025	779	779,643	0.1
Series 2015-DNA1, Class B(a)	9.33%	10/25/2027	7,254	8,412,163	0.6
Series 2015-DNA1, Class M3(a)	3.42%	10/25/2027	5,897	6,016,745	0.4
Series 2015-DNA2, Class B(a)	7.68%	12/25/2027	8,871	9,580,926	0.7
Series 2015-DNA2, Class M3(a)	4.02%	12/25/2027	374	379,987	0.0
Series 2015-DNA3, Class B(a)	9.48%	04/25/2028	6,445	7,622,359	0.6
Series 2015-HQ1, Class B(a)	10.87%	03/25/2025	4,517	4,788,538	0.4
Series 2015-HQ2, Class B(a)	8.07%	05/25/2025	2,888	2,957,014	0.2
Series 2015-HQA1, Class B(a)	8.92%	03/25/2028	3,460	3,763,463	0.3
Series 2015-HQA2, Class B(a)	10.62%	05/25/2028	3,605	4,060,131	0.3
Series 2016-DNA1, Class B(a)	10.13%	07/25/2028	1,919	2,168,179	0.2
Series 2016-DNA2, Class B(a)	10.62%	10/25/2028	6,762	7,920,933	0.6
Series 2016-DNA3, Class B(a)	11.37%	12/25/2028	1,485	1,751,838	0.1
Series 2016-DNA4, Class B(a)	8.72%	03/25/2029	992	1,034,274	0.1
Series 2016-HQA1, Class B(a)	12.87%	09/25/2028	2,491	3,072,866	0.2
Series 2016-HQA2, Class B(a)	11.62%	11/25/2028	498	590,404	0.0
Series 2016-HQA3, Class B(a)	9.12%	03/25/2029	1,492	1,588,479	0.1
Series 2017-DNA1, Class B1(a)	5.08%	07/25/2029	4,000	4,316,096	0.3
Series 2017-DNA2, Class B1(a)	5.27%	10/25/2029	1,000	1,084,485	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2017-DNA3, Class B1(a)	4.58%	03/25/2030	USD 15,930	\$ 16,785,830	1.2%
Series 2017-HQA2, Class B1(a)	4.88%	12/25/2029	4,165	4,423,781	0.3
Series 2017-HQA2, Class M2B(a)	2.78%	12/25/2029	6,632	6,643,169	0.5
Series 2017-HQA3, Class B1(a)	4.57%	04/25/2030	4,250	4,355,002	0.3
Series 2018-DNA2, Class M2(a)	2.28%	12/25/2030	2,000	2,003,827	0.1
Series 2018-HQA2, Class B1(a)	4.38%	10/25/2048	5,750	5,945,700	0.4
Series 2018-SPI2, Class B(b)	3.81%	05/25/2048	999	917,477	0.1
Series 2018-SPI3, Class B(b)	4.15%	08/25/2048	1,000	952,465	0.1
Series 2019-DNA3, Class B1(a)	3.38%	07/25/2049	2,000	2,005,620	0.1
Series 2019-FTR2, Class B1(a)	3.12%	11/25/2048	1,250	1,186,705	0.1
Series 2019-FTR2, Class M2(a)	2.28%	11/25/2048	10,500	10,455,521	0.8
Series 2019-HQA2, Class B1(a)	4.22%	04/25/2049	2,250	2,300,791	0.2
Series 2019-HQA4, Class B1(a)	3.08%	11/25/2049	5,500	5,479,807	0.4
Series 2020-DNA5, Class M2(a)	2.84%	10/25/2050	4,000	4,029,786	0.3
<b>Federal National Mortgage Association</b>					
<b>Connecticut Avenue Securities</b>					
Series 2013-C01, Class M2(a)	5.38%	10/25/2023	962	994,193	0.1
Series 2014-C04, Class 1M2(a)	5.03%	11/25/2024	909	935,628	0.1
Series 2015-C02, Class 1M2(a)	4.13%	05/25/2025	1,763	1,800,292	0.1
Series 2015-C03, Class 1M2(a)	5.13%	07/25/2025	1,787	1,830,420	0.1
Series 2015-C04, Class 1M2(a)	5.83%	04/25/2028	6,259	6,643,755	0.5
Series 2015-C04, Class 2M2(a)	5.68%	04/25/2028	2,969	3,121,614	0.2
Series 2016-C01, Class 1B(a)	11.87%	08/25/2028	2,150	2,613,083	0.2
Series 2016-C02, Class 1B(a)	12.37%	09/25/2028	4,968	6,154,072	0.5
Series 2016-C03, Class 1B(a)	11.87%	10/25/2028	3,478	4,239,236	0.3
Series 2016-C03, Class 2B(a)	12.87%	10/25/2028	3,224	3,956,937	0.3
Series 2016-C03, Class 2M2(a)	6.03%	10/25/2028	690	724,789	0.1
Series 2016-C04, Class 1B(a)	10.38%	01/25/2029	3,225	3,767,064	0.3
Series 2016-C05, Class 2B(a)	11.24%	01/25/2029	4,919	5,847,863	0.4
Series 2016-C06, Class 1B(a)	9.37%	04/25/2029	5,060	5,638,120	0.4
Series 2016-C07, Class 2B(a)	9.62%	05/25/2029	3,563	4,060,031	0.3
Series 2017-C02, Class 2B1(a)	5.62%	09/25/2029	10,313	11,008,213	0.8
Series 2017-C02, Class 2M2C(a)	3.78%	09/25/2029	5,000	5,146,584	0.4
Series 2017-C03, Class 1B1(a)	4.97%	10/25/2029	1,000	1,085,254	0.1
Series 2017-C03, Class 1M2(a)	3.13%	10/25/2029	903	918,889	0.1
Series 2017-C03, Class 1M2C(a)	3.12%	10/25/2029	3,778	3,833,949	0.3
Series 2017-C04, Class 2M2(a)	2.97%	11/25/2029	326	331,450	0.0
Series 2017-C05, Class 1M2(a)	2.32%	01/25/2030	2,041	2,055,723	0.2
Series 2017-C06, Class 1B1(a)	4.27%	02/25/2030	480	497,305	0.0
Series 2017-C06, Class 2B1(a)	4.58%	02/25/2030	3,950	4,077,850	0.3
Series 2017-C07, Class 1B1(a)	4.12%	05/25/2030	5,415	5,563,119	0.4
Series 2017-C07, Class 1M2C(a)	2.52%	05/25/2030	5,894	5,935,250	0.4
Series 2017-C07, Class 2B1(a)	4.58%	05/25/2030	2,736	2,860,464	0.2
Series 2018-C01, Class 1B1(a)	3.67%	07/25/2030	7,000	7,043,847	0.5
Series 2018-C02, Class 2B1(a)	4.12%	08/25/2030	3,750	3,833,980	0.3
Series 2018-C04, Class 2B1(a)	4.63%	12/25/2030	3,500	3,611,924	0.3
Series 2018-C05, Class 1B1(a)	4.38%	01/25/2031	4,000	4,139,520	0.3
<b>Home Re Ltd.</b>					
Series 2019-1, Class M2(a)	3.38%	05/25/2029	4,000	3,924,637	0.3
Series 2020-1, Class M2(a)	5.38%	10/25/2030	1,000	1,014,210	0.1
Series 2021-1, Class M1C(a)	2.42%	07/25/2033	8,000	7,999,996	0.6
Series 2021-1, Class M2(a)	2.97%	07/25/2033	5,000	4,999,996	0.4
<b>Mortgage Insurance-Linked Notes, Series 2019-1, Class M2(a)</b>					
Oaktown Re II Ltd., Series 2018-1A, Class M2(a)	3.03%	11/26/2029	8,500	8,217,278	0.6
Oaktown Re V Ltd., Series 2020-2A, Class M2(a)	2.98%	07/25/2028	5,000	5,036,724	0.4
Oaktown Re V Ltd., Series 2020-2A, Class M2(a)	5.38%	10/25/2030	4,000	4,094,605	0.3
<b>PMT Credit Risk Transfer Trust</b>					
Series 2019-1R, Class A(a)	2.13%	03/27/2024	3,369	3,218,881	0.2
Series 2019-2R, Class A(a)	2.88%	05/27/2023	6,803	6,581,289	0.5
Series 2019-3R, Class A(a)	2.83%	10/27/2022	4,294	4,295,201	0.3
<b>Radnor Re Ltd.</b>					
Series 2019-1, Class M1B(a)	2.08%	02/25/2029	4,470	4,481,606	0.3
Series 2020-1, Class M2A(a)	2.13%	02/25/2030	1,000	992,510	0.1
Series 2020-2, Class M2(a)	5.73%	10/25/2030	2,000	2,063,611	0.2
<b>STACR Trust, Series 2018-DNA3, Class B1(a)</b>					
Series 2018-DNA3, Class B1(a)	4.02%	09/25/2048	2,550	2,653,318	0.2
<b>Triangle Re Ltd.</b>					
Series 2020-1, Class M2(a)	5.73%	10/25/2030	3,000	3,094,419	0.2
Series 2021-1, Class B1(a)	4.60%	08/25/2033	2,000	2,000,769	0.1
Series 2021-1, Class M2(a)	4.01%	08/25/2033	5,000	5,001,177	0.4
				469,735,527	34.8
<b>VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE</b>					
<b>Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS</b>					
Series 3928, Class SE(a) (c)	6.47%	09/15/2041	5,391	1,289,049	0.1
Series 4372, Class JS(a) (c)	5.99%	08/15/2044	10,364	2,118,255	0.2
Series 4416, Class BS(a) (c)	5.99%	12/15/2044	2,476	519,367	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 4656, Class SK(a) (c) . . . . .	5.94%	02/15/2047	USD 2,488	\$ 522,363	0.0%
Series 4719, Class JS(a) (c) . . . . .	6.04%	09/15/2047	5,107	958,515	0.1
Series 4767, Class SB(a) (c) . . . . .	6.09%	03/15/2048	5,674	1,075,344	0.1
Series 4931, Class SJ(a) (c) . . . . .	5.93%	11/25/2049	8,752	1,526,458	0.1
Series 4981, Class HS(a) (c) . . . . .	5.98%	06/25/2050	13,111	2,241,903	0.2
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2011-131, Class ST(a) (c) . . . . .	6.42%	12/25/2041	6,103	1,230,929	0.1
Series 2012-122, Class MS(a) (c) . . . . .	5.98%	11/25/2042	2,469	572,157	0.0
Series 2013-15, Class SA(a) (c) . . . . .	6.03%	03/25/2043	5,792	1,319,221	0.1
Series 2014-40, Class HS(a) (c) . . . . .	6.58%	07/25/2044	3,413	902,533	0.1
Series 2015-90, Class SL(a) (c) . . . . .	6.03%	12/25/2045	6,618	1,580,370	0.1
Series 2016-106, Class ES(a) (c) . . . . .	5.88%	01/25/2047	2,366	464,530	0.0
Series 2016-69, Class DS(a) (c) . . . . .	5.98%	10/25/2046	11,164	2,222,133	0.2
Series 2017-20, Class SJ(a) (c) . . . . .	5.98%	04/25/2047	6,298	1,401,574	0.1
Series 2017-97, Class LS(a) (c) . . . . .	6.08%	12/25/2047	7,063	1,764,638	0.1
Series 2017-97, Class SW(a) (c) . . . . .	6.08%	12/25/2047	6,914	1,571,493	0.1
Series 2018-28, Class SB(a) (c) . . . . .	6.08%	05/25/2048	6,706	1,445,220	0.1
Series 2018-30, Class SA(a) (c) . . . . .	6.08%	05/25/2048	5,846	1,139,417	0.1
Series 2018-58, Class SA(a) (c) . . . . .	6.08%	08/25/2048	3,383	614,385	0.0
Series 2020-26, Class GS(a) (c) . . . . .	5.88%	05/25/2050	6,758	1,237,313	0.1
Government National Mortgage Association					
Series 2014-181, Class TV(a) (c) . . . . .	6.14%	02/16/2035	5,175	790,657	0.1
Series 2015-3, Class DS(a) (c) . . . . .	5.49%	11/20/2041	5,871	646,276	0.1
				<u>29,154,100</u>	<u>2.2</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4973, Class BI(d) . . . . .	4.50%	05/25/2050	10,462	1,789,296	0.1
Series 5011, Class MI(d) . . . . .	3.00%	09/25/2050	8,179	1,323,758	0.1
Series 5013, Class JI(d) . . . . .	4.00%	09/25/2050	17,012	2,277,190	0.2
Series 5015, Class BI(d) . . . . .	4.00%	09/25/2050	16,737	2,891,919	0.2
Series 5015, Class DI(d) . . . . .	4.00%	09/25/2050	10,886	1,856,850	0.2
Series 5018, Class EI(d) . . . . .	4.00%	10/25/2050	12,189	1,793,604	0.1
Series 5030, Class EI(d) . . . . .	3.50%	10/25/2050	16,686	2,984,783	0.2
Series 5040, Class AI(d) . . . . .	3.50%	11/25/2050	3,791	605,840	0.1
Series 5043, Class IO(d) . . . . .	5.00%	11/25/2050	14,526	2,753,840	0.2
Series 5049, Class CI(d) . . . . .	3.50%	12/25/2050	21,434	3,036,975	0.2
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2015-30, Class EI(d) . . . . .	5.00%	05/25/2045	749	123,201	0.0
Series 2016-64, Class BI(d) . . . . .	5.00%	09/25/2046	6,744	1,118,311	0.1
Series 2020-89, Class KI(d) . . . . .	4.00%	12/25/2050	17,824	2,889,711	0.2
				<u>25,445,278</u>	<u>1.9</u>
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust					
Series 2005-50CB, Class 1A1 . . . . .	5.50%	11/25/2035	1,351	1,291,645	0.1
Series 2005-86CB, Class A11 . . . . .	5.50%	02/25/2036	248	201,634	0.0
Series 2005-86CB, Class A8 . . . . .	5.50%	02/25/2036	183	148,576	0.0
Series 2006-11CB, Class 1A2 . . . . .	6.00%	05/25/2036	982	776,318	0.1
Series 2006-28CB, Class A14 . . . . .	6.25%	10/25/2036	469	346,084	0.0
Series 2006-28CB, Class A18 . . . . .	6.00%	10/25/2036	794	570,083	0.0
BCAP LLC Trust,					
Series 2008-IND2, Class A2 . . . . .	3.20%	04/25/2038	911	870,914	0.1
Chase Mortgage Finance Trust,					
Series 2007-S5, Class 1A17 . . . . .	6.00%	07/25/2037	1,919	1,352,766	0.1
CitiMortgage Alternative Loan Trust,					
Series 2007-A6, Class 1A11 . . . . .	6.00%	06/25/2037	148	147,356	0.0
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust,					
Series 2006-10, Class 1A8 . . . . .	6.00%	05/25/2036	1,462	1,064,210	0.1
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
Series 2005-FA8, Class 1A12 . . . . .	5.50%	11/25/2035	124	91,651	0.0
Series 2006-FA2, Class 1A3 . . . . .	6.00%	05/25/2036	220	150,142	0.0
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust,					
Series 2006-7, Class 4A4 . . . . .	6.00%	06/25/2036	541	416,816	0.0
				<u>7,428,195</u>	<u>0.5</u>
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Alternative Loan Trust,					
Series 2005-19CB, Class A2(a) (c) . . . . .	16.68%	06/25/2035	90	99,941	0.0
Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust					
Series 2005-AC7, Class A2(a) (c) . . . . .	18.28%	10/25/2035	298	284,766	0.1
Series 2005-AC9, Class A4(a) (c) . . . . .	18.14%	12/25/2035	335	281,635	0.0
Chase Mortgage Finance Corp.,					
Series 2016-1, Class M4(b) . . . . .	3.75%	04/25/2045	1,555	1,545,913	0.1
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates,					
Series 2005-9, Class 4A1(a) (c) . . . . .	19.20%	10/25/2035	94	117,123	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Lehman Mortgage Trust, Series 2007-1, Class 3A2(a) (c) . . . . .	7.12%	02/25/2037	USD 883	\$ 225,662	0.0%
Residential Accredited Loans, Inc. Trust, Series 2006-QO3, Class A1(a) . . . . .	0.55%	04/25/2046	2,616	1,059,458	0.1
				<u>3,614,498</u>	<u>0.3</u>
				<u>535,377,598</u>	<u>39.7</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>					
<b>NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS</b>					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E . . . . .	4.65%	02/10/2036	2,000	2,101,349	0.2
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2013-WBRK, Class D . . . . .	3.53%	03/10/2037	3,000	2,694,911	0.2
Banc of America Commercial Mortgage Trust Series 2015-UBS7, Class AS . . . . .	3.99%	09/15/2048	1,140	1,254,329	0.1
Series 2015-UBS7, Class XA(d) . . . . .	0.79%	09/15/2048	76,527	2,326,208	0.2
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(d) . . . . .	1.01%	11/15/2050	15,574	724,895	0.1
CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(d) . . . . .	1.01%	02/10/2050	99,604	4,678,357	0.4
CFCRE Commercial Mortgage Trust Series 2011-C1, Class E . . . . .	5.65%	04/15/2044	230	226,401	0.0
Series 2016-C4, Class AM . . . . .	3.69%	05/10/2058	190	206,311	0.0
Series 2016-C7, Class A3 . . . . .	3.84%	12/10/2054	2,500	2,799,025	0.2
Citigroup Commercial Mortgage Trust Series 2013-GC11, Class D . . . . .	4.42%	04/10/2046	1,056	1,068,737	0.1
Series 2013-GC17, Class D . . . . .	5.11%	11/10/2046	2,430	2,182,028	0.2
Series 2015-GC29, Class XA(d) . . . . .	1.04%	04/10/2048	6,695	246,697	0.0
Series 2016-C3, Class XA(d) . . . . .	1.14%	11/15/2049	101,363	4,313,828	0.3
Series 2016-P3, Class XA(d) . . . . .	1.70%	04/15/2049	44,841	2,824,746	0.2
Series 2017-C4, Class XA(d) . . . . .	1.08%	10/12/2050	57,688	2,947,156	0.2
Series 2017-P8, Class XA(d) . . . . .	0.90%	09/15/2050	43,986	2,130,212	0.2
Series 2018-C6, Class XA(d) . . . . .	0.78%	11/10/2051	7,946	416,817	0.0
Commercial Mortgage Trust Series 2010-C1, Class D . . . . .	5.59%	07/10/2046	2,500	2,543,791	0.2
Series 2010-C1, Class F . . . . .	4.00%	07/10/2046	3,780	2,843,840	0.2
Series 2012-CR2, Class G . . . . .	4.25%	08/15/2045	1,500	500,367	0.0
Series 2012-CR3, Class XA(d) . . . . .	1.84%	10/15/2045	3,038	63,510	0.0
Series 2012-CR5, Class XA(d) . . . . .	1.51%	12/10/2045	14,587	326,063	0.0
Series 2013-LC6, Class D . . . . .	4.31%	01/10/2046	640	615,661	0.1
Series 2013-LC6, Class XA(d) . . . . .	1.32%	01/10/2046	13,423	244,722	0.0
Series 2014-CR16, Class D . . . . .	4.94%	04/10/2047	1,841	1,719,144	0.1
Series 2014-CR19, Class XA(d) . . . . .	0.97%	08/10/2047	76,978	2,060,243	0.2
Series 2014-CR20, Class XA(d) . . . . .	1.02%	11/10/2047	8,223	255,365	0.0
Series 2014-LC17, Class B . . . . .	4.49%	10/10/2047	2,000	2,202,566	0.2
Series 2014-UBS6, Class AM . . . . .	4.05%	12/10/2047	190	207,434	0.0
Series 2015-CR22, Class XA(d) . . . . .	0.89%	03/10/2048	16,624	449,035	0.0
Series 2015-CR27, Class XA(d) . . . . .	0.91%	10/10/2048	93,567	3,403,433	0.3
Series 2015-LC19, Class XA(d) . . . . .	1.12%	02/10/2048	50,296	1,839,192	0.1
Series 2015-LC21, Class XA(d) . . . . .	0.69%	07/10/2048	52,483	1,314,724	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(d) . . . . .	0.96%	02/10/2049	57,837	2,230,767	0.2
CSAIL Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C8, Class XA(d) . . . . .	1.23%	06/15/2050	73,202	3,384,818	0.3
DBUBS Mortgage Trust, Series 2011-LC2A, Class D . . . . .	5.46%	07/10/2044	1,500	1,467,896	0.1
GS Mortgage Securities Trust Series 2011-GC5, Class C . . . . .	5.35%	08/10/2044	4,850	4,075,631	0.3
Series 2011-GC5, Class D . . . . .	5.35%	08/10/2044	493	300,944	0.0
Series 2012-GC6, Class D . . . . .	5.65%	01/10/2045	3,968	3,476,154	0.3
Series 2012-GCJ7, Class A4 . . . . .	3.38%	05/10/2045	150	152,182	0.0
Series 2013-GC12, Class C . . . . .	4.18%	06/10/2046	3,000	2,987,002	0.2
Series 2013-GC13, Class C . . . . .	4.08%	07/10/2046	4,537	4,467,371	0.3
Series 2013-GC13, Class D . . . . .	4.08%	07/10/2046	2,190	1,411,675	0.1
Series 2014-GC18, Class D . . . . .	4.99%	01/10/2047	1,558	496,927	0.0
Series 2014-GC22, Class A5 . . . . .	3.86%	06/10/2047	2,500	2,726,767	0.2
Series 2014-GC22, Class XA(d) . . . . .	0.98%	06/10/2047	7,588	150,889	0.0
Series 2016-GS3, Class A4 . . . . .	2.85%	10/10/2049	2,500	2,663,739	0.2
Series 2016-GS3, Class XA(d) . . . . .	1.22%	10/10/2049	77,765	4,238,935	0.3
Series 2017-GS5, Class XA(d) . . . . .	0.81%	03/10/2050	54,964	2,346,730	0.2
Series 2017-GS6, Class AS . . . . .	3.64%	05/10/2050	2,000	2,192,381	0.2
Series 2017-GS7, Class XA(d) . . . . .	1.12%	08/10/2050	26,909	1,453,769	0.1
Series 2017-GS8, Class XA(d) . . . . .	0.97%	11/10/2050	38,422	1,847,920	0.1
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust Series 2011-C4, Class C . . . . .	5.34%	07/15/2046	3,500	3,507,726	0.3
Series 2011-C5, Class D . . . . .	5.42%	08/15/2046	1,056	949,076	0.1



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2012-C6, Class E	5.14%	05/15/2045	USD 2,250	\$ 1,411,680	0.1%
Series 2012-C6, Class G	2.97%	05/15/2045	2,500	1,089,108	0.1
Series 2012-C8, Class B	3.98%	10/15/2045	5,000	5,009,675	0.4
Series 2012-C8, Class C	4.62%	10/15/2045	3,000	2,751,460	0.2
Series 2012-C8, Class E	4.67%	10/15/2045	1,645	1,123,162	0.1
Series 2012-CBX, Class C	5.13%	06/15/2045	3,000	2,617,634	0.2
Series 2013-C10, Class B	3.67%	12/15/2047	2,213	2,289,186	0.2
Series 2013-C10, Class D	4.11%	12/15/2047	1,550	1,564,969	0.1
Series 2014-C20, Class XA(d)	0.94%	07/15/2047	14,420	221,288	0.0
Series 2016-JP2, Class XA(d)	1.79%	08/15/2049	41,794	3,211,450	0.2
Series 2016-JP3, Class B	3.40%	08/15/2049	2,000	2,108,846	0.2
<b>JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust</b>					
Series 2013-C14, Class D	4.70%	08/15/2046	3,425	2,554,949	0.2
Series 2013-C17, Class D	4.89%	01/15/2047	2,535	2,531,225	0.2
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	2,000	2,099,974	0.2
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.83%	09/15/2047	101,342	2,485,441	0.2
Series 2014-C24, Class C	4.41%	11/15/2047	6,000	5,768,152	0.4
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(d)	1.43%	07/12/2050	33,734	2,117,981	0.2
<b>Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust</b>					
Series 2012-C5, Class XA(d)	1.41%	08/15/2045	17,541	238,828	0.0
Series 2012-C6, Class E	4.61%	11/15/2045	425	384,358	0.0
Series 2012-C6, Class XA(d)	1.61%	11/15/2045	3,780	65,608	0.0
Series 2014-C18, Class C	4.53%	10/15/2047	1,333	1,423,733	0.1
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	1,225	1,197,512	0.1
Series 2014-C19, Class XA(d)	1.00%	12/15/2047	29,194	845,505	0.1
Series 2015-C20, Class XA(d)	1.28%	02/15/2048	61,551	2,344,349	0.2
Series 2015-C22, Class XA(d)	1.03%	04/15/2048	48,750	1,539,954	0.1
Series 2015-C25, Class XA(d)	1.05%	10/15/2048	31,796	1,182,578	0.1
<b>Morgan Stanley Capital I Trust</b>					
Series 2011-C3, Class C	5.24%	07/15/2049	2,500	2,435,693	0.2
Series 2016-UBS9, Class XA(d)	1.16%	03/15/2049	61,033	2,730,878	0.2
<b>UBS Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2012-C1, Class D	5.57%	05/10/2045	2,576	2,035,503	0.2
Series 2017-C3, Class XA(d)	1.10%	08/15/2050	37,734	1,951,520	0.1
Series 2017-C4, Class XA(d)	1.05%	10/15/2050	20,582	1,148,642	0.1
Series 2017-C5, Class XA(d)	1.00%	11/15/2050	39,055	1,816,948	0.1
Series 2018-C14, Class XA(d)	0.99%	12/15/2051	51,894	3,177,765	0.2
Series 2018-C15, Class XA(d)	0.94%	12/15/2051	30,282	1,725,533	0.1
<b>UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2012-C4, Class XA(d)	1.60%	12/10/2045	13,251	265,550	0.0
Series 2013-C5, Class XA(d)	0.91%	03/10/2046	30,967	410,625	0.0
Series 2013-C6, Class D	4.31%	04/10/2046	3,618	2,683,628	0.2
Series 2013-C6, Class XA(d)	1.10%	04/10/2046	3,331	58,243	0.0
<b>Wells Fargo Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2012-LC5, Class D	4.76%	10/15/2045	380	387,250	0.0
Series 2015-C27, Class XA(d)	0.89%	02/15/2048	145,374	4,104,164	0.3
Series 2015-C31, Class A3	3.43%	11/15/2048	1,272	1,364,398	0.1
Series 2015-NXS3, Class A4	3.62%	09/15/2057	1,425	1,570,910	0.1
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	1,313	1,440,150	0.1
Series 2016-C32, Class XA(d)	1.21%	01/15/2059	58,213	2,894,658	0.2
Series 2016-C33, Class XA(d)	1.62%	03/15/2059	38,005	2,510,239	0.2
Series 2016-C35, Class A3	2.67%	07/15/2048	2,500	2,620,953	0.2
Series 2016-C35, Class B	3.44%	07/15/2048	2,500	2,587,694	0.2
Series 2016-C35, Class XA(d)	1.92%	07/15/2048	36,566	2,819,810	0.2
Series 2016-C36, Class XA(d)	1.28%	11/15/2059	50,903	2,614,769	0.2
Series 2016-LC24, Class XA(d)	1.65%	10/15/2049	27,939	1,948,385	0.1
Series 2016-LC25, Class XA(d)	0.97%	12/15/2059	78,518	2,866,609	0.2
Series 2017-C38, Class XA(d)	1.02%	07/15/2050	30,833	1,530,566	0.1
Series 2017-C39, Class A5	3.42%	09/15/2050	2,500	2,756,742	0.2
Series 2018-C48, Class A5	4.30%	01/15/2052	2,000	2,311,357	0.2
Series 2018-C48, Class XA(d)	0.95%	01/15/2052	48,129	2,919,181	0.2
<b>WF-RBS Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2011-C3, Class C	5.34%	03/15/2044	2,500	2,478,214	0.2
Series 2011-C5, Class E	5.66%	11/15/2044	2,300	2,232,694	0.2
Series 2012-C10, Class B	3.74%	12/15/2045	2,500	2,362,965	0.2
Series 2012-C10, Class XA(d)	1.52%	12/15/2045	19,657	453,913	0.0
Series 2012-C7, Class XA(d)	1.30%	06/15/2045	48,612	466,789	0.0
Series 2012-C8, Class E	4.88%	08/15/2045	2,110	1,619,096	0.1
Series 2012-C8, Class XA(d)	1.79%	08/15/2045	21,688	345,934	0.0
Series 2012-C9, Class D	4.81%	11/15/2045	615	580,116	0.0
Series 2012-C9, Class XA(d)	1.88%	11/15/2045	14,157	321,139	0.0
Series 2013-C11, Class AS	3.31%	03/15/2045	2,000	2,078,661	0.2
Series 2013-C11, Class XA(d)	1.17%	03/15/2045	20,200	370,259	0.0
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.80%	09/15/2057	38,124	852,592	0.1
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	3,164	3,251,729	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	USD 1,290	\$ 1,142,112	0.1%
Series 2014-C25, Class XA(d)	0.81%	11/15/2047	24,405	599,827	0.0
				<u>229,283,404</u>	<u>17.0</u>
<b>NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS</b>					
Ashford Hospitality Trust, Series 2018-KEYS, Class A(a)	1.11%	06/15/2035	3,000	2,988,956	0.2
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2017-SCH, Class AF(a)	1.11%	11/15/2033	3,000	2,926,719	0.2
Braemar Hotels & Resorts Trust, Series 2018-PRME, Class A(a)	0.93%	06/15/2035	5,000	4,981,573	0.4
BX Trust, Series 2018-EXCL, Class A(a)	1.20%	09/15/2037	4,537	4,350,566	0.3
DBWF Mortgage Trust, Series 2018-GLKS, Class E(a)	3.13%	12/19/2030	2,420	2,398,778	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2021-MN1, Class M2(a)	3.84%	01/25/2051	1,700	1,798,269	0.1
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2020-NNN, Class EFL(a)	1.96%	01/16/2037	1,852	1,826,189	0.1
Morgan Stanley Capital I Trust Series 2019-BPR, Class D(a)	4.11%	05/15/2036	2,750	1,875,823	0.2
Series 2019-BPR, Class E(a)	4.86%	05/15/2036	2,250	1,395,379	0.1
Starwood Retail Property Trust, Series 2014-STAR, Class A(a)	1.58%	11/15/2027	990	732,872	0.1
				<u>25,275,124</u>	<u>1.9</u>
<b>STAATLICHE CMBS</b>					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Series K076, Class A2	3.90%	04/25/2028	3,500	4,064,834	0.3
Series K085, Class A2	4.06%	10/25/2028	7,844	9,228,501	0.7
Series K090, Class A2	3.42%	02/25/2029	3,055	3,469,190	0.2
				<u>16,762,525</u>	<u>1.2</u>
				<u>271,321,053</u>	<u>20.1</u>
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABLE VERZINSLICH</b>					
522 Funding CLO Ltd., Series 2017-1A, Class A(a)	1.47%	10/20/2029	5,000	5,002,850	0.4
AGL CLO Ltd. Series 2020-9A, Class D(a)	3.94%	01/20/2034	4,000	4,047,432	0.3
Series 2021-10A, Class A(a)	1.32%	04/15/2034	3,000	3,000,636	0.2
Series 2021-10A, Class D(a)	3.09%	04/15/2034	3,500	3,500,742	0.3
Series 2021-10A, Class E(a)	6.19%	04/15/2034	2,250	2,250,000	0.2
Apidos CLO Series 2017-26A, Class D(a)	6.32%	07/18/2029	1,500	1,480,334	0.1
Series 2020-33A, Class B(a)	2.42%	07/24/2031	4,700	4,714,387	0.4
Series 2020-34A, Class D(a)	3.84%	01/20/2033	1,000	1,007,654	0.1
Series 2020-34A, Class E(a)	7.49%	01/20/2033	2,500	2,523,637	0.2
Series 2021-35A, Class A(a)	1.24%	04/20/2034	3,000	3,000,321	0.2
Series 2021-35A, Class D(a)	2.84%	04/20/2034	3,500	3,500,374	0.3
Series 2021-35A, Class E(a)	5.94%	04/20/2034	2,250	2,250,000	0.2
Ballyrock CLO Ltd. Series 2020-14A, Class C(a)	3.80%	01/20/2034	2,000	2,003,240	0.2
Series 2020-14A, Class D(a)	7.20%	01/20/2034	2,000	2,001,468	0.2
Series 2020-1A, Class B(a)	3.12%	07/20/2030	4,700	4,716,003	0.4
Barings CLO Ltd., Series 2016-2A, Class ER(a)	6.72%	07/20/2028	3,325	3,308,445	0.2
Benefit Street Partners CLO Ltd. Series 2020-22A, Class D(a)	3.64%	01/20/2032	1,000	1,003,723	0.1
Series 2020-22A, Class E(a)	7.14%	01/20/2032	1,500	1,503,347	0.1
Black Diamond CLO Ltd. Series 2016-1A, Class A2AR(a)	1.97%	04/26/2031	5,000	4,936,020	0.4
Series 2017-1A, Class A1A(a)	1.51%	04/24/2029	1,500	1,497,837	0.1
Series 2019-2A, Class B(a)	3.27%	07/23/2032	4,125	4,126,943	0.3
BlueMountain Fuji US CLO Ltd., Series 2017-2A, Class D(a)	6.37%	10/20/2030	1,000	958,989	0.1
Carlyle US CLO Ltd., Series 2017-3A, Class D(a)	6.33%	07/20/2029	1,500	1,364,924	0.1
CBAM Ltd., Series 2017-3A, Class E1(a)	6.72%	10/17/2029	500	491,173	0.0
Dryden CLO Ltd., Series 2018-57A, Class E(a)	5.39%	05/15/2031	1,750	1,657,380	0.1
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(a)	3.29%	07/15/2030	1,500	1,500,294	0.1
Golub Capital Partners LP, Series 2020-48A, Class A1(a)	1.53%	04/17/2033	3,000	3,001,704	0.2
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A2(a)	1.85%	04/26/2031	5,000	5,001,775	0.4
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2018-1A, Class C(a)	3.42%	07/21/2031	2,000	1,863,928	0.1
Madison Park Funding Ltd., Series 2017-26A, Class AR(a)	1.41%	07/29/2030	3,000	3,000,300	0.2
Marble Point CLO XI Ltd., Series 2017-2A, Class A(a)	1.40%	12/18/2030	4,500	4,500,310	0.3
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(a)	2.97%	10/20/2030	2,000	1,971,752	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.					
Series 2019-31A, Class C(a)	2.92%	04/20/2031	USD 1,000	\$ 1,000,943	0.1%
Series 2020-39A, Class D(a)	3.82%	01/20/2032	1,250	1,259,255	0.1
Series 2020-39A, Class E(a)	7.42%	01/20/2032	2,500	2,504,012	0.2
Northwoods Capital Ltd., Series 2017-15A, Class A(a)	1.54%	06/20/2029	1,987	1,984,270	0.1
Oak Hill Credit Partners X-R Ltd.,					
Series 2014-10RA, Class A2A(a)	1.67%	12/12/2030	4,500	4,501,899	0.3
OCP CLO Ltd.					
Series 2018-15A, Class D(a)	6.07%	07/20/2031	1,000	987,977	0.1
Series 2020-18A, Class A(a)	2.02%	04/20/2030	5,000	5,007,110	0.4
Octagon Investment Partners 35 Ltd.,					
Series 2018-1A, Class D(a)	5.42%	01/20/2031	3,000	2,763,954	0.2
OZLM Ltd.					
Series 2018-22A, Class D(a)	5.52%	01/17/2031	1,750	1,605,030	0.1
Series 2017-16A, Class A1(a)	1.45%	05/16/2030	1,492	1,492,710	0.1
Palmer Square CLO Ltd., Series 2020-3A, Class C(a)	4.23%	11/15/2031	1,500	1,517,871	0.1
Pikes Peak CLO					
Series 2018-1A, Class E(a)	6.27%	07/24/2031	1,500	1,450,157	0.1
Series 2018-2A, Class E(a)	6.42%	01/18/2032	3,050	2,950,966	0.2
Series 2021-7A, Class D(a)	3.58%	02/25/2034	5,000	5,004,860	0.4
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	6.19%	07/15/2031	3,000	2,867,619	0.2
Rockford Tower CLO Ltd.					
Series 2017-1A, Class DR(a)	2.89%	04/15/2029	2,000	1,982,970	0.1
Series 2017-2A, Class AR(a)	1.26%	10/15/2029	2,000	1,999,528	0.1
Series 2018-1A, Class D(a)	3.18%	05/20/2031	3,450	3,429,300	0.3
Series 2018-2A, Class B(a)	2.02%	10/20/2031	7,000	7,002,324	0.5
Romark CLO Ltd., Series 2019-3A, Class A2(a)	2.31%	07/15/2032	5,000	5,013,330	0.4
SCFF Ltd., Series 2020-1A, Class A1(a)	2.74%	04/15/2031	2,500	2,504,877	0.2
Symphony CLO Ltd., Series 2021-26A, Class A(a)	1.50%	04/20/2029	1,500	1,500,303	0.1
TCW CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	6.27%	04/25/2031	1,975	1,933,898	0.1
TIAA CLO Ltd.					
Series 2016-1A, Class AR(a)	1.42%	07/20/2031	2,000	2,000,170	0.1
Series 2016-1A, Class B1R(a)	1.97%	07/20/2031	5,000	5,002,250	0.4
Series 2016-1A, Class DR(a)	3.72%	07/20/2031	4,000	3,944,764	0.3
TRESTLES CLO Ltd., Series 2018-2A, Class A2(a)	1.89%	07/25/2031	3,000	3,001,554	0.2
Venture CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(a)	4.22%	07/20/2030	1,500	1,500,900	0.1
Voya CLO Ltd., Series 2016-3A, Class A1R(a)	1.41%	10/18/2031	3,000	3,000,510	0.2
				<u>167,403,233</u>	<u>12.4</u>
<b>ABS-ANLEIHEN</b>					
<b>AUTOS – FESTVERZINSLICH</b>					
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC					
Series 2018-1A, Class C	4.73%	09/20/2024	2,500	2,645,358	0.2
Series 2019-2A, Class C	4.24%	09/22/2025	2,500	2,692,456	0.2
CPS Auto Receivables Trust					
Series 2016-B, Class E	8.14%	05/15/2023	1,410	1,432,383	0.1
Series 2016-C, Class E	8.39%	09/15/2023	2,050	2,075,806	0.2
Series 2018-A, Class D	3.66%	12/15/2023	1,400	1,425,870	0.1
CPS Auto Trust					
Series 2016-D, Class E	6.86%	04/15/2024	3,669	3,728,927	0.3
Series 2017-A, Class E	7.07%	04/15/2024	1,000	1,031,455	0.1
Series 2018-C, Class D	4.40%	06/17/2024	3,500	3,618,931	0.3
Flagship Credit Auto Trust					
Series 2016-2, Class D	8.56%	11/15/2023	2,000	2,008,213	0.1
Series 2016-3, Class E	6.25%	10/15/2023	2,000	2,029,711	0.2
Series 2016-4, Class E	6.44%	01/16/2024	1,000	1,028,518	0.1
Series 2017-1, Class E	6.46%	12/15/2023	2,500	2,584,389	0.2
Series 2017-2, Class E	5.55%	07/15/2024	1,875	1,942,876	0.1
Series 2017-4, Class E	5.02%	02/17/2025	1,250	1,291,705	0.1
Series 2018-1, Class E	5.10%	05/15/2025	3,050	3,208,715	0.2
Series 2018-2, Class E	5.51%	11/17/2025	2,750	2,921,591	0.2
Series 2018-3, Class D	4.15%	12/16/2024	6,000	6,327,619	0.5
Series 2018-3, Class E	5.28%	12/15/2025	4,500	4,816,420	0.4
Series 2018-4, Class E	5.51%	03/16/2026	3,000	3,262,343	0.2
Series 2019-2, Class E	4.52%	12/15/2026	3,500	3,700,438	0.3
Series 2019-3, Class E	3.84%	12/15/2026	3,000	3,152,422	0.2
Series 2019-4, Class E	4.11%	03/15/2027	3,000	3,191,697	0.2
Series 2020-1, Class D	2.48%	03/16/2026	5,000	5,164,471	0.4
Foursight Capital Automobile Receivables Trust,					
Series 2020-1, Class D	2.60%	01/15/2026	2,080	2,131,482	0.2
Hertz Vehicle Financing II LP, Series 2018-1A, Class B	3.60%	02/25/2024	4,000	4,010,396	0.3
Hertz Vehicle Financing LLC, Series 2018-2A, Class A	3.65%	06/27/2022	548	551,226	0.0
				<u>71,975,418</u>	<u>5.4</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS</b>					
Affirm Asset Securitization Trust, Series 2020-A, Class A	2.10%	02/18/2025	USD 2,500	\$ 2,523,771	0.2%
CLUB Credit Trust, Series 2017-P2, Class C	4.91%	01/15/2024	788	794,566	0.1
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I, Series 2019-HP1, Class B	3.48%	12/15/2026	2,800	2,846,016	0.2
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust Series 2018-P1, Class C	5.21%	07/15/2025	1,500	1,532,552	0.1
Series 2018-P2, Class C	5.21%	10/15/2025	1,000	1,010,319	0.1
Hardee's Funding LLC, Series 2020-1A, Class A2	3.98%	12/20/2050	3,000	3,082,558	0.2
Marlette Funding Trust Series 2017-1A, Class C	6.66%	03/15/2024	352	352,813	0.0
Series 2017-2A, Class C	4.58%	07/15/2024	1,551	1,561,545	0.1
Series 2018-1A, Class C	3.69%	03/15/2028	321	321,883	0.0
Series 2018-4A, Class C	4.91%	12/15/2028	3,000	3,065,431	0.2
SoFi Consumer Loan Program LLC Series 2016-2, Class B	4.77%	10/27/2025	1,370	1,381,451	0.1
Series 2017-3, Class B	3.85%	05/25/2026	1,258	1,276,558	0.1
Series 2017-4, Class B	3.59%	05/26/2026	4,250	4,312,323	0.3
Series 2017-6, Class C	4.02%	11/25/2026	2,250	2,316,983	0.2
SoFi Consumer Loan Program Trust Series 2018-1, Class C	3.97%	02/25/2027	2,500	2,583,183	0.2
Series 2018-2, Class C	4.25%	04/26/2027	2,500	2,594,919	0.2
Series 2018-3, Class C	4.67%	08/25/2027	2,500	2,620,968	0.2
				<u>34,177,839</u>	<u>2.5</u>
<b>SONSTIGE VARIABEL VERZINSLICHE ABS</b>					
Invitation Homes Trust, Series 2018-SFR3, Class A(a)	1.11%	07/17/2037	4,548	4,566,051	0.3
SMB Private Education Loan Trust, Series 2020-PTB, Class A2B(a)	0.97%	09/15/2054	4,655	4,621,690	0.4
				<u>9,187,741</u>	<u>0.7</u>
<b>BAUSPARDARLEHEN – FESTVERZINSLICH</b>					
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-WF1, Class A5(a)	5.01%	11/25/2034	0*	277	0.0
				<u>115,341,275</u>	<u>8.6</u>
<b>HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN</b>					
<b>FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT</b>					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2020	2.50%	06/01/2050	10,868	11,301,875	0.8
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2016	4.50%	02/01/2046	4,814	5,376,917	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2017	4.50%	06/01/2047	5,939	6,541,915	0.5
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2018	4.00%	10/01/2048	8,472	9,216,152	0.7
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2018	4.50%	10/01/2048	2,392	2,629,909	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2018	5.00%	09/01/2048	2,509	2,820,562	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2018	5.00%	11/01/2048	1,329	1,493,918	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.50%	10/01/2030	4	4,165	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.50%	06/01/2031	28	32,824	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2003	5.00%	11/01/2033	202	228,657	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2004	8.00%	09/01/2033	479	562,785	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.00%	07/01/2037	217	245,377	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.50%	05/01/2038	261	302,888	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	05/01/2039	115	131,494	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	02/01/2040	656	747,923	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	04/01/2040	822	948,974	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	12/01/2040	966	1,111,914	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2011	5.00%	04/01/2041	421	486,610	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/01/2044	1,125	1,310,337	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2016	4.50%	04/01/2046	4,479	4,998,931	0.4
Federal National Mortgage Association, Series 2017	4.50%	10/01/2047	5,281	5,816,087	0.4
Federal National Mortgage Association, Series 2018	4.50%	09/01/2048	1,936	2,127,958	0.2
Government National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	10/15/2039	210	239,633	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2012	5.50%	06/15/2038	67	76,771	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/20/2041	629	709,670	0.1
Government National Mortgage Association, Series 2021	2.50%	03/01/2051	11,650	12,055,019	0.9
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2021	1.50%	03/01/2051	8,240	8,061,681	0.6
				<u>79,580,946</u>	<u>5.9</u>
<b>FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 15-JÄHRIGER LAUFZEIT</b>					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2011	5.00%	07/01/2025	108	112,327	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2011	6.50%	03/01/2026	8	8,332	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2012	5.00%	06/01/2026	4	3,673	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2014	3.50%	02/01/2029	662	712,279	0.1
				<u>836,611</u>	<u>0.1</u>
				<u>80,417,557</u>	<u>6.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	8.13%	08/15/2021	USD 1,000	\$ 1,035,625	0.1%
				<u>1,170,896,341</u>	<u>86.9</u>
<b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>					
US-SCHATZWECHSEL					
U.S. Treasury Bill	0.00%	03/02/2021	102,585	102,584,928	7.6
U.S. Treasury Bill, Series WI	0.00%	03/16/2021	13,474	13,473,703	1.0
				<u>116,058,631</u>	<u>8.6</u>
				<u>1,286,954,972</u>	<u>95.5</u>
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2017-1, Class B1(a)	4.87%	10/25/2027	1,250	1,274,625	0.1
Series 2020-4A, Class B1(a)	5.12%	06/25/2030	500	510,816	0.0
Eagle Re Ltd., Series 2018-1, Class B1(a)	4.12%	11/25/2028	4,000	3,955,024	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Series 2019-DNA4, Class B2(a)	6.37%	10/25/2049	4,850	4,976,875	0.4
Series 2019-FTR2, Class B2(a)	7.52%	11/25/2048	2,500	2,499,997	0.2
Series 2019-HQA2, Class B2(a)	11.38%	04/25/2049	1,500	1,686,006	0.1
Series 2019-HQA3, Class B2(a)	7.62%	09/25/2049	3,650	3,766,300	0.3
Series 2020-DNA1, Class B2(a)	5.37%	01/25/2050	6,000	5,787,392	0.4
Series 2020-DNA2, Class B2(a)	4.92%	02/25/2050	3,651	3,477,709	0.3
Series 2020-HQA1, Class B2(a)	5.22%	01/25/2050	2,000	1,905,092	0.1
Series 2020-HQA2, Class B2(a)	7.72%	03/25/2050	4,000	4,000,021	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2019-DNA1, Class B2(a)	10.88%	01/25/2049	3,750	4,348,937	0.3
Series 2019-FTR3, Class B2(a)	4.93%	09/25/2047	4,480	4,317,402	0.3
Home Re Ltd., Series 2018-1, Class B1(a)	4.12%	10/25/2028	1,000	992,649	0.1
JP Morgan Madison Avenue Securities Trust					
Series 2014-CH1, Class M2(a)	4.38%	11/25/2024	1,164	1,132,414	0.1
Series 2015-CH1, Class M2(a)	5.62%	10/25/2025	2,671	2,451,195	0.2
PMT Credit Risk Transfer Trust,					
Series 2020-1R, Class A(a)	2.48%	02/27/2023	5,105	5,040,069	0.4
Radnor Re Ltd., Series 2018-1, Class B1(a)	3.93%	03/25/2028	2,000	2,033,254	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust,					
Series 2015-WF1, Class 1M2(a)	5.38%	11/25/2025	1,174	1,153,254	0.1
				<u>55,309,031</u>	<u>4.1</u>
<b>ABS-ANLEIHEN</b>					
<b>SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS</b>					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-20, Class PT	10.27%	11/16/2043	633	624,770	0.1
Series 2018-7, Class PT	9.28%	06/15/2043	194	189,019	0.0
Series 2019-24, Class PT	10.00%	08/15/2044	1,882	1,836,402	0.1
Series 2019-44, Class PT	10.25%	11/15/2044	1,576	1,548,563	0.1
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-12, Class PT	9.59%	06/15/2043	444	434,421	0.0
Series 2018-4, Class PT	10.34%	05/15/2043	168	165,149	0.0
Series 2019-48, Class PT	9.31%	12/15/2044	1,472	1,438,661	0.1
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust,					
Series 2018-3, Class PT	10.55%	03/16/2043	173	168,573	0.0
Neighborly Issuer LLC, Series 2021-1A, Class A2 (e)	3.58%	04/30/2051	5,000	5,000,000	0.4
SoFi Consumer Loan Program LLC					
Series 2016-1, Class R(e)	0.00%	08/25/2025	581	112,153	0.0
Series 2017-5, Class R1(e)	0.00%	09/25/2026	14	306,590	0.0
SoFi Consumer Loan Program Trust,					
Series 2018-1, Class R1 (e)	0.00%	02/25/2027	25	855,065	0.1
				<u>12,679,366</u>	<u>0.9</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>					
<b>NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS</b>					
Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-CR3, Class E	4.75%	10/15/2045	2,173	1,121,305	0.1
Series 2014-UBS2, Class D	4.99%	03/10/2047	1,250	1,242,828	0.1
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(e)	0.00%	03/10/2047	14	270,482	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(e)	4.00%	04/15/2050	226	3,170,354	0.2
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(e)	4.00%	11/15/2047	210	2,927,131	0.2
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(e)	3.40%	10/15/2057	217	3,266,449	0.3
Morgan Stanley Capital I Trust,					
Series 2019-BPR, Class XCP(d)	0.00%	10/15/2020	163,600	1,636	0.0



	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
WF-RBS Commercial Mortgage Trust, Series 2011-C4, Class E .....	5.19%	06/15/2044	USD 713	\$ 432,117	0.0%
				<u>12,432,302</u>	<u>0.9</u>
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Goldentree Loan Management US CLO Ltd., Series 2020-7A, Class A (a) .....	2.12%	04/20/2031	5,000	5,006,445	0.4
<b>STAMMAKTIEN</b>					
Mt Logan Re Ltd.(e) .....			4,000	4,026,928	0.3
<b>SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Virgolino de Oliveira Finance SA(f) .....	10.88%	01/13/2020	1,665	333,000	0.0
				<u>89,787,072</u>	<u>6.6</u>
<b>Gesamtanlagen</b>				\$ 1,376,742,044	102.1%
(Kosten \$1,492,311,477) .....					
<b>Termineinlagen</b>					
BBH, Grand Cayman(g) .....	(0.06)%	–		266	0.0
BBH, Grand Cayman(g) .....	0.07 %	–		19	0.0
BBH, Grand Cayman(g) .....	2.80 %	–		13,114	0.0
DBS Bank Ltd., Singapore(g) .....	0.00 %	–		8,031,763	0.6
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....				<u>8,045,162</u>	<u>0.6</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....				<u>(36,786,895)</u>	<u>(2.7)</u>
<b>Nettovermögen</b> .....				\$ 1,348,000,311	100.0%

**DEVISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 38,072	AUD 49,974	03/05/2021	\$ 380,320
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 8,704	EUR 7,232	03/05/2021	22,499
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 261	GBP 191	03/05/2021	5,251
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 1,003	SGD 1,337	03/05/2021	(623)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 11,335	ZAR 165,177	03/05/2021	(422,713)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 2,389	CNH 15,369	03/12/2021	(18,908)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 2,390	CNH 15,472	03/25/2021	(6,204)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 8,507	EUR 6,999	03/25/2021	(56,787)
				<u>\$ (97,165)</u>
			Wertsteigerung	\$ 408,070
			Wertminderung	\$ (505,235)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

**ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS**

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 25,220	12/02/2030	3 Month LIBOR	0.856%	\$ (1,569,644)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	10,600	12/02/2030	0.856%	3 Month LIBOR	18,840
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	31,240	06/11/2030	3 Month LIBOR	0.786%	(1,934,669)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	7,950	05/27/2030	3 Month LIBOR	0.645%	(587,038)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	75,000	03/31/2025	0.524%	3 Month LIBOR	447,134
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	17,000	03/31/2030	0.691%	3 Month LIBOR	1,106,748
<b>Insgesamt</b>					<u>\$ (2,518,629)</u>
				Wertsteigerung	\$ 1,572,722
				Wertminderung	\$ (4,091,351)



CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Verkaufskontrakte</b>						
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 438	\$ (188,909)	\$ (68,425)	\$ (120,484)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	686	(295,872)	(106,760)	(189,112)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,602	(1,122,243)	(395,561)	(726,682)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,666	(1,149,846)	(318,454)	(831,392)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,000	(494,400)	(246,755)	(247,645)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,000	(741,600)	(326,599)	(415,001)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,000	(431,300)	(118,164)	(313,136)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	804	(198,749)	(64,765)	(133,984)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,000	(494,400)	(274,655)	(219,745)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,500	(618,000)	(140,726)	(477,274)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,500	(618,000)	(155,754)	(462,246)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,097	(473,136)	(208,586)	(264,550)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,131	(487,800)	(211,971)	(275,829)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,166	(502,896)	(223,085)	(279,811)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,773	(764,695)	(337,082)	(427,613)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,000	(862,600)	(424,667)	(437,933)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,000	(1,293,900)	(453,251)	(840,649)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,057	(508,490)	(271,584)	(236,906)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,500	(618,000)	(275,971)	(342,029)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,334	(575,354)	(160,359)	(414,995)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,500	(1,078,250)	(526,857)	(551,393)
Insgesamt				<u>\$ (13,518,440)</u>	<u>\$ (5,310,031)</u>	<u>\$ (8,208,409)</u>
					Wertsteigerung	\$ —
					Wertminderung	\$ (8,208,409)
Swaps insgesamt						<u>\$ (10,727,038)</u>

\* Kapitalbetrag geringer als 500.

- (a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2021.
- (b) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 28. Februar 2021.
- (c) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (d) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (e) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (f) Notleidendes fälliges Wertpapier.
- (g) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- SGD – Singapore Dollar
- USD – United States Dollar
- ZAR – South African Rand

Glossar:

- ABS – Asset-Backed Securities
- CDX-CMBX.NA – North American Commercial Mortgage-Backed Index
- CLO – Collateralized Loan Obligations
- CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities
- CME – Chicago Mercantile Exchange
- LCH – London Clearing House
- LIBOR – London Interbank Offered Rate
- REMICs – Real Estate Mortgage Investment Conduits
- TBA – To Be Announced

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

**ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS**

28. Februar 2021

AB FCPI

	<b>Dynamic Diversified Portfolio (USD)</b>	<b>Global Equity Blend Portfolio (USD)</b>	<b>Global Value Portfolio (USD)</b>
<b>VERMÖGENSWERTE</b>			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert . . . . .	\$ 42,135,703	\$ 112,665,477	\$ 507,176,682
Dividenden- und Zinsforderungen . . . . .	123,406	112,754	709,341
Termineinlagen . . . . .	1,494,482	2,750,003	7,720,162
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel . . . . .	569,656	2,047,543	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps . . . . .	214,391	-0-	-0-
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital . . . . .	678	20,747	12,997,071
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren . . . . .	539,731	-0-	-0-
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren . . . . .	775	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften . . . . .	187,849	277,780	843,849
Zinsforderungen aus Swaps . . . . .	3,139	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten . . . . .	65,738	-0-	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe . . . . .	-0-	1,084	9,561
Sonstige Forderungen . . . . .	-0-	-0-	-0-
	<u>45,335,548</u>	<u>117,875,388</u>	<u>529,456,666</u>
<b>VERBINDLICHKEITEN</b>			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere . . . . .	1,691,019	48,191	12,734
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar . . . . .	88,396	7,413	735,799
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps . . . . .	35,897	-0-	-0-
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren . . . . .	-0-	-0-	-0-
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital . . . . .	8,237	156,702	1,522,147
Zu zahlende Dividenden . . . . .	-0-	-0-	340,122
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften . . . . .	69,818	196,479	1,148,298
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten . . . . .	125,539	-0-	-0-
Verkaufte Optionen, zum Marktwert . . . . .	-0-	-0-	-0-
Zinsaufwand für Swaps . . . . .	1,094	-0-	-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten . . . . .	128,415	272,120	567,932
	<u>2,148,415</u>	<u>680,905</u>	<u>4,327,032</u>
<b>NETTOVERMÖGEN</b> . . . . .	<u>\$ 43,187,133</u>	<u>\$ 117,194,483</u>	<u>\$ 525,129,634</u>

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

Emerging Markets Growth Portfolio (USD)	Sustainable US Thematic Portfolio (USD)	Asia Ex-Japan Equity Portfolio (USD)	Japan Strategic Value Portfolio (JPY)	China Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Short Duration Bond Portfolio (USD)	Global High Yield Portfolio (USD)	American Income Portfolio (USD)
\$ 888,231,335	\$ 568,376,859	\$ 385,945,221	¥ 8,001,837,512	\$ 144,726,001	\$ 528,232,841	\$ 20,832,944,289	\$ 27,644,311,036
1,640,738	322,909	1,845,314	14,692,516	-0-	5,260,960	331,625,127	287,352,867
13,016,574	25,460,933	5,107,289	114,925,720	6,924,216	2,681,588	292,725,544	202,305,375
3,912,541	-0-	-0-	939,918	55,147	5,246,461	225,652,435	189,916,020
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	23,695	205,010,387	112,558,194
2,739,521	5,802,718	3,271,214	1,686,094	1,339,061	2,626,907	112,571,324	144,917,034
5,663,317	-0-	111,474	474,881,379	-0-	771,948	13,179,828	252,459,498
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	169,199,044	83,809,824
38,352	103,253	609,935	29,259,178	195,073	3,771,020	80,702,399	3,435,310
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	164,261	43,543,696	23,316,808
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	594,134	-0-	7,208,662
29,598	-0-	713	4,913	141	-0-	-0-	-0-
235	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	15,445	-0-
<u>915,272,211</u>	<u>600,066,672</u>	<u>396,891,160</u>	<u>8,638,227,230</u>	<u>153,239,639</u>	<u>549,373,815</u>	<u>22,307,169,518</u>	<u>28,951,590,628</u>
17,359,216	-0-	498,475	84,043,770	-0-	7,785	76,899,658	764,322,609
-0-	2,454,111	742,612	-0-	-0-	2,676,551	429,917,943	206,984,072
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	584,682	247,795,988	366,991,791
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	291,661,647	209,493,402
3,079,280	953,593	4,109,231	319,801,303	471,986	6,103,461	68,428,543	200,024,157
16,527	-0-	477,566	7,524,869	140,881	544,512	112,377,617	90,070,678
1,910	1,905	240,771	876,551	116,050	1,386,893	91,604,924	42,725,382
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	217,542	16,907,000	25,785,250
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	143,119	284,379	5,214,619
<u>1,343,518</u>	<u>578,293</u>	<u>3,030,710</u>	<u>14,496,071</u>	<u>297,841</u>	<u>644,261</u>	<u>28,737,022</u>	<u>29,210,317</u>
<u>21,800,451</u>	<u>3,987,902</u>	<u>9,099,365</u>	<u>426,742,564</u>	<u>1,026,758</u>	<u>12,308,806</u>	<u>1,364,614,721</u>	<u>1,940,822,277</u>
<u>\$ 893,471,760</u>	<u>\$ 596,078,770</u>	<u>\$ 387,791,795</u>	<u>¥ 8,211,484,666</u>	<u>\$ 152,212,881</u>	<u>\$ 537,065,009</u>	<u>\$ 20,942,554,797</u>	<u>\$ 27,010,768,351</u>

**ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS (Fortsetzung)**

28. Februar 2021

AB FCPI

	European Income Portfolio (EUR)	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)	Mortgage Income Portfolio (USD)
<b>VERMÖGENSWERTE</b>			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert .....	€ 2,092,623,034	\$ 879,963,524	\$ 1,376,742,044
Divиденден- und Zinsforderungen .....	39,287,755	11,601,515	5,367,093
Termineinlagen .....	7,999,212	5,735,494	8,045,162
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel .....	31,472,814	4,869,849	21,328,154
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps .....	776,043	517,260	1,572,722
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital .....	5,969,616	3,534,545	15,055,082
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren .....	6,706,407	14,327,803	5,940,655
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren .....	-0-	190,996	640,884
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften .....	6,813,037	2,662,433	408,070
Zinsforderungen aus Swaps .....	-0-	4,884	220,513
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten .....	1,943,105	-0-	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe .....	-0-	-0-	-0-
Sonstige Forderungen .....	-0-	-0-	98,452
	<u>2,193,591,023</u>	<u>923,408,303</u>	<u>1,435,418,831</u>
<b>VERBINDLICHKEITEN</b>			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere .....	1,661,337	6,685,164	55,736,616
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar .....	1,811,662	518,854	1,582,359
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps .....	-0-	199,735	12,299,760
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren .....	10,743,757	196,712	5,310,031
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital .....	15,416,324	3,155,511	6,058,225
Zu zahlende Dividenden .....	6,787,334	3,312,542	4,290,135
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften .....	9,193,189	3,025,288	505,235
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten .....	11,765,860	503,758	-0-
Verkaufte Optionen, zum Marktwert .....	25,621,848	1,172,893	-0-
Zinsaufwand für Swaps .....	930,572	12,163	270,843
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten .....	4,213,976	1,202,840	1,365,316
	<u>88,145,859</u>	<u>19,985,460</u>	<u>87,418,520</u>
<b>NETTOVERMÖGEN</b> .....	<u>€ 2,105,445,164</u>	<u>\$ 903,422,843</u>	<u>\$ 1,348,000,311</u>

\* Die Anlagetätigkeit innerhalb des Global High Yield Portfolios in Bezug auf dessen Anlage in das Mortgage Income Portfolio und die Anlagetätigkeit innerhalb des American Income Portfolios in Bezug auf dessen Anlage in das Mortgage Income Portfolio und das Emerging Markets Debt Portfolio wurden im Rahmen des konsolidierten Abschlusses zu Darstellungszwecken nicht berücksichtigt.

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

**Kombiniert  
(USD)**

\$ 56,255,005,373*
692,090,071*
584,774,272
493,063,351
320,915,794
312,097,078
305,770,852
253,844,890
101,820,198
67,278,353
10,250,155
41,143
114,132
<u>59,397,065,662*</u>
928,490,106
647,988,585
627,970,791
519,647,042
315,684,708
218,298,397*
152,163,759
57,912,063
32,098,464
7,065,036
72,602,169
<u>3,579,921,120*</u>
<u>\$ 55,817,144,542*</u>



**ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS**

Für den Zeitraum zum 28. Februar 2021

AB FCPI

	Dynamic Diversified Portfolio (USD)	Global Equity Blend Portfolio (USD)	Global Value Portfolio (USD)
<b>ANLAGEERTRÄGE</b>			
Zinsen . . . . .	\$ 612,197	\$ -0-	\$ -0-
Swap-Erträge . . . . .	10,773	-0-	-0-
Dividenden, netto . . . . .	137,096	519,482	3,308,146
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto . . . . .	-0-	2,396	18,564
	<u>760,066</u>	<u>521,878</u>	<u>3,326,710</u>
<b>AUFWENDUNGEN</b>			
Verwaltungsgebühr . . . . .	263,818	411,634	1,643,818
Aufwendungen für Swaps . . . . .	8,680	-0-	-0-
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft . . . . .	20,649	15,803	96,252
Transferstelle . . . . .	-0-	12,414	83,680
Steuern . . . . .	10,313	10,298	58,933
Vertriebsgebühr . . . . .	32,998	16,277	16,751
Depotbankgebühren . . . . .	77,906	-0-	-0-
Gebühr für professionelle Dienstleistungen . . . . .	35,686	22,019	41,558
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr . . . . .	16,455	20,061	42,032
Druckkosten . . . . .	512	454	1,933
Sonstige Aufwendungen . . . . .	25,637	14,682	19,225
	<u>492,654</u>	<u>523,642</u>	<u>2,004,182</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen . . . . .	(96,473)	(13,013)	-0-
Nettoaufwendungen . . . . .	396,181	510,629	2,004,182
Netto-Anlageertrag/(-verlust) . . . . .	<u>363,885</u>	<u>11,249</u>	<u>1,322,528</u>
<b>REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)</b>			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen . . . . .	1,994,891	19,510,905	12,023,565
Kapitalertragsteuer . . . . .	(15)	(143,007)	(67,956)
<b>ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)</b>			
Aus Anlagen . . . . .	839,893	(1,777,738)	58,570,732
Aus Finanzterminkontrakten . . . . .	26,523	-0-	-0-
Aus Devisentermingeschäften . . . . .	337,834	573,679	301,887
Aus Swaps . . . . .	(260,917)	-0-	-0-
Aus verkauften Optionen . . . . .	(1,260)	-0-	-0-
Ergebnis der Geschäftstätigkeit . . . . .	<u>3,300,834</u>	<u>18,175,088</u>	<u>72,150,756</u>
<b>EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN</b>			
Steigerung/(Minderung) . . . . .	(2,425,855)	(7,419,591)	88,760,000
Ausschüttungen . . . . .	-0-	-0-	(1,869,231)
<b>NETTOVERMÖGEN</b>			
Beginn des Berichtszeitraums . . . . .	42,312,154	106,438,986	366,088,109
Anpassung aus Währungsumrechnung . . . . .	-0-	-0-	-0-
Ende des Berichtszeitraums . . . . .	<u>\$ 43,187,133</u>	<u>\$ 117,194,483</u>	<u>\$ 525,129,634</u>

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

Emerging Markets Growth Portfolio (USD)	Sustainable US Thematic Portfolio (USD)	Asia Ex-Japan Equity Portfolio (USD)	Japan Strategic Value Portfolio (JPY)	China Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Short Duration Bond Portfolio (USD)	Global High Yield Portfolio (USD)	American Income Portfolio (USD)
\$ 2,082	\$ 1,138	\$ 1,943	¥ -0-	\$ 1,285	\$ 9,199,328	\$ 702,529,385	\$ 749,082,776
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	519,081	134,984,929	92,830,894
5,631,106	863,285	3,631,634	85,352,581	385,914	-0-	24,616,234	10,819,160
111,288	-0-	2,823	290,348	2,359	-0-	-0-	-0-
5,744,476	864,423	3,636,400	85,642,929	389,558	9,718,409	862,130,548	852,732,830
6,243,168	1,844,355	1,808,560	32,854,268	925,224	1,992,650	129,939,648	137,936,735
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	470,360	13,630,244	12,141,596
372,286	75,138	47,832	1,054,020	23,930	253,259	8,715,886	12,512,872
198,085	90,491	92,640	2,410,543	58,022	165,553	4,705,031	5,613,127
190,108	86,272	50,141	947,328	23,882	124,170	4,421,974	6,255,733
39,398	15,851	60,068	142,731	25,677	5,957	5,364,612	3,608,563
38,634	-0-	64,852	4,296,548	644	18,848	797,680	612,008
48,819	34,128	98,754	9,060,570	41,675	58,615	106,415	288,878
61,834	42,480	36,953	356,238	23,731	48,536	203,504	203,504
4,869	2,250	7,893	60,635	765	1,928	14,876	59,507
136,410	10,630	32,999	2,175,663	28,542	12,365	294,333	360,416
7,333,611	2,201,595	2,300,692	53,358,544	1,152,092	3,152,241	168,194,203	179,592,939
-0-	-0-	(5,227)	(6,501,047)	(23,624)	(6,466)	-0-	(93)
7,333,611	2,201,595	2,295,465	46,857,497	1,128,468	3,145,775	168,194,203	179,592,846
(1,589,135)	(1,337,172)	1,340,935	38,785,432	(738,910)	6,572,634	693,936,345	673,139,984
92,503,870	16,542,845	33,249,121	247,456,768	22,531,796	(4,628,524)	203,679,775	441,388,274
(190)	-0-	(2,370,280)	-0-	-0-	-0-	(139,138)	-0-
84,296,313	28,146,489	62,914,786	1,008,156,888	(2,273,631)	(9,748,360)	760,810,560	(319,069,030)
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	560,807	(16,493,570)	(9,874,964)
(32,970)	21,288	(781,401)	10,923,835	(365,997)	8,743,506	(104,243,697)	(114,108,196)
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	(14,667)	75,178,060	93,379,847
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
175,177,888	43,373,450	94,353,161	1,305,322,923	19,153,258	1,485,396	1,612,728,335	764,855,915
(64,743,262)	258,146,669	(3,584,547)	(1,729,816,363)	(12,342,619)	(31,742,830)	(279,014,034)	(1,395,992,333)
(61,275)	-0-	(2,823,428)	(46,817,902)	(808,956)	(3,638,254)	(671,518,009)	(555,480,698)
783,098,409	294,558,651	299,846,609	8,682,796,008	146,211,198	570,960,697	20,280,358,505	28,197,385,467
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
\$ 893,471,760	\$ 596,078,770	\$ 387,791,795	¥ 8,211,484,666	\$ 152,212,881	\$ 537,065,009	\$ 20,942,554,797	\$ 27,010,768,351

# ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS

(Fortsetzung)

Für den Zeitraum zum 28. Februar 2021

AB FCPI

	European Income Portfolio (EUR)	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)	Mortgage Income Portfolio (USD)
<b>ANLAGEERTRÄGE</b>			
Zinsen . . . . .	€ 52,370,987	\$ 26,389,421	\$ 43,129,389
Swap-Erträge . . . . .	90,426	32,565	1,289,628
Dividenden, netto . . . . .	-0-	-0-	-0-
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto . . . . .	-0-	-0-	-0-
	<u>52,461,413</u>	<u>26,421,986</u>	<u>44,419,017</u>
<b>AUFWENDUNGEN</b>			
Verwaltungsgebühr . . . . .	11,305,949	3,799,358	4,839,527
Aufwendungen für Swaps . . . . .	149,884	23,422	330,050
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft . . . . .	1,074,577	178,242	232,221
Transferstelle . . . . .	540,735	269,293	318,514
Steuern . . . . .	514,279	176,797	234,673
Vertriebsgebühr . . . . .	73,401	81,357	5,385
Depotbankgebühren . . . . .	465,776	123,341	95,119
Gebühr für professionelle Dienstleistungen . . . . .	140,322	109,130	136,601
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr . . . . .	71,067	65,208	88,113
Druckkosten . . . . .	13,847	7,861	6,422
Sonstige Aufwendungen . . . . .	111,913	41,948	50,023
	<u>14,461,750</u>	<u>4,875,957</u>	<u>6,336,648</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen . . . . .	-0-	-0-	(1,652)
Nettoaufwendungen . . . . .	<u>14,461,750</u>	<u>4,875,957</u>	<u>6,334,996</u>
Netto-Anlageertrag/(-verlust) . . . . .	<u>37,999,663</u>	<u>21,546,029</u>	<u>38,084,021</u>
<b>REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)</b>			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen . . . . .	(28,169,298)	29,210,016	(3,592,379)
Kapitalertragsteuer . . . . .	-0-	-0-	-0-
<b>ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)</b>			
Aus Anlagen . . . . .	95,157,653	(16,417,990)	45,585,852
Aus Finanzterminkontrakten . . . . .	(17,174,595)	(503,758)	-0-
Aus Devisentermingeschäften . . . . .	7,982,957	(5,378,814)	(1,186,817)
Aus Swaps . . . . .	776,043	211,519	1,936,930
Aus verkauften Optionen . . . . .	<u>(26,052,744)</u>	<u>(69,060)</u>	<u>-0-</u>
Ergebnis der Geschäftstätigkeit . . . . .	<u>70,519,679</u>	<u>28,597,942</u>	<u>80,827,607</u>
<b>EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN</b>			
(Minderung) . . . . .	(347,951,422)	(49,135,858)	(28,900,072)
Ausschüttungen . . . . .	(43,552,810)	(17,752,053)	(26,516,843)
<b>NETTOVERMÖGEN</b>			
Beginn des Berichtszeitraums . . . . .	2,426,429,717	941,712,812	1,322,589,619
Anpassung aus Währungsumrechnung . . . . .	-0-	-0-	-0-
Ende des Berichtszeitraums . . . . .	<u>€ 2,105,445,164</u>	<u>\$ 903,422,843</u>	<u>\$ 1,348,000,311</u>

\* Die Anlagetätigkeit innerhalb des Global High Yield Portfolios in Bezug auf dessen Anlage in das Mortgage Income Portfolio und die Anlagetätigkeit innerhalb des American Income Portfolios in Bezug auf dessen Anlage in das Mortgage Income Portfolio und das Emerging Markets Debt Portfolio wurden im Rahmen des konsolidierten Abschlusses zu Darstellungszwecken nicht berücksichtigt.

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

<b>Kombiniert (USD)</b>
\$ 1,593,907,347
229,833,145
41,258,172*
140,217
1,865,138,881*
305,534,374
26,813,360
23,841,668
12,278,028
12,268,828
9,362,133
2,428,669
1,284,419
950,001
126,482
1,182,853
396,070,815
(208,958)
395,861,857
1,469,277,024*
832,821,179
(2,720,586)
810,388,359*
(47,003,225)
(206,222,581)
171,340,156
(31,258,060)
2,996,622,266*
(1,971,224,814)*
(1,323,802,378)*
56,084,905,580
30,643,888
\$ 55,817,144,542*

	Dynamic Diversified Portfolio	Global Equity Blend Portfolio	Global Value Portfolio
<b>KLASSE</b>			
A .....	160,753	476,061	5,361,180
A EUR H .....	38,131	234,786	-0-
A SGD H .....	-0-	-0-	417,611
AD .....	-0-	-0-	1,240,162
AD AUD H .....	-0-	-0-	2,099,545
AD CAD H .....	-0-	-0-	500,207
AD EUR H .....	-0-	-0-	60,988
AD GBP H .....	-0-	-0-	155,585
AD SGD H .....	-0-	-0-	1,062
AD ZAR H .....	-0-	-0-	633,672
AX .....	608,499	-0-	-0-
B .....	-0-	38,756	19,714
BD .....	-0-	-0-	42,580
BD AUD H .....	-0-	-0-	8,434
BD EUR H .....	-0-	-0-	1,917
BD ZAR H .....	-0-	-0-	18,963
BX .....	54,710	-0-	-0-
C .....	114,567	131,666	177,912
C EUR H .....	501	-0-	-0-
CX .....	62,387	-0-	-0-
I .....	568,662	66,507	1,344,273
I EUR H .....	160,495	-0-	-0-
IX .....	1,609	-0-	-0-
S .....	-0-	682,561	3,649,178
S GBP H .....	-0-	-0-	676,856
S1 .....	-0-	2,129,557	7,332,447
S1 EUR H .....	476	-0-	-0-
SD .....	-0-	-0-	358,369

KLASSE	Emerging Markets Growth Portfolio	Sustainable US Thematic Portfolio	Asia Ex-Japan Equity Portfolio
A .....	11,023,161	2,435,787	1,036,750
A AUD H .....	235,920	4,001	310,350
A CAD H .....	-0-	91,793	-0-
A EUR H .....	-0-	147,800	-0-
A GBP H .....	-0-	8,302	-0-
A PLN H .....	16,187	-0-	-0-
A SGD H .....	2,373	56,900	3,469
AD .....	3,157	-0-	2,668,519
AD AUD H .....	-0-	-0-	2,733,846
AD CAD H .....	-0-	-0-	580,446
AD EUR H .....	-0-	-0-	30,747
AD GBP H .....	-0-	-0-	192,460
AD NZD H .....	-0-	-0-	466,248
AD RMB H .....	-0-	-0-	965
AD SGD H .....	-0-	-0-	1,149
AD ZAR H .....	-0-	-0-	2,413,255
AN .....	-0-	667	-0-
AY JPY .....	-0-	-0-	140,579,380
B .....	21,979	58,893	-0-
BD .....	-0-	-0-	79,090
BD AUD H .....	-0-	-0-	42,415
BD CAD H .....	-0-	-0-	10,478
BD GBP H .....	-0-	-0-	207
BD NZD H .....	-0-	-0-	2,956
BD ZAR H .....	-0-	-0-	4,773
BY JPY .....	-0-	-0-	552,275,001
C .....	248,365	431,659	3,309
C AUD H .....	1,495	-0-	761
C EUR H .....	-0-	535	-0-
ED .....	660,402	-0-	451,223
I .....	1,639,107	6,533,942	432,988
I AUD H .....	2,465	-0-	761
I EUR H .....	-0-	56,115	-0-
I GBP .....	-0-	533	382
ID .....	-0-	-0-	1,036
ID AUD H .....	-0-	-0-	1,451
IN .....	-0-	667	-0-
N .....	16,987	-0-	-0-
S .....	255	176,950	1,169,272
S1 .....	1,280,095	3,478,288	4,395,764
S1 JPY H .....	-0-	7,500	-0-
SD .....	-0-	-0-	234,470



# UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

28. Februar 2021

AB FCPI

KLASSE	Japan Strategic Value Portfolio	China Low Volatility Equity Portfolio	Short Duration Bond Portfolio
A	89,510	599,262	2,215,532
A AUD H	667	-0-	-0-
A CZK H	530	-0-	-0-
A EUR H	14,046	-0-	-0-
A NZD H	833	-0-	-0-
A PLN H	-0-	10,114	-0-
A SGD H	8,304	-0-	-0-
A USD H	216,395	-0-	-0-
A2	-0-	-0-	9,303,917
A2 EUR H	-0-	-0-	5,077
A2 SGD H	-0-	-0-	833
AA	-0-	-0-	1,829,975
AA AUD H	-0-	-0-	1,550,987
AA CAD H	-0-	-0-	813,369
AA GBP H	-0-	-0-	628,102
AA NZD H	-0-	-0-	1,077
AA SGD H	-0-	-0-	131,009
AD	13,930	662,406	-0-
AD AUD H	386,503	711,337	-0-
AD CAD H	-0-	31,936	-0-
AD EUR H	-0-	10,984	-0-
AD GBP H	-0-	47,150	-0-
AD NZD H	43,385	39,928	-0-
AD RMB H	-0-	896	-0-
AD SGD H	-0-	1,679	-0-
AD USD H	78,270	-0-	-0-
AD ZAR H	57,696	1,204,672	-0-
AJ	-0-	-0-	4,649,001
AR EUR H	-0-	-0-	679
AT	-0-	-0-	9,837,023
AT AUD H	-0-	-0-	503,077
AT CAD H	-0-	-0-	57,937
AT EUR H	-0-	-0-	14,652
AT GBP H	-0-	-0-	72,126
AT NZD H	-0-	-0-	67,501
AT SGD H	-0-	-0-	25,479
AX	-0-	-0-	16,587
B	297	30,385	10,069
B2	-0-	-0-	9,937
BA	-0-	-0-	1,166
BD	75	10,924	-0-
BD AUD H	2,640	19,928	-0-
BD EUR H	-0-	1,177	-0-
BD NZD H	-0-	1,248	-0-
BD USD H	11,076	-0-	-0-
BD ZAR H	806	5,046	-0-
BT	-0-	-0-	23,804
BT AUD H	-0-	-0-	15,725
BT GBP H	-0-	-0-	336
C	1,934	12,632	484,192
C EUR H	521	-0-	-0-
C2	-0-	-0-	913,360
C2 EUR H	-0-	-0-	457
I	40,914	5,792	2,034,578
I EUR H	367	-0-	-0-
I USD H	16,576	-0-	-0-
I2	-0-	-0-	4,765,116
I2 AUD H	-0-	-0-	1,468

	Japan Strategic Value Portfolio	China Low Volatility Equity Portfolio	Short Duration Bond Portfolio
<b>KLASSE</b>			
I2 EUR H	-0-	-0-	116,093
IT	-0-	-0-	339,073
IT AUD H	-0-	-0-	911
N2	-0-	-0-	271,961
NT	-0-	-0-	264,229
S	-0-	75,583	265,135
S EUR H	421	-0-	1,041
S SGD H	-0-	-0-	833
S1	253,473	538,750	-0-
S1 2	-0-	-0-	2,404,797
S1 EUR H	-0-	-0-	1,041
S1 USD H	482	-0-	-0-
SA	-0-	-0-	118
SD	132,497	-0-	-0-
	Global High Yield Portfolio	American Income Portfolio	European Income Portfolio
<b>KLASSE</b>			
A	146,003,754	184,304,072	3,636,179
A2	56,473,539	76,643,043	4,054,684
A2 CHF H	16,059	330,292	9,145
A2 DUR PH	-0-	5,160	-0-
A2 EUR H	4,039,335	4,256,229	-0-
A2 PLN H	11,580	1,090,395	380
A2 SGD H	788,929	1,092,302	933
A2 USD H	-0-	-0-	605,490
AA	285,919,462	170,231,485	2,995,847
AA AUD H	172,525,535	46,914,850	14,071,040
AA CAD H	1,051,074	7,942,079	-0-
AA DUR PH	-0-	1,807,500	-0-
AA EUR H	1,487,084	1,893,219	-0-
AA GBP H	4,749,500	10,024,374	-0-
AA HKD H	-0-	-0-	8,556,274
AA NZD H	2,131,577	5,521,863	-0-
AA RMB H	2,663,101	10,251,863	513,424
AA SGD H	130,751	1,607,013	393,977
AA USD H	-0-	-0-	72,870,731
AA ZAR H	272,309,931	27,381,698	-0-
AK	139,484	124,861	148,661
AK EUR H	4,070	94,107	-0-
AR	-0-	-0-	1,341,803
AR EUR	-0-	8,354	-0-
AR EUR H	60,613	16,826	-0-
AT	1,692,201,975	1,242,260,984	18,537,061
AT AUD H	98,818,092	108,101,607	6,562,459
AT CAD H	8,909,486	30,502,966	-0-
AT DUR PH	-0-	63,585	-0-
AT EUR H	6,375,123	8,080,887	-0-
AT GBP H	3,836,849	18,273,291	-0-
AT NZD H	13,138,803	12,921,332	-0-
AT RMB H	3,810,616	6,112,751	-0-
AT SGD H	23,678,897	39,050,434	1,250,420
AT USD H	-0-	-0-	25,339,483
B	834,087	940,954	146,532
B2	30,261	129,235	6,636
B2 EUR H	261	-0-	-0-

# UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

28. Februar 2021

AB FCPI

KLASSE	Global High Yield Portfolio	American Income Portfolio	European Income Portfolio
BA .....	133,536	1,028,001	60,309
BA AUD H .....	110,333	647,900	668,843
BA USD H .....	-0-	-0-	524,419
BA ZAR H .....	64,075	285,970	-0-
BT .....	2,779,605	6,735,439	112,104
BT AUD H .....	225,334	1,210,214	101,259
BT CAD H .....	25,416	213,921	-0-
BT EUR H .....	11,681	59,243	-0-
BT GBP H .....	35,362	208,497	-0-
BT NZD H .....	24,409	318,773	-0-
BT USD H .....	-0-	-0-	191,833
C .....	21,310,922	30,682,916	2,602,576
C2 .....	2,129,619	7,532,242	95,140
C2 DUR PH .....	-0-	8,251	-0-
C2 EUR H .....	11,280	11,978	-0-
C2 USD H .....	-0-	-0-	171,453
CK .....	997	-0-	6,561
CK EUR H .....	681	-0-	-0-
CT .....	19,311	149,541	-0-
CT USD H .....	-0-	-0-	39,608
EA .....	154,022,073	34,128,012	-0-
EA AUD H .....	8,406,654	4,308,980	-0-
EA ZAR H .....	19,715,560	5,525,475	-0-
I .....	27,928,039	51,567,773	2,412,889
I2 .....	12,330,804	58,631,669	11,959,162
I2 AUD H .....	4,448	3,343,842	5,569
I2 CHF H .....	29,648	603,675	633
I2 DUR PH .....	-0-	1,900	-0-
I2 EUR H .....	1,725,391	2,273,081	-0-
I2 SGD H .....	28,547	347,752	-0-
I2 USD H .....	-0-	-0-	416,034
IA .....	-0-	113,804	84,439
IA AUD H .....	1,972,917	3,830,214	-0-
IA HKD H .....	-0-	-0-	11,582
IA SGD H .....	-0-	-0-	1,316
IA USD H .....	-0-	-0-	19,010
IQD .....	110,735	-0-	-0-
IT .....	5,092,375	33,853,385	811,607
IT AUD H .....	621,671	387,577	-0-
IT CAD H .....	173,826	602,448	-0-
IT EUR H .....	118,378	523,535	-0-
IT GBP H .....	190,064	541,140	-0-
IT JPY .....	-0-	268,853	-0-
IT JPY H .....	-0-	222,310	-0-
IT NZD H .....	5,450	78,205	-0-
IT RMB H .....	10,359	3,902	-0-
IT SGD H .....	-0-	3,473,541	1,260
IT USD H .....	-0-	-0-	576,174
J .....	5,347,544	64,592,056	-0-
L2 .....	-0-	3,333	-0-
L2 AUD H .....	-0-	5,000	-0-
L2 SGD H .....	-0-	4,667	-0-
LT .....	-0-	3,579	-0-
LT AUD H .....	-0-	5,305	-0-
LT SGD H .....	-0-	4,951	-0-
N2 .....	856,073	5,049,910	-0-
NT .....	1,342,847	3,969,535	-0-
NT USD H .....	-0-	-0-	97,868
S .....	-0-	1,495,188	6,331

	Global High Yield Portfolio	American Income Portfolio	European Income Portfolio
<b>KLASSE</b>			
S EUR H .....	2,288	-0-	-0-
S1 .....	36,875,558	66,256,341	250,490
S1 USD H .....	-0-	-0-	3,986,969
S1D .....	47,987,274	25,863,839	1,485,607
S1D2 .....	-0-	449,240	-0-
SA .....	1,092,592	2,489,674	-0-
SA USD H .....	-0-	-0-	145,132
SHK .....	224,847	2,647,092	163,640
SK .....	21,585,886	-0-	-0-
SQ .....	61,300	-0-	-0-
W .....	68,576	935,860	-0-
W2 .....	230,614	4,829,340	1,039,593
W2 CHF H .....	7,008	344,440	192,656
W2 EUR H .....	4,499	192,432	-0-
W2 USD H .....	-0-	-0-	5,612
WA .....	-0-	-0-	375,486
WA HKD H .....	-0-	-0-	869
WA USD H .....	-0-	-0-	166,392
WT .....	121,060	6,078,176	181,066
WT AUD H .....	106,004	1,971,350	-0-
WT CAD H .....	37,373	-0-	-0-
WT EUR H .....	214,680	215,235	-0-
WT GBP H .....	26,718	30,957	-0-
WT RMB H .....	126,321	-0-	-0-
WT SGD H .....	-0-	530,650	12,135
WT USD H .....	-0-	-0-	317,130

	Emerging Markets Debt Portfolio	Mortgage Income Portfolio
<b>KLASSE</b>		
A .....	1,297,474	10,186,101
A2 .....	815,114	8,011,783
A2 CHF H .....	600	-0-
A2 EUR H .....	79,943	-0-
A2 PLN H .....	182,888	-0-
A2 SGD H .....	252,515	-0-
A2X .....	-0-	521,641
AA .....	5,950,890	15,699,445
AA AUD H .....	4,068,488	3,838,113
AA CAD H .....	6,268	-0-
AA EUR H .....	3,371	-0-
AA GBP H .....	15,932	-0-
AA NZD H .....	34,025	-0-
AA RMB H .....	1,071	401,492
AA SGD H .....	1,292	48,031
AA ZAR H .....	10,234,046	2,202,147
AR EUR .....	1,250	-0-
AR EUR H .....	-0-	34,639
AT .....	12,056,883	3,469,938
AT AUD H .....	6,661,710	692,316
AT CAD H .....	154,095	-0-
AT EUR H .....	327,343	-0-
AT GBP H .....	99,227	14,637
AT NZD H .....	522,233	-0-
AT RMB H .....	16,684	-0-
AT SGD H .....	365,612	65,773
AX .....	-0-	538,419

# UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

28. Februar 2021

AB FCPI

KLASSE	Emerging Markets Debt Portfolio	Mortgage Income Portfolio
B2	14,208	-0-
B2X	-0-	11,666
BA	31,330	1,110
BA AUD H	15,678	5,885
BA ZAR H	11,851	2,396
BT	146,018	-0-
BT AUD H	47,279	-0-
BT CAD H	9,461	-0-
BT EUR H	695	-0-
BT GBP H	1,948	-0-
BT NZD H	20,809	-0-
BX	-0-	60,118
C	276,422	2,433,826
C2	118,430	1,789,644
C2 EUR H	1,022	-0-
C2X	-0-	3,920
CT	999	-0-
CX	-0-	14,954
EA	1,215,920	-0-
EA AUD H	273,850	-0-
EA ZAR H	484,329	-0-
I	720,384	3,938,591
I2	335,216	8,014,683
I2 CHF H	600	-0-
I2 EUR H	3,646,961	767,396
I2X	-0-	1,092
IT	24,159	-0-
IT AUD H	1,720	-0-
IT EUR H	1,333,333	1,807
IT SGD H	1,286	-0-
IX	-0-	92,068
N2	33,345	455,636
NT	50,774	1,054,397
S	203,102	1,714,847
S EUR H	521	-0-
S GBP H	431	-0-
S1	-0-	13,069,417
S1 2	3,548,526	-0-
S1 EUR H	521	26,404
S1 GBP H	431	-0-
S1 JPY	-0-	1,178
S1QD EUR H	440,173	-0-
S1X	-0-	2,157
SA	748,581	3,067,616

	Dynamic Diversified Portfolio		
	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	\$ 43,187,133	\$ 42,312,154	\$ 49,287,869
Klasse			
A .....	\$ 22.00	\$ 20.37	\$ 19.46
A EUR H .....	€ 19.35	€ 18.04	€ 17.71
AX .....	\$ 26.51	\$ 24.54	\$ 23.43
B (1) .....	N/A	\$ 18.54	\$ 17.89
BX .....	\$ 22.54	\$ 20.98	\$ 20.22
C .....	\$ 21.47	\$ 19.91	\$ 19.07
C EUR H .....	€ 18.90	€ 17.65	€ 17.37
CX .....	\$ 25.37	\$ 23.53	\$ 22.52
I .....	\$ 23.39	\$ 21.59	\$ 20.47
I EUR H .....	€ 20.58	€ 19.12	€ 18.63
IX .....	\$ 29.45	\$ 27.18	\$ 25.76
S1 EUR H .....	€ 21.69	€ 20.11	€ 19.52
A – EUR * .....	€ 18.23	€ 17.07	€ 17.71
AX – EUR * .....	€ 21.96	€ 20.57	€ 21.32
B – EUR * .....	N/A	€ 15.54	€ 16.28
BX – EUR * .....	€ 18.67	€ 17.58	€ 18.40
C – EUR * .....	€ 17.79	€ 16.69	€ 17.35
CX – EUR * .....	€ 21.02	€ 19.72	€ 20.49
I – EUR * .....	€ 19.38	€ 18.10	€ 18.62
IX – EUR * .....	€ 24.40	€ 22.78	€ 23.44

	Global Equity Blend Portfolio		
	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	\$ 117,194,483	\$ 106,438,986	\$ 105,961,928
Klasse			
A .....	\$ 25.61	\$ 21.89	\$ 18.83
A EUR H .....	€ 23.12	€ 19.91	€ 17.69
B .....	\$ 21.50	\$ 18.47	\$ 16.04
C .....	\$ 23.92	\$ 20.49	\$ 17.71
I .....	\$ 29.54	\$ 25.15	\$ 21.46
S .....	\$ 35.61	\$ 30.16	\$ 25.43
S1 .....	\$ 32.03	\$ 27.22	\$ 23.11
A – EUR * .....	€ 21.22	€ 18.35	€ 17.13
B – EUR * .....	€ 17.81	€ 15.48	€ 14.59
C – EUR * .....	€ 19.82	€ 17.17	€ 16.11
I – EUR * .....	€ 24.47	€ 21.08	€ 19.53
S – EUR * .....	€ 29.50	€ 25.28	€ 23.14
S1 – EUR * .....	€ 26.54	€ 22.81	€ 21.03



	Global Value Portfolio		
	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	\$ 525,129,634	\$ 366,088,109	\$ 322,476,894
Klasse			
A .....	\$ 19.39	\$ 16.51	\$ 15.98
A SGD H .....	SGD 19.61	SGD 16.74	SGD 16.45
AD .....	\$ 15.02	\$ 13.04	\$ 13.21
AD AUD H .....	AUD 13.88	AUD 12.18	AUD 12.93
AD CAD H .....	CAD 14.23	CAD 12.43	CAD 12.91
AD EUR H .....	€ 14.83	€ 12.93	€ 13.23
AD GBP H .....	£ 14.27	£ 12.48	£ 12.96
AD SGD H .....	SGD 14.72	SGD 12.82	SGD 13.14
AD ZAR H .....	R 94.05	R 81.72	R 85.67
B .....	\$ 15.93	\$ 13.63	\$ 13.32
BD .....	\$ 15.30	\$ 13.30	\$ 13.45
BD AUD H .....	AUD 13.96	AUD 12.25	AUD 12.97
BD EUR H .....	€ 14.86	€ 12.96	€ 13.26
BD ZAR H .....	R 94.54	R 82.18	R 86.08
C .....	\$ 17.93	\$ 15.29	\$ 14.87
I .....	\$ 22.56	\$ 19.13	\$ 18.37
S .....	\$ 26.28	\$ 22.18	\$ 21.09
S GBP H .....	£ 20.66	£ 17.55	£ 17.27
S1 .....	\$ 23.71	\$ 20.08	\$ 19.23
SD .....	\$ 101.29	\$ 87.93	\$ 89.25
A – EUR * .....	€ 16.06	€ 13.84	€ 14.54
B – EUR * .....	€ 13.20	€ 11.42	€ 12.12
C – EUR * .....	€ 14.85	€ 12.82	€ 13.53
I – EUR * .....	€ 18.69	€ 16.03	€ 16.71
S – EUR * .....	€ 21.77	€ 18.59	€ 19.19
S1 – EUR * .....	€ 19.64	€ 16.83	€ 17.50

	Emerging Markets Growth Portfolio		
	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	\$ 893,471,760	\$ 783,098,409	\$ 822,876,301
Klasse			
A .....	\$ 59.06	\$ 47.83	\$ 40.31
A AUD H .....	AUD 26.05	AUD 21.28	AUD 18.76
A PLN H .....	PLN 132.60	PLN 108.36	PLN 93.51
A SGD H .....	SGD 20.19	SGD 16.40	SGD 14.01
AD .....	\$ 22.94	\$ 18.84	\$ 16.43
B .....	\$ 44.78	\$ 36.45	\$ 31.03
C .....	\$ 48.69	\$ 39.52	\$ 33.46
CAUD H .....	AUD 24.59	AUD 20.13	AUD 17.83
ED .....	\$ 16.53	\$ 13.59	\$ 11.86
I .....	\$ 71.55	\$ 57.72	\$ 48.26
IAUD H .....	AUD 28.05	AUD 22.82	AUD 19.96
ICHF H .....	N/A	N/A	CHF 12.26
N .....	\$ 29.14	\$ 23.65	\$ 20.02
S .....	\$ 85.18	\$ 68.35	\$ 56.50
S1 .....	\$ 74.38	\$ 59.95	\$ 50.02

Emerging Markets Growth Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
A – EUR *	€ 48.93	€ 40.09	€ 36.68
B – EUR *	€ 37.10	€ 30.55	€ 28.23
C – EUR *	€ 40.34	€ 33.12	€ 30.44
I – EUR *	€ 59.28	€ 48.38	€ 43.91
S – EUR *	€ 70.57	€ 57.29	€ 51.41
S1 – EUR *	€ 61.62	€ 50.25	€ 45.51

Sustainable US Thematic Portfolio

	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen	\$ 596,078,770	\$ 294,558,651	\$ 132,983,933
Klasse			
A	\$ 37.81	\$ 33.33	\$ 25.61
A AUD H	AUD 65.78	AUD 58.29	AUD 46.77
A CAD H	CAD 60.70	CAD 53.68	CAD 41.99
A EUR H	€ 59.33	€ 52.68	€ 41.47
A GBP H	£ 49.53	£ 43.78	£ 34.61
A SGD H	SGD 48.97	SGD 43.26	SGD 33.63
AN	\$ 72.87	\$ 64.25	\$ 49.37
B	\$ 31.12	\$ 27.57	\$ 21.40
B CAD H	N/A	N/A	CAD 38.86
C	\$ 35.94	\$ 31.76	\$ 24.51
C EUR H	€ 57.01	€ 50.73	€ 40.12
I	\$ 44.47	\$ 39.05	\$ 29.77
I EUR H	€ 64.16	€ 56.75	€ 44.34
I GBP	£ 20.60	£ 18.85	N/A
IN	\$ 79.35	\$ 69.69	\$ 53.13
S	\$ 60.30	\$ 52.74	\$ 39.86
S1	\$ 46.88	\$ 41.13	\$ 31.29
S1 JPY H	¥ 437.00	¥ 385.00	¥ 297.00
A – EUR *	€ 31.32	€ 27.94	€ 23.30
B – EUR *	€ 25.78	€ 23.11	€ 19.47
C – EUR *	€ 29.78	€ 26.62	€ 22.30
I – EUR *	€ 36.84	€ 32.73	€ 27.09
IN – EUR *	€ 65.74	€ 58.41	N/A
S – EUR *	€ 49.96	€ 44.20	€ 36.27
S1 – EUR *	€ 38.84	€ 34.47	€ 28.47

	Asia Ex-Japan Equity Portfolio		
	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen .....	\$ 387,791,795	\$ 299,846,609	\$ 300,017,545
Klasse			
A .....	\$ 27.16	\$ 20.88	\$ 19.35
A AUD H .....	AUD 27.38	AUD 21.25	AUD 20.49
A SGD H .....	SGD 19.58	SGD 15.10	SGD 14.19
AD .....	\$ 17.90	\$ 14.00	\$ 13.50
AD AUD H .....	AUD 15.60	AUD 12.32	AUD 12.28
AD CAD H .....	CAD 13.24	CAD 10.41	CAD 10.21
AD EUR H .....	€ 16.44	€ 12.92	€ 12.57
AD GBP H .....	£ 16.38	£ 12.90	£ 12.66
AD NZD H .....	NZD 16.99	NZD 13.36	NZD 13.21
AD RMB H .....	CNH 111.21	CNH 87.37	CNH 84.44
AD SGD H .....	SGD 17.09	SGD 13.41	SGD 13.04
AD ZAR H .....	R 120.01	R 93.89	R 91.84
AY JPY .....	¥ 2.09	¥ 1.59	¥ 1.48
B .....	N/A	N/A	\$ 17.57
BD .....	\$ 17.83	\$ 13.96	\$ 13.46
BD AUD H .....	AUD 15.64	AUD 12.36	AUD 12.33
BD CAD H .....	CAD 13.84	CAD 10.89	CAD 10.69
BD GBP H .....	£ 16.43	£ 12.94	£ 12.67
BD NZD H .....	NZD 16.91	NZD 13.30	NZD 13.17
BD ZAR H .....	R 107.78	R 84.35	R 82.52
BY JPY .....	¥ 2.00	¥ 1.53	¥ 1.43
C .....	\$ 25.82	\$ 19.90	\$ 18.51
C AUD H .....	AUD 26.60	AUD 20.68	AUD 20.03
ED .....	\$ 15.34	\$ 11.99	\$ 11.53
I .....	\$ 29.73	\$ 22.76	\$ 20.93
I AUD H .....	AUD 30.40	AUD 23.50	AUD 22.47
I GBP .....	£ 23.97	£ 19.12	£ 19.31
ID .....	\$ 17.93	\$ 14.02	\$ 13.51
ID AUD H .....	AUD 15.88	AUD 12.54	AUD 12.50
S .....	\$ 33.60	\$ 25.59	\$ 23.27
S1 .....	\$ 30.31	\$ 23.18	\$ 21.27
SD .....	\$ 122.97	\$ 96.21	\$ 92.96
A – EUR * .....	€ 22.50	€ 17.50	€ 17.61
AD – EUR * .....	€ 14.83	€ 11.73	€ 12.28
B – EUR * .....	N/A	N/A	€ 15.99
BD – EUR * .....	€ 14.77	€ 11.70	€ 12.25
C – EUR * .....	€ 21.39	€ 16.68	€ 16.84
I – EUR * .....	€ 24.63	€ 19.08	€ 19.04
ID – EUR * .....	€ 14.85	€ 11.75	€ 12.29
S – EUR * .....	€ 27.84	€ 21.45	€ 21.17
S1 – EUR * .....	€ 25.11	€ 19.43	€ 19.35

	<b>Japan Strategic Value Portfolio</b>		
	<b>28. Februar 2021</b>	<b>31. August 2020</b>	<b>31. August 2019</b>
	<b>(ungeprüft)</b>		
Nettovermögen.....	¥ 8,227,907,636	¥ 8,665,430,416	¥ 13,432,567,077
Klasse			
2 (2) .....	N/A	¥ 10,390.00	¥ 10,202.00
A .....	¥ 11,101.00	¥ 9,542.00	¥ 9,439.00
A AUD H .....	AUD 21.68	AUD 18.72	AUD 18.91
A CZK H .....	CZK 907.07	CZK 784.96	CZK 783.08
A EUR H .....	€ 25.91	€ 22.39	€ 22.47
A NZD H .....	NZD 23.66	NZD 20.39	NZD 20.37
A SGD H .....	SGD 15.91	SGD 13.67	SGD 13.56
A USD H .....	\$ 31.46	\$ 27.00	\$ 26.55
AD .....	¥ 11,386.00	¥ 9,930.00	¥ 10,119.00
AD AUD H .....	AUD 15.08	AUD 13.24	AUD 13.97
AD NZD H .....	NZD 15.51	NZD 13.60	NZD 14.22
AD USD H .....	\$ 14.94	\$ 13.04	\$ 13.46
AD ZAR H .....	R 105.29	R 91.42	R 95.90
B .....	¥ 9,601.00	¥ 8,294.00	¥ 8,287.00
BD .....	¥ 11,306.00	¥ 9,861.00	¥ 10,051.00
BD AUD H .....	AUD 14.92	AUD 13.10	AUD 13.82
BD USD H .....	\$ 14.81	\$ 12.93	\$ 13.36
BD ZAR H .....	R 104.88	R 91.01	R 95.51
C .....	¥ 10,377.00	¥ 8,941.00	¥ 8,884.00
C EUR H .....	€ 24.43	€ 21.15	€ 21.31
I .....	¥ 12,466.00	¥ 10,672.00	¥ 10,468.00
I EUR H .....	€ 28.21	€ 24.28	€ 24.16
I USD H .....	\$ 33.89	\$ 28.97	\$ 28.26
S EUR H .....	€ 27.79	€ 23.77	€ 23.39
S1 .....	¥ 13,182.00	¥ 11,257.00	¥ 10,993.00
S1 USD H .....	\$ 24.35	\$ 20.76	\$ 20.15
SD .....	¥ 12,288.00	¥ 10,685.00	¥ 10,833.00
2 – USD * .....	N/A	\$ 98.06	\$ 96.03
2 – EUR * .....	N/A	€ 82.24	€ 87.38
A – USD * .....	\$ 104.19	\$ 90.05	\$ 88.85
A – EUR * .....	€ 86.33	€ 75.53	€ 80.84
B – USD * .....	\$ 90.11	\$ 78.27	\$ 78.00
B – EUR * .....	€ 74.66	€ 65.65	€ 70.97
C – USD * .....	\$ 97.39	\$ 84.38	\$ 83.62
C – EUR * .....	€ 80.70	€ 70.77	€ 76.09
I – USD * .....	\$ 117.00	\$ 100.72	\$ 98.53
I – EUR * .....	€ 96.94	€ 84.48	€ 89.65
S1 – USD * .....	\$ 123.72	\$ 106.24	\$ 103.47
S1 – EUR * .....	€ 102.51	€ 89.11	€ 94.15

	China Low Volatility Equity Portfolio		
	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	\$ 152,212,881	\$ 146,211,198	\$ 147,179,581
Klasse			
A .....	\$ 75.09	\$ 67.15	\$ 53.00
A PLN H .....	PLN 125.95	PLN 113.07	PLN 90.71
AD .....	\$ 22.64	\$ 20.58	\$ 16.90
AD AUD H .....	AUD 20.55	AUD 18.76	AUD 15.81
AD CAD H .....	CAD 21.17	CAD 19.30	CAD 16.03
AD EUR H .....	€ 21.86	€ 19.91	€ 16.44
AD GBP H .....	£ 21.51	£ 19.61	£ 16.31
AD NZD H .....	NZD 21.08	NZD 19.21	NZD 16.11
AD RMB H .....	CNH 145.22	CNH 132.49	CNH 109.12
AD SGD H .....	SGD 21.52	SGD 19.59	SGD 16.19
AD ZAR H .....	R 138.84	R 125.78	R 103.78
B .....	\$ 59.45	\$ 53.42	\$ 42.59
BD .....	\$ 22.67	\$ 20.62	\$ 16.91
BD AUD H .....	AUD 20.52	AUD 18.74	AUD 15.78
BD EUR H .....	€ 21.81	€ 19.87	€ 16.38
BD NZD H .....	NZD 21.18	NZD 19.30	NZD 16.10
BD ZAR H .....	R 139.92	R 126.91	R 104.55
C .....	\$ 70.50	\$ 63.19	\$ 50.10
I .....	\$ 90.19	\$ 80.33	\$ 62.90
S .....	\$ 112.52	\$ 99.71	\$ 77.00
S1 .....	\$ 100.81	\$ 89.66	\$ 69.84
A – EUR * .....	€ 62.21	€ 56.28	€ 48.22
B – EUR * .....	€ 49.25	€ 44.77	€ 38.75
C – EUR * .....	€ 58.41	€ 52.96	€ 45.58
I – EUR * .....	€ 74.72	€ 67.33	€ 57.23
S – EUR * .....	€ 93.22	€ 83.57	€ 70.06
S1 – EUR * .....	€ 83.52	€ 75.15	€ 63.54

	Short Duration Bond Portfolio		
	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	\$ 537,065,009	\$ 570,960,697	\$ 570,402,667
Klasse			
A .....	\$ 7.66	\$ 7.76	\$ 7.86
A2 .....	\$ 18.41	\$ 18.44	\$ 18.25
A2 EUR H .....	€ 14.51	€ 14.60	€ 14.74
A2 SGD H .....	SGD 15.55	SGD 15.58	SGD 15.48
AA .....	\$ 11.71	\$ 11.94	\$ 12.24
AA AUD H .....	AUD 11.55	AUD 11.80	AUD 12.13
AA CAD H .....	CAD 11.78	CAD 12.02	CAD 12.33
AA GBP H .....	£ 11.74	£ 11.99	£ 12.31
AA NZD H .....	NZD 11.87	NZD 12.11	NZD 12.44
AA SGD H .....	SGD 11.72	SGD 11.96	SGD 12.26
AJ .....	\$ 7.36	\$ 7.45	\$ 7.53
AR EUR H .....	€ 12.32	€ 12.39	€ 12.85
AT .....	\$ 7.65	\$ 7.76	\$ 7.85

## Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
AT AUD H .....	AUD 11.95	AUD 12.13	AUD 12.32
AT CAD H .....	CAD 12.10	CAD 12.27	CAD 12.43
AT EUR H .....	€ 11.72	€ 11.88	€ 12.05
AT GBP H .....	£ 12.20	£ 12.38	£ 12.54
AT NZD H .....	NZD 12.30	NZD 12.47	NZD 12.65
AT SGD H .....	SGD 12.48	SGD 12.65	SGD 12.81
AX .....	\$ 6.12	\$ 6.21	\$ 6.29
B .....	\$ 7.66	\$ 7.76	\$ 7.86
B2 .....	\$ 14.42	\$ 14.52	\$ 14.51
BA .....	\$ 10.87	\$ 11.15	\$ 11.55
BA AUD H .....	N/A	N/A	AUD 11.44
BT .....	\$ 7.71	\$ 7.81	\$ 7.90
BT AUD H .....	AUD 11.98	AUD 12.16	AUD 12.36
BT CAD H (3) .....	N/A	CAD 12.22	CAD 12.38
BT GBP H .....	£ 12.20	£ 12.39	£ 12.56
BX (4) .....	N/A	\$ 6.20	\$ 6.28
C .....	\$ 7.66	\$ 7.76	\$ 7.86
C2 .....	\$ 15.20	\$ 15.26	\$ 15.16
C2 EUR H .....	€ 13.80	€ 13.91	€ 14.09
I .....	\$ 7.66	\$ 7.77	\$ 7.86
I2 .....	\$ 13.26	\$ 13.25	\$ 13.02
I2 AUD H .....	AUD 19.98	AUD 20.00	AUD 19.85
I2 EUR H .....	€ 15.39	€ 15.44	€ 15.48
IT .....	\$ 12.58	\$ 12.75	\$ 12.90
IT AUD H .....	AUD 12.48	AUD 12.67	AUD 12.88
N2 .....	\$ 14.73	\$ 14.79	\$ 14.71
NT .....	\$ 12.41	\$ 12.57	\$ 12.71
S .....	\$ 99.54	\$ 100.90	N/A
S EUR H .....	€ 16.46	€ 16.48	€ 16.45
S SGD H .....	SGD 17.85	SGD 17.79	SGD 17.49
S1 2 .....	\$ 16.77	\$ 16.74	\$ 16.42
S1 EUR H .....	€ 15.62	€ 15.66	€ 15.66
SA .....	\$ 86.45	\$ 87.69	\$ 88.89
A – EUR * .....	€ 6.35	€ 6.50	€ 7.15
A2 – EUR * .....	€ 15.25	€ 15.46	€ 16.60
AT – EUR * .....	€ 6.34	€ 6.50	€ 7.14
B – EUR * .....	€ 6.35	€ 6.50	€ 7.15
B2 – EUR * .....	€ 11.95	€ 12.17	€ 13.20
BT – EUR * .....	€ 6.39	€ 6.55	€ 7.19
C – EUR * .....	€ 6.35	€ 6.50	€ 7.15
C2 – EUR * .....	€ 12.59	€ 12.79	€ 13.79
I – EUR * .....	€ 6.35	€ 6.51	€ 7.15
I2 – EUR * .....	€ 10.99	€ 11.11	€ 11.85
S – EUR * .....	€ 82.47	€ 84.57	N/A



	Global High Yield Portfolio		
	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	\$ 20,942,554,797	\$ 20,280,358,505	\$ 20,563,305,061
Klasse			
A .....	\$ 3.81	\$ 3.69	\$ 4.00
A2 .....	\$ 16.85	\$ 15.81	\$ 15.96
A2 CHF H .....	CHF 16.13	CHF 15.24	CHF 15.85
A2 EUR H .....	€ 24.29	€ 22.92	€ 23.81
A2 PLN H .....	PLN 104.99	PLN 98.88	PLN 101.93
A2 SGD H .....	SGD 21.93	SGD 20.60	SGD 21.04
AA .....	\$ 10.53	\$ 10.31	\$ 11.40
AA AUD H .....	AUD 9.98	AUD 9.80	AUD 11.16
AA CAD H .....	CAD 10.06	CAD 9.87	CAD 11.07
AA EUR H .....	€ 10.23	€ 10.03	€ 11.18
AA GBP H .....	£ 10.05	£ 9.87	£ 11.11
AA NZD H .....	NZD 10.07	NZD 9.88	NZD 11.16
AA RMB H .....	CNH 69.01	CNH 67.73	CNH 75.12
AA SGD H .....	SGD 10.32	SGD 10.11	SGD 11.27
AA ZAR H .....	R 68.17	R 66.68	R 75.60
AK .....	\$ 12.41	\$ 12.05	\$ 13.05
AK EUR H .....	€ 12.22	€ 11.89	€ 13.01
AR EUR H .....	€ 11.23	€ 10.60	€ 12.00
AT .....	\$ 3.77	\$ 3.66	\$ 3.97
AT AUD H .....	AUD 12.72	AUD 12.39	AUD 13.82
AT CAD H .....	CAD 11.59	CAD 11.28	CAD 12.41
AT EUR H .....	€ 12.91	€ 12.55	€ 13.74
AT GBP H .....	£ 12.84	£ 12.50	£ 13.80
AT NZD H .....	NZD 11.72	NZD 11.40	NZD 12.64
AT RMB H .....	CNH 83.78	CNH 81.49	CNH 88.64
AT SGD H .....	SGD 11.77	SGD 11.44	SGD 12.50
B .....	\$ 3.81	\$ 3.69	\$ 4.00
B2 .....	\$ 24.24	\$ 22.85	\$ 23.30
B2 EUR H .....	€ 21.72	€ 20.59	€ 21.61
BA .....	\$ 9.74	\$ 9.58	\$ 10.71
BAAUD H .....	AUD 9.22	AUD 9.11	AUD 10.48
BAZAR H .....	R 62.62	R 61.54	R 70.72
BT .....	\$ 3.84	\$ 3.73	\$ 4.04
BT AUD H .....	AUD 12.73	AUD 12.40	AUD 13.80
BT CAD H .....	CAD 11.60	CAD 11.28	CAD 12.39
BT EUR H .....	€ 12.95	€ 12.59	€ 13.76
BT GBP H .....	£ 12.86	£ 12.52	£ 13.81
BT NZD H .....	NZD 11.84	NZD 11.52	NZD 12.75
C .....	\$ 3.81	\$ 3.69	\$ 4.00
C2 .....	\$ 23.76	\$ 22.35	\$ 22.67
C2 EUR H .....	€ 19.22	€ 18.19	€ 18.98
CK .....	\$ 12.37	\$ 12.02	\$ 13.01
CK EUR H .....	€ 12.21	€ 11.87	€ 13.00
CT .....	\$ 12.82	\$ 12.44	\$ 13.48
EA .....	\$ 12.76	\$ 12.53	\$ 13.92
EAAUD H .....	AUD 13.30	AUD 13.11	AUD 15.00
EAZAR H .....	R 89.55	R 87.81	R 100.06
I .....	\$ 3.81	\$ 3.69	\$ 4.00

Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
I2	\$ 10.74	\$ 10.05	\$ 10.10
I2 AUD H	AUD 28.97	AUD 27.21	AUD 28.23
I2 CHF H	CHF 16.63	CHF 15.68	CHF 16.21
I2 EUR H	€ 25.70	€ 24.19	€ 25.01
I2 SGD H	SGD 18.93	SGD 17.74	SGD 18.03
IA AUD H	AUD 12.66	AUD 12.41	AUD 14.04
IQD	\$ 12.12	\$ 11.78	\$ 12.78
IT	\$ 11.84	\$ 11.49	\$ 12.47
IT AUD H	AUD 11.29	AUD 11.00	AUD 12.29
IT CAD H	CAD 13.82	CAD 13.44	CAD 14.81
IT EUR H	€ 12.81	€ 12.46	€ 13.65
IT GBP H	£ 13.78	£ 13.42	£ 14.83
IT NZD H	NZD 13.69	NZD 13.33	NZD 14.78
IT RMB H	CNH 79.98	CNH 77.82	CNH 84.72
J	\$ 4.10	\$ 3.97	\$ 4.30
N2	\$ 19.59	\$ 18.43	\$ 18.70
NT	\$ 12.13	\$ 11.77	\$ 12.75
S EUR H	€ 113.65	€ 106.45	€ 108.75
S1	\$ 28.85	\$ 26.99	\$ 27.02
S1D	\$ 17.64	\$ 16.85	\$ 17.79
SA	\$ 79.94	\$ 77.65	\$ 84.33
SHK	\$ 88.39	\$ 85.84	\$ 93.16
SK	\$ 38.71	\$ 36.16	\$ 36.12
SQ	\$ 97.73	\$ 95.19	\$ 103.97
W	\$ 14.36	\$ 13.96	N/A
W2	\$ 16.59	\$ 15.52	\$ 15.55
W2 CHF H	CHF 15.14	CHF 14.27	CHF 14.72
W2 EUR H	€ 15.46	€ 14.53	N/A
WT	\$ 13.07	\$ 12.69	\$ 13.78
WT AUD H	AUD 12.57	AUD 12.26	AUD 13.69
WT CAD H	CAD 14.03	CAD 13.66	N/A
WT EUR H	€ 12.87	€ 12.53	€ 13.73
WT GBPH	£ 13.97	£ 13.61	N/A
WT RMB H	CNH 94.50	CNH 92.01	N/A
A – EUR *	€ 3.16	€ 3.09	€ 3.64
A2 – EUR *	€ 13.96	€ 13.25	€ 14.52
AK – EUR *	€ 10.28	€ 10.10	€ 11.87
AT – EUR *	€ 3.12	€ 3.07	€ 3.61
B – EUR *	€ 3.16	€ 3.10	€ 3.64
B2 – EUR *	€ 20.08	€ 19.15	€ 21.20
BT – EUR *	€ 3.18	€ 3.13	€ 3.68
C – EUR *	€ 3.16	€ 3.10	€ 3.64
C2 – EUR *	€ 19.68	€ 18.73	€ 20.63
I – EUR *	€ 3.16	€ 3.09	€ 3.64
I2 – EUR *	€ 8.90	€ 8.43	€ 9.19
IQD – EUR *	€ 10.04	€ 9.87	€ 11.63
S1 – EUR *	€ 23.90	€ 22.62	€ 24.58
S1D – EUR *	€ 14.61	€ 14.12	€ 16.19
W – EUR *	€ 11.90	€ 11.70	N/A

	American Income Portfolio		
	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen .....	\$ 27,010,768,351	\$ 28,197,385,467	\$ 23,009,132,001
Klasse			
A .....	\$ 8.15	\$ 8.17	\$ 8.39
A2 .....	\$ 32.12	\$ 31.47	\$ 30.66
A2 CHF H .....	CHF 16.91	CHF 16.67	CHF 16.74
A2 DUR PH .....	\$ 18.60	\$ 17.89	\$ 17.83
A2 EUR H .....	€ 20.11	€ 19.80	€ 19.82
A2 PLN H .....	PLN 107.73	PLN 105.80	PLN 104.94
A2 SGD H .....	SGD 21.81	SGD 21.39	SGD 21.02
AA .....	\$ 12.62	\$ 12.75	\$ 13.27
AA AUD H .....	AUD 12.20	AUD 12.36	AUD 13.10
AA CAD H .....	CAD 12.09	CAD 12.23	CAD 12.85
AA DUR PH .....	\$ 11.78	\$ 11.69	\$ 12.48
AA EUR H .....	€ 12.13	€ 12.27	€ 12.87
AA GBP H .....	£ 12.01	£ 12.16	£ 12.84
AA NZD H .....	NZD 12.11	NZD 12.25	NZD 12.93
AA RMB H .....	CNH 82.10	CNH 83.13	CNH 86.71
AA SGD H .....	SGD 12.34	SGD 12.47	SGD 13.05
AA ZAR H .....	R 83.24	R 83.92	R 88.02
AK .....	\$ 13.57	\$ 13.62	\$ 13.97
AK EUR H .....	€ 13.39	€ 13.46	€ 13.95
AR EUR .....	€ 12.25	€ 12.13	€ 13.74
AR EUR H .....	€ 12.68	€ 12.48	€ 13.26
AT .....	\$ 8.14	\$ 8.16	\$ 8.38
AT AUD H .....	AUD 13.56	AUD 13.64	AUD 14.26
AT CAD H .....	CAD 13.47	CAD 13.53	CAD 14.02
AT DUR PH .....	\$ 13.08	\$ 12.89	\$ 13.57
AT EUR H .....	€ 13.48	€ 13.54	€ 14.01
AT GBP H .....	£ 13.38	£ 13.46	£ 13.98
AT NZD H .....	NZD 12.89	NZD 12.96	NZD 13.48
AT RMB H .....	CNH 90.95	CNH 91.47	CNH 93.99
AT SGD H .....	SGD 13.55	SGD 13.62	SGD 14.04
B .....	\$ 8.15	\$ 8.17	\$ 8.39
B2 .....	\$ 25.61	\$ 25.17	\$ 24.70
BA .....	\$ 11.97	\$ 12.13	\$ 12.73
BA AUD H .....	AUD 11.55	AUD 11.74	AUD 12.54
BA ZAR H .....	R 79.37	R 80.27	R 84.90
BT .....	\$ 8.20	\$ 8.23	\$ 8.44
BT AUD H .....	AUD 13.64	AUD 13.72	AUD 14.33
BT CAD H .....	CAD 13.35	CAD 13.42	CAD 13.90
BT EUR H .....	€ 13.49	€ 13.55	€ 14.01
BT GBP H .....	£ 13.47	£ 13.55	£ 14.08
BT NZD H .....	NZD 12.96	NZD 13.02	NZD 13.55
C .....	\$ 8.15	\$ 8.17	\$ 8.39
C2 .....	\$ 39.15	\$ 38.44	\$ 37.62
C2 DUR PH .....	\$ 17.95	\$ 17.30	\$ 17.32
C2 EUR H .....	€ 19.21	€ 18.95	€ 19.06
CT .....	\$ 13.62	\$ 13.67	\$ 14.03
EA .....	\$ 14.55	\$ 14.73	\$ 15.42

## American Income Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
EA AUD H .....	AUD 14.20	AUD 14.43	AUD 15.37
EA ZAR H .....	R 96.40	R 97.34	R 102.73
I .....	\$ 8.15	\$ 8.17	\$ 8.39
I2 .....	\$ 19.13	\$ 18.68	\$ 18.10
I2 AUD H .....	AUD 16.89	AUD 16.54	AUD 16.42
I2 CHF H .....	CHF 17.69	CHF 17.40	CHF 17.37
I2 DUR PH .....	\$ 19.17	\$ 18.39	\$ 18.23
I2 EUR H .....	€ 21.71	€ 21.32	€ 21.24
I2 SGD H .....	SGD 19.47	SGD 19.04	SGD 18.62
IA .....	\$ 14.39	\$ 14.50	\$ 15.01
IA AUD H .....	AUD 13.99	AUD 14.13	AUD 14.89
IT .....	\$ 13.28	\$ 13.33	\$ 13.68
IT AUD H .....	AUD 12.68	AUD 12.76	AUD 13.34
IT CAD H .....	CAD 14.69	CAD 14.77	CAD 15.31
IT EUR H .....	€ 14.68	€ 14.75	€ 15.26
IT GBP H .....	£ 14.62	£ 14.70	£ 15.27
IT JPY .....	¥ 9,658.00	¥ 9,632.00	¥ 9,905.00
IT JPY H .....	¥ 8,585.00	¥ 8,619.00	¥ 8,890.00
IT NZD H .....	NZD 14.63	NZD 14.72	NZD 15.30
IT RMB H .....	CNH 99.06	CNH 99.66	CNH 102.14
IT SGD H .....	SGD 13.71	SGD 13.77	SGD 14.19
J .....	\$ 8.31	\$ 8.33	\$ 8.55
L2 .....	\$ 15.84	\$ 15.50	N/A
L2 AUD H .....	AUD 15.43	AUD 15.13	N/A
L2 SGD H .....	SGD 15.69	SGD 15.36	N/A
LT .....	\$ 14.69	\$ 14.75	N/A
LT AUD H .....	AUD 14.48	AUD 14.57	N/A
LT SGD H .....	SGD 14.72	SGD 14.79	N/A
N2 .....	\$ 19.01	\$ 18.67	\$ 18.29
NT .....	\$ 13.24	\$ 13.29	\$ 13.64
S .....	\$ 22.01	\$ 21.43	\$ 20.61
S1 .....	\$ 24.68	\$ 24.08	\$ 23.28
S1D .....	\$ 16.23	\$ 16.16	\$ 16.27
S1D2 .....	\$ 96.39	\$ 96.73	N/A
SA .....	\$ 91.97	\$ 92.31	\$ 94.74
SHK .....	\$ 95.58	\$ 95.92	\$ 98.43
W .....	\$ 14.66	\$ 14.71	\$ 15.10
W2 .....	\$ 17.61	\$ 17.19	\$ 16.63
W2 CHF H .....	CHF 16.07	CHF 15.79	CHF 15.74
W2 EUR H .....	€ 16.26	€ 15.96	€ 15.85
WT .....	\$ 14.67	\$ 14.72	\$ 15.11
WT AUD H .....	AUD 14.28	AUD 14.37	AUD 15.02
WT EUR H .....	€ 14.76	€ 14.83	€ 15.34
WT GBP H .....	£ 14.59	£ 14.67	£ 15.32
WT SGD H .....	SGD 14.56	SGD 14.63	SGD 15.08
A – EUR * .....	€ 6.75	€ 6.85	€ 7.63
A2 – EUR * .....	€ 26.61	€ 26.37	€ 27.90
AK – EUR * .....	€ 11.24	€ 11.42	€ 12.71
AT – EUR * .....	€ 6.74	€ 6.84	€ 7.62

	American Income Portfolio (Fortsetzung)		
	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
B – EUR *	€ 6.75	€ 6.85	€ 7.63
B2 – EUR *	€ 21.22	€ 21.10	€ 22.47
BT – EUR *	€ 6.79	€ 6.90	€ 7.68
C – EUR *	€ 6.75	€ 6.85	€ 7.63
C2 – EUR *	€ 32.43	€ 32.21	€ 34.23
I – EUR *	€ 6.75	€ 6.85	€ 7.63
I2 – EUR *	€ 15.85	€ 15.66	€ 16.47
IT – EUR *	€ 11.00	€ 11.17	€ 12.45
S1 – EUR *	€ 20.45	€ 20.18	€ 21.18
S1D – EUR *	€ 13.45	€ 13.54	€ 14.80

  

	European Income Portfolio		
	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen	€ 2,105,445,164	€ 2,426,429,717	€ 4,015,417,264
Klasse			
A	€ 6.87	€ 6.78	€ 7.04
A2	€ 21.77	€ 21.14	€ 21.25
A2 CHF H	CHF 16.71	CHF 16.26	CHF 16.38
A2 PLN H	PLN 108.70	PLN 105.30	PLN 104.80
A2 SGD H	SGD 18.77	SGD 18.16	SGD 17.96
A2 USD H	\$ 19.46	\$ 18.81	\$ 18.45
AA	€ 12.72	€ 12.65	€ 13.32
AA AUD H	AUD 12.48	AUD 12.42	AUD 13.27
AA HKD H	HKD 84.65	HKD 84.16	HKD 88.25
AA RMB H	CNH 84.59	CNH 84.01	CNH 88.08
AA SGD H	SGD 12.60	SGD 12.51	SGD 13.19
AA USD H	\$ 12.85	\$ 12.75	\$ 13.38
AK	€ 14.48	€ 14.30	€ 14.85
AR	€ 12.89	€ 12.52	€ 13.21
AT	€ 6.87	€ 6.78	€ 7.05
AT AUD H	AUD 14.71	AUD 14.53	AUD 15.30
AT SGD H	SGD 13.96	SGD 13.76	SGD 14.31
AT USD H	\$ 15.05	\$ 14.84	\$ 15.35
B	€ 6.87	€ 6.78	€ 7.04
B2	€ 18.73	€ 18.25	€ 18.47
BA	€ 12.08	€ 12.05	€ 12.79
BA AUD H	AUD 11.86	AUD 11.84	AUD 12.75
BA USD H	\$ 12.20	\$ 12.16	\$ 12.85
BT	€ 6.87	€ 6.78	€ 7.05
BT AUD H	AUD 14.74	AUD 14.57	AUD 15.34
BT USD H	\$ 15.06	\$ 14.84	\$ 15.35
C	€ 6.87	€ 6.78	€ 7.04
C2	€ 20.64	€ 20.09	€ 20.27
C2 USD H	\$ 18.61	\$ 18.02	\$ 17.76
CK	€ 14.47	€ 14.28	€ 14.84
CT USD H	\$ 13.88	\$ 13.68	\$ 14.15
I	€ 6.87	€ 6.78	€ 7.04
I2	€ 14.55	€ 14.09	€ 14.09

## European Income Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
I2 AUD H .....	AUD 31.18	AUD 30.13	AUD 30.10
I2 CHF H .....	CHF 17.25	CHF 16.73	CHF 16.75
I2 USD H .....	\$ 27.63	\$ 26.62	\$ 25.97
IA .....	€ 13.91	€ 13.79	€ 14.45
IA HKD H .....	HKD 93.27	HKD 92.47	HKD 96.30
IA SGD H .....	SGD 13.86	SGD 13.72	SGD 14.39
IA USD H .....	\$ 14.11	\$ 13.97	\$ 14.57
IT .....	€ 14.53	€ 14.34	€ 14.90
IT SGD H .....	SGD 14.50	SGD 14.29	SGD 14.85
IT USD H .....	\$ 14.28	\$ 14.07	\$ 14.55
NT USD H .....	\$ 14.58	\$ 14.38	\$ 14.87
S .....	€ 118.40	€ 114.26	€ 113.36
S1 .....	€ 23.80	€ 23.03	€ 22.95
S1 USD H .....	\$ 25.86	\$ 24.89	\$ 24.23
S1D .....	€ 14.38	€ 14.20	€ 14.75
SA USD H .....	\$ 94.90	\$ 93.62	\$ 96.97
SHK .....	€ 94.81	€ 93.55	€ 97.23
W2 .....	€ 15.66	€ 15.16	N/A
W2 CHF H .....	CHF 16.32	CHF 15.82	CHF 15.82
W2 USD H .....	\$ 16.07	\$ 15.47	N/A
WA .....	€ 14.67	€ 14.53	N/A
WA HKD H .....	HKD 98.23	HKD 97.28	N/A
WA USD H .....	\$ 14.76	\$ 14.60	N/A
WT .....	€ 14.81	€ 14.62	N/A
WT SGD H .....	SGD 14.81	SGD 14.60	N/A
WT USD H .....	\$ 14.90	\$ 14.68	N/A
A – USD * .....	\$ 8.29	\$ 8.09	\$ 7.74
A2 – USD * .....	\$ 26.28	\$ 25.22	\$ 23.36
AT – USD * .....	\$ 8.29	\$ 8.09	\$ 7.75
B – USD * .....	\$ 8.29	\$ 8.09	\$ 7.74
B2 – USD * .....	\$ 22.61	\$ 21.77	\$ 20.30
BT – USD * .....	\$ 8.29	\$ 8.09	\$ 7.75
C – USD * .....	\$ 8.29	\$ 8.09	\$ 7.74
C2 – USD * .....	\$ 24.91	\$ 23.97	\$ 22.28
I – USD * .....	\$ 8.29	\$ 8.09	\$ 7.74
I2 – USD * .....	\$ 17.56	\$ 16.81	\$ 15.49
S – USD * .....	\$ 142.91	\$ 136.33	\$ 124.59
S1 – USD * .....	\$ 28.73	\$ 27.48	\$ 25.22



	Emerging Markets Debt Portfolio		
	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen .....	\$ 903,422,843	\$ 941,712,812	\$ 980,277,618
Klasse			
A .....	\$ 14.30	\$ 14.41	\$ 14.69
A2 .....	\$ 34.75	\$ 34.23	\$ 32.87
A2 CHF H .....	CHF 15.91	CHF 15.78	CHF 15.60
A2 EUR H .....	€ 21.53	€ 21.34	€ 21.05
A2 PLN H .....	PLN 106.17	PLN 105.14	PLN 103.07
A2 SGD H .....	SGD 21.76	SGD 21.46	SGD 20.87
AA .....	\$ 12.08	\$ 12.27	\$ 12.68
AA AUD H .....	AUD 11.42	AUD 11.65	AUD 12.42
AA CAD H .....	CAD 11.18	CAD 11.39	CAD 11.94
AA EUR H .....	€ 11.36	€ 11.56	€ 12.03
AA GBP H .....	£ 11.17	£ 11.39	£ 12.00
AA NZD H .....	NZD 11.11	NZD 11.31	NZD 11.98
AA RMB H .....	CNH 84.65	CNH 86.21	CNH 89.19
AA SGD H .....	SGD 11.77	SGD 11.97	SGD 12.47
AA ZAR H .....	R 77.98	R 79.14	R 83.46
AR EUR .....	€ 11.90	€ 11.85	€ 13.36
AT .....	\$ 14.35	\$ 14.47	\$ 14.75
AT AUD H .....	AUD 12.70	AUD 12.87	AUD 13.53
AT CAD H .....	CAD 11.61	CAD 11.74	CAD 12.14
AT EUR H .....	€ 13.17	€ 13.31	€ 13.66
AT GBP H .....	£ 11.66	£ 11.81	£ 12.27
AT NZD H .....	NZD 11.35	NZD 11.48	NZD 11.98
AT RMB H .....	CNH 86.90	CNH 87.93	CNH 89.62
AT SGD H .....	SGD 12.63	SGD 12.76	SGD 13.10
B (5) .....	N/A	\$ 14.41	\$ 14.69
B2 .....	\$ 29.93	\$ 29.62	\$ 28.74
BA .....	\$ 11.20	\$ 11.43	\$ 11.95
BA AUD H .....	AUD 10.60	AUD 10.87	AUD 11.69
BA ZAR H .....	R 72.05	R 73.48	R 78.22
BT .....	\$ 14.31	\$ 14.43	\$ 14.70
BT AUD H .....	AUD 12.71	AUD 12.87	AUD 13.51
BT CAD H .....	CAD 11.61	CAD 11.74	CAD 12.13
BT EUR H .....	€ 13.19	€ 13.33	€ 13.67
BT GBP H .....	£ 11.62	£ 11.77	£ 12.23
BT NZD H .....	NZD 11.42	NZD 11.55	NZD 12.05
C .....	\$ 14.30	\$ 14.41	\$ 14.69
C2 .....	\$ 32.46	\$ 32.04	\$ 30.92
C2 EUR H .....	€ 20.59	€ 20.45	€ 20.26
CT .....	\$ 12.14	\$ 12.25	\$ 12.48
EA .....	\$ 14.26	\$ 14.52	N/A
EA AUD H .....	AUD 13.82	AUD 14.14	N/A
EA ZAR H .....	R 93.43	R 94.99	N/A
I .....	\$ 14.29	\$ 14.42	\$ 14.69
I2 .....	\$ 37.70	\$ 37.03	\$ 35.37
I2 CHF H .....	CHF 16.65	CHF 16.47	CHF 16.19
I2 EUR H .....	€ 22.95	€ 22.67	€ 22.24
IT .....	\$ 12.13	\$ 12.24	\$ 12.47
IT AUD H .....	AUD 11.41	AUD 11.55	AUD 12.15
IT EUR H .....	€ 12.60	€ 12.74	€ 13.07

Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
IT SGD H	SGD 11.82	SGD 11.94	SGD 12.26
N2	\$ 17.99	\$ 17.77	\$ 17.16
NT	\$ 11.80	\$ 11.89	\$ 12.12
S	\$ 37.07	\$ 36.28	\$ 34.41
S EUR H	€ 23.52	€ 23.15	€ 22.54
S GBP H	£ 24.78	£ 24.34	£ 23.76
S1 2	\$ 34.96	\$ 34.31	\$ 32.73
S1 EUR H	€ 22.16	€ 21.86	€ 21.40
S1 GBP H	£ 23.36	£ 23.01	£ 22.58
S1QD EUR H	€ 97.16	€ 98.17	N/A
SA	\$ 88.13	\$ 88.93	\$ 90.71
A – EUR *	€ 11.85	€ 12.08	€ 13.37
A2 – EUR *	€ 28.79	€ 28.69	€ 29.91
AT – EUR *	€ 11.89	€ 12.13	€ 13.42
B – EUR *	N/A	€ 12.08	€ 13.37
B2 – EUR *	€ 24.80	€ 24.83	€ 26.15
BT – EUR *	€ 11.86	€ 12.10	€ 13.37
C – EUR *	€ 11.85	€ 12.08	€ 13.37
C2 – EUR *	€ 26.89	€ 26.86	€ 28.13
I – EUR *	€ 11.84	€ 12.08	€ 13.37
I2 – EUR *	€ 31.23	€ 31.03	€ 32.18
S – EUR *	€ 30.71	€ 30.41	€ 31.31
S1 2 – EUR *	€ 28.96	€ 28.76	€ 29.78

Mortgage Income Portfolio

	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen	\$ 1,344,765,110	\$ 1,322,589,619	\$ 1,740,744,013
Klasse			
A	\$ 12.30	\$ 12.00	\$ 13.78
A2	\$ 17.98	\$ 17.03	\$ 18.40
A2X	\$ 12.87	\$ 12.19	\$ 13.16
AA	\$ 11.08	\$ 10.89	\$ 12.70
AA AUD H	AUD 10.74	AUD 10.58	AUD 12.56
AA RMB H	CNH 75.41	CNH 74.25	CNH 86.99
AA SGD H	SGD 10.96	SGD 10.78	SGD 12.64
AA ZAR H	R 73.77	R 72.23	R 85.50
AR EUR H	€ 11.43	€ 10.88	€ 12.99
AT	\$ 12.32	\$ 12.03	\$ 13.82
AT AUD H	AUD 11.98	AUD 11.73	AUD 13.72
AT GBP H	£ 12.90	£ 12.62	£ 14.70
AT SGD H	SGD 12.18	SGD 11.89	SGD 13.74
AX	\$ 5.96	\$ 5.81	\$ 6.68
B2X	\$ 12.20	\$ 11.58	\$ 12.56
BA	\$ 10.27	\$ 10.14	\$ 11.95
BAAUD H	AUD 9.95	AUD 9.85	AUD 11.82
BA ZAR H	R 68.55	R 67.40	R 80.50
BX	\$ 5.96	\$ 5.81	\$ 6.68
C	\$ 12.31	\$ 12.01	\$ 13.79
C2	\$ 17.40	\$ 16.51	\$ 17.92
C2X	\$ 17.23	\$ 16.35	\$ 17.73

## Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2021 (ungeprüft)	31. August 2020	31. August 2019
CX .....	\$ 5.96	\$ 5.81	\$ 6.68
I .....	\$ 12.30	\$ 12.01	\$ 13.80
I2 .....	\$ 18.68	\$ 17.65	\$ 18.96
I2 EUR H .....	€ 14.67	€ 13.93	€ 15.39
I2X .....	\$ 11.49	\$ 10.85	\$ 11.65
IT EUR H .....	€ 13.01	€ 12.71	€ 14.72
IX .....	\$ 5.96	\$ 5.81	\$ 6.68
N2 .....	\$ 15.17	\$ 14.40	\$ 15.65
NT .....	\$ 13.12	\$ 12.80	\$ 14.69
S .....	\$ 12.26	\$ 11.97	\$ 13.78
S1 .....	\$ 17.36	\$ 16.38	\$ 17.57
S1 EUR H .....	€ 95.73	€ 90.81	N/A
S1 JPY .....	¥ 9,745.00	¥ 9,138.00	¥ 9,831.00
S1X .....	\$ 5.96	\$ 5.81	\$ 6.68
SA .....	\$ 80.69	\$ 78.76	\$ 90.64
A – EUR * .....	€ 10.19	€ 10.06	€ 12.54
A2 – EUR * .....	€ 14.90	€ 14.27	€ 16.74
A2X – EUR * .....	€ 10.66	€ 10.22	€ 11.97
AT – EUR * .....	€ 10.21	€ 10.08	€ 12.57
AX – EUR * .....	€ 4.94	€ 4.87	€ 6.08
B2X – EUR * .....	€ 10.11	€ 9.71	€ 11.43
BX – EUR * .....	€ 4.94	€ 4.87	€ 6.08
C – EUR * .....	€ 10.20	€ 10.07	€ 12.55
C2X – EUR * .....	€ 14.27	€ 13.70	€ 16.13
CX – EUR * .....	€ 4.94	€ 4.87	€ 6.08
I – EUR * .....	€ 10.19	€ 10.07	€ 12.56
I2 – EUR * .....	€ 15.48	€ 14.79	€ 17.25
I2X – EUR * .....	€ 9.52	€ 9.09	€ 10.60
IX – EUR * .....	€ 4.94	€ 4.87	€ 6.08
S – EUR * .....	€ 10.16	€ 10.03	€ 12.54
S1 – EUR * .....	€ 14.38	€ 13.73	€ 15.99
S1X – EUR * .....	€ 4.94	€ 4.87	€ 6.08

\* Nur für Informationszwecke.

- (1) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem abschließenden NAV von \$19.69
- (2) Aufgelöst am 19. Februar 2021 mit einem abschließenden NAV von ¥12,350.00
- (3) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem abschließenden NAV von CAD12.12
- (4) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem abschließenden NAV von \$6.16
- (5) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem abschließenden NAV von \$14.68

**ANMERKUNG A: Allgemeine Informationen**

AB FCPI (der „Fonds“) ist ein offener Investmentfonds (*fonds commun de placement*), der gemäß den Gesetzen des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde und gemäß Teil 1 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 (in der jeweils gültigen Fassung) über Organismen für gemeinsame Anlagen eingetragen ist („das Gesetz von 2010“). Der Fonds wird im Interesse der Mitinhaber (die „Anteilhaber“) von AllianceBernstein (Luxemburg) S.à r.l. (die „Verwaltungsgesellschaft“) verwaltet, einem Unternehmen, das gemäß den Gesetzen des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde und seinen eingetragenen Sitz in Luxemburg hat. Der Fonds erfüllt die Voraussetzungen eines Organismus zur gemeinsamen Anlage in übertragbare Wertpapiere („OGAW“) im Sinne der Bedeutung von Artikel 1(2) der EG-Richtlinie 2009/65 vom 13. Juli 2009 (in der jeweils gültigen Fassung).

Der Fonds besteht aus getrennten Anlagevermögen mit derzeit 15 aktiven Portefeuilles (einzeln das „Portefeuille“ und zusammengekommen die „Portefeuilles“). Jede Anteilklasse stellt eine Beteiligung an den Anlagewertpapieren sowie anderen

Nettovermögenswerten des entsprechenden Portefeuilles dar. Alle Anteile einer Klasse haben dieselben Rechte in Bezug auf Ausschüttungen und Rücknahmen.

Ab Ende 2019 und auch bis 2021 weitete sich der Ausbruch des neuen Coronavirus, das eine als COVID-19 bekannte Krankheit verursacht, zu einer globalen Pandemie aus. Die zunehmenden Turbulenzen aufgrund der Ausbreitung des Coronavirus und das Potenzial für dauerhafte und erhebliche negative Auswirkungen auf die Weltwirtschaft haben zu einer erhöhten Marktvolatilität geführt, die sich im weiteren Verlauf der Pandemie und ihrer Folgen wiederholen kann.

Der Verwaltungsrat des Fonds (der „Verwaltungsrat“) wird die Entwicklung der Lage und ihre Auswirkung auf die finanzielle Situation der Portefeuilles weiter überwachen und die operativen Pläne entsprechend anpassen, wenn die Situation dies erfordert.

Die folgende Tabelle zeigt den Beginn der Geschäftstätigkeit der einzelnen Portefeuilles sowie die zum 28. Februar 2021 angebotenen Anteilklassen:

<b>AB FCPI-</b>	<b>Geschäftsaufnahme</b>	<b>Angebote Anteilklassen</b>
Dynamic Diversified Portfolio . . . . .	2. November 2004	A, A EUR H, AX, BX, C, C EUR H, CX, I, I EUR H, IX & S1 EUR H
Global Equity Blend Portfolio . . . . .	1. September 2003	A, A EUR H, B, C, I, S & S1
Global Value Portfolio . . . . .	1. Juni 2006	A, A SGD H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR H, AD GBP H, AD SGD H, AD ZAR H, B, BD, BD AUD H, BD EUR H, BD ZAR H, C, I, S, S GBP H, S1 & SD
Emerging Markets Growth Portfolio . . . . .	30. Oktober 1992	A, A AUD H, A PLN H, A SGD H, AD, B, C, C AUD H, ED, I, I AUD H, N, S & S1
Sustainable US Thematic Portfolio . . . . .	1. Juni 2006	A, A AUD H, A CAD H, A EUR H, A GBP H, A SGD H, AN, B, C, C EUR H, I, I EUR H, I GBP, IN, S, S1 & S1 JPY H
Asia Ex-Japan Equity Portfolio . . . . .	30. November 2009	A, A AUD H, A SGD H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR H, AD GBP H, AD NZD H, AD RMB H, AD SGD H, AD ZAR H, AY JPY, BD, BD AUD H, BD CAD H, BD GBP H, BD NZD H, BD ZAR H, BY JPY, C, C AUD H, ED, I, I AUD H, I GBP, ID, ID AUD H, S, S1 & SD
Japan Strategic Value Portfolio . . . . .	15. Dezember 2005	A, A AUD H, A CZK H, A EUR H, A NZD H, A SGD H, A USD H, AD, AD AUD H, AD NZD H, AD USD H, AD ZAR H, B, BD, BD AUD H, BD USD H, BD ZAR H, C, C EUR H, I, I EUR H, I USD H, S EUR H, S1, S1 USD H & SD
China Low Volatility Equity Portfolio . . . . .	1. Februar 2007	A, A PLN H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR H, AD GBP H, AD NZD H, AD RMB H, AD SGD H, AD ZAR H, B, BD, BD AUD H, BD EUR H, BD NZD H, BD ZAR H, C, I, S & S1
Short Duration Bond Portfolio . . . . .	16. September 1996	A, A2, A2 EUR H, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA GBP H, AA NZD H, AA SGD H, AJ, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR H, AT GBP H, AT NZD H, AT SGD H, AX, B, B2, BA, BT, BT AUD H, BT GBP H, C, C2, C2 EUR H, I, I2, I2 AUD H, I2 EUR H, IT, IT AUD H, N2, NT, S, S EUR H, S SGD H, S1 2, S1 EUR H & SA

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angeborene Anteilklassen
Global High Yield Portfolio . . . . .	22. September 1997	A, A2, A2 CHF H, A2 EUR H, A2 PLN H, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA EUR H, AA GBP H, AA NZD H, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AK, AK EUR H, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR H, AT GBP H, AT NZD H, AT RMB H, AT SGD H, B, B2, B2 EUR H, BA, BA AUD H, BA ZAR H, BT, BT AUD H, BT CAD H, BT EUR H, BT GBP H, BT NZD H, C, C2, C2 EUR H, CK, CK EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, I, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 EUR H, I2 SGD H, IA AUD H, IQD, IT, IT AUD H, IT CAD H, IT EUR H, IT GBP H, IT NZD H, IT RMB H, J, N2, NT, S EUR H, S1, S1D, SA, SHK, SK, SQ, W, W2, W2 CHF H, W2 EUR H, WT, WT AUD H, WT CAD H, WT EUR H, WT GBP H & WT RMB H
American Income Portfolio . . . . .	1. Juli 1993	A, A2, A2 CHF H, A2 DUR PH, A2 EUR H, A2 PLN H, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA DUR PH, AA EUR H, AA GBP H, AA NZD H, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AK, AK EUR H, AR EUR, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT DUR PH, AT EUR H, AT GBP H, AT NZD H, AT RMB H, AT SGD H, B, B2, BA, BA AUD H, BA ZAR H, BT, BT AUD H, BT CAD H, BT EUR H, BT GBP H, BT NZD H, C, C2, C2 DUR PH, C2 EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, I, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 DUR PH, I2 EUR H, I2 SGD H, IA, IA AUD H, IT, IT AUD H, IT CAD H, IT EUR H, IT GBP H, IT JPY, IT JPY H, IT NZD H, IT RMB H, IT SGD H, J, L2, L2 AUD H, L2 SGD H, LT, LT AUD H, LT SGD H, N2, NT, S, S1, S1D, S1D2, SA, SHK, W, W2, W2 CHF H, W2 EUR H, WT, WT AUD H, WT EUR H, WT GBP H & WT SGD H
European Income Portfolio . . . . .	26. Februar 1999	A, A2, A2 CHF H, A2 PLN H, A2 SGD H, A2 USD H, AA, AA AUD H, AA HKD H, AA RMB H, AA SGD H, AA USD H, AK, AR, AT, AT AUD H, AT SGD H, AT USD H, B, B2, BA, BA AUD H, BA USD H, BT, BT AUD H, BT USD H, C, C2, C2 USD H, CK, CT USD H, I, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 USD H, IA, IA HKD H, IA SGD H, IA USD H, IT, IT SGD H, IT USD H, NT USD H, S, S1, S1 USD H, S1D, SA USD H, SHK, W2, W2 CHF H, W2 USD H, WA, WA HKD H, WA USD H, WT, WT SGD H & WT USD H

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angebote Anteilklassen
Emerging Markets Debt Portfolio . . . . .	23. März 2006	A, A2, A2 CHF H, A2 EUR H, A2 PLN H, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA EUR H, AA GBP H, AA NZD H, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AR EUR, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR H, AT GBP H, AT NZD H, AT RMB H, AT SGD H, B2, BA, BA AUD H, BA ZAR H, BT, BT AUD H, BT CAD H, BT EUR H, BT GBP H, BT NZD H, C, C2, C2 EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, I, I2, I2 CHF H, I2 EUR H, IT, IT AUD H, IT EUR H, IT SGD H, N2, NT, S, S EUR H, S GBP H, S1 2, S1 EUR H, S1 GBP H, S1QD EUR H & SA
Mortgage Income Portfolio . . . . .	27. September 1994	A, A2, A2X, AA, AA AUD H, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT GBP H, AT SGD H, AX, B2X, BA, BA AUD H, BA ZAR H, BX, C, C2, C2X, CX, I, I2, I2 EUR H, I2X, IT EUR H, IX, N2, NT, S, S1, S1 EUR H, S1 JPY, S1X & SA

**ANMERKUNG B: Relevante Bilanzierungsgrundsätze**

Der Halbjahresabschluss wurde in Übereinstimmung mit den gesetzlichen und aufsichtsbehördlichen Bestimmungen in Luxemburg erstellt. Es folgt eine Zusammenfassung der relevanten Bilanzierungsgrundsätze der Portefeuilles.

**1. Bewertung**

**1.1 Anlagen in Wertpapiere**

An einer Börse notierte oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere werden zum zuletzt verfügbaren Kurs an dieser Börse bzw. diesem Markt oder, wenn dieser Kurs nicht verfügbar ist, zum Mittelwert aus dem an dem entsprechenden Tag notierten Geld- und Briefkurs bewertet. Wenn ein Wertpapier an mehreren Börsen oder Märkten notiert ist, wird der zuletzt verfügbare Kurs an der Börse bzw. dem Markt, die/der den Primärmarkt für dieses Wertpapier darstellt, zugrunde gelegt.

Außerbörslich gehandelte Wertpapiere, einschließlich Wertpapieren, die an einer Börse notiert sind, deren Primärmarkt als außerbörslich betrachtet wird (jedoch mit Ausnahme von Wertpapieren, die am Nasdaq Stock Market, Inc. („NASDAQ“) gehandelt werden), werden mit dem Mittelwert der aktuellen Geld- und Briefkurse bewertet. An der NASDAQ gehandelte Wertpapiere werden gemäß dem offiziellen NASDAQ-Schlusskurs bewertet.

Wertpapiere werden zu ihrem aktuellen Marktwert auf Basis der Marktnotierungen oder, wenn keine Marktnotierungen verfügbar sind oder diese als unzuverlässig gelten, zum „angemessenen Marktwert“ entsprechend den Verfahren bewertet, die vom und unter der allgemeinen Aufsicht des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“) der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden. Angemessene Bewertungsverfahren sollen die Schlusskurse der Wertpapiere des Portefeuilles so berichtigen, dass sie den zum Bewertungszeitpunkt des Portefeuilles als angemessen erachteten Wert jener Wertpapiere widerspiegeln.

Wenn hinsichtlich eines bestimmten Portefeuille-Wertpapiers Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts eingesetzt

werden, können eine Reihe objektiver und subjektiver Faktoren berücksichtigt werden, darunter z. B. Entwicklungen seit der letzten Kursnotierung des Wertpapiers, die sich auf das Wertpapier bzw. auf einen gesamten Markt auswirken, aktuelle Bewertungen entsprechender Aktienindizes oder Äußerungen bestimmter Regierungsbehörden. Soweit verfügbar, können die angemessenen Werte verwendet werden, die von den Bewertungsmodellen dritter Händler ermittelt werden. Wenn Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts eingesetzt werden, können die Kurse einzelner Portefeuille-Wertpapiere, die zur Berechnung des Nettoinventarwerts („NAV“) des Portefeuilles verwendet werden, daher von den notierten oder veröffentlichten Kursen derselben Wertpapiere abweichen. Derzeit werden Marktwertanpassungen nur bei bestimmten Aktienwerten und Terminkontrakten vorgenommen.

Dementsprechend kann der Preis eines Portefeuille-Wertpapiers, der durch Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts ermittelt wurde, genau wie ein früher notierter Börsenkurs bedeutend von dem Preis abweichen, der beim Verkauf dieses Wertpapiers erzielt wurde.

Im Hinblick auf Portefeuille-Wertpapiere, die vorwiegend an US-Börsen gehandelt werden, wird erwartet, dass Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts nur unter sehr eingeschränkten Umständen eingesetzt werden, z. B. wenn eine Börse, an der ein bestimmtes Wertpapier gehandelt wird, frühzeitig geschlossen wird oder wenn der Handel mit einem bestimmten Wertpapier ausgesetzt wird. Es wird jedoch erwartet, dass Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts im Hinblick auf Wertpapiere, die an Börsen außerhalb der USA oder anderen Märkten gehandelt werden, insbesondere an europäischen und asiatischen Märkten, mit Ausnahme von Indien, regelmäßig eingesetzt werden, da diese Märkte u. a. weit vor dem Bewertungszeitpunkt des Portefeuilles schließen. Zwischen dem Schließen dieser Märkte und dem jeweiligen Bewertungszeitpunkt des Portefeuilles können bedeutende Ereignisse, darunter umfassende Marktbewegungen, eintreten.



Insbesondere können Ereignisse auf dem US-Markt, die an einem Handelstag nach dem Schließen dieser anderen Märkte eintreten, den Wert der Portfeuille-Wertpapiere beeinflussen. Das Japan Strategic Value Portfolio und das Asia Ex-Japan Equity Portfolio verfolgen die Politik, Wertpapiere nur dann zum Marktwert zu bewerten, wenn dies auf Basis der Wertentwicklung der Benchmark und der relativen Aktienkapitalflüsse relevant erscheint.

Rententitel (i), Wertpapiere, die an keiner Börse notiert sind oder an keinem geregelten Markt gehandelt werden (ii), und Wertpapiere, die an einer Börse oder einem geregelten Markt nur sehr schwach gehandelt werden (iii), werden zum letzten Angebotskurs bewertet, der von den Hauptmarktmachern bereitgestellt wird. Ist ein solcher Marktkurs nicht verfügbar oder entspricht ein solcher Marktkurs nicht dem angemessenen Marktwert eines Wertpapiers, wird das Wertpapier auf eine Weise bewertet, die entsprechend den Verfahren, die vom und unter der allgemeinen Aufsicht des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden, den angemessenen Wert widerspiegelt.

US-Staatstitel und alle anderen Schuldinstrumente, die eine Restlaufzeit von 60 Tagen oder weniger besitzen, werden im Allgemeinen von einem unabhängigen Kursdienst zum Marktwert bewertet, sofern ein Marktpreis zur Verfügung steht. Wenn kein Marktpreis zur Verfügung steht, werden die Wertpapiere zu den fortgeführten Anschaffungskosten bewertet. Diese Methode wird häufig für kurzfristige Wertpapiere eingesetzt, die eine ursprüngliche Laufzeit von 60 Tagen oder weniger besitzen, sowie für kurzfristige Wertpapiere, die eine ursprüngliche Laufzeit von über 60 Tagen besaßen. In Fällen, in denen die fortgeführten Anschaffungskosten angesetzt werden, muss der Bewertungsausschuss des Anlageverwalters (der „Ausschuss“) nachvollziehbar zu dem Schluss kommen, dass die Ansetzung der fortgeführten Anschaffungskosten in etwa dem Marktwert des Wertpapiers entspricht. Faktoren, die der Ausschuss dabei berücksichtigt, sind insbesondere eine Minderung der Kreditwürdigkeit des Emittenten oder wesentliche Änderungen bei den Zinssätzen. Die Beschlüsse des Ausschusses werden in Übereinstimmung mit Verfahren gefasst, die vom und unter der allgemeinen Aufsicht des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.

Im Freiverkehr gehandelte Swaps („OTC-Swaps“) und andere Derivate werden täglich bewertet, überwiegend unter Rückgriff auf unabhängige Kursdienste, unabhängige Bewertungsmodelle auf der Grundlage von Marktdaten und dritte Broker-Dealer oder Gegenparteien.

### 1.2 Bewertung von Optionsscheinen

Börsennotierte Optionsscheine werden zu dem von genehmigten Verkäufern bereitgestellten letztverfügbaren Kurs bewertet. Kommt es an dem betreffenden Geschäftstag zu keinem Verkauf, dann wird der Optionsschein zum letztverfügbaren Kurs des Vortages bewertet. An den darauffolgenden Tagen wird das Wertpapier nach bestem Wissen und Gewissen zum angemessenen Marktwert bewertet. Sämtliche nicht börsennotierten Optionsscheine werden nach bestem Wissen und Gewissen zum angemessenen Marktwert bewertet. Sobald ein Optionsschein abgelaufen ist, wird er nicht mehr bewertet.

### 1.3 Finanzterminkontrakte

Beim Abschluss von Finanzterminkontrakten werden Einschusszahlungen geleistet. Solange der Terminkontrakt

offen ist, werden die Veränderungen des Kontraktwerts als unrealisierte Gewinne oder Verluste verbucht, indem täglich Neubewertungen vorgenommen werden, um den Marktwert des Kontrakts am Ende jedes Handelstages widerzuspiegeln. Je nachdem, ob unrealisierte Verluste oder Gewinne erzielt werden, werden Nachschusszahlungen geleistet oder erhalten. Wenn der Kontrakt glattgestellt wird, wird ein realisierter Gewinn oder Verlust verbucht. Dieser realisierte Gewinn oder Verlust entspricht der Differenz zwischen dem Erlös (oder den Kosten) der Glattstellungstransaktion und der Basis des Fonds im Kontrakt.

Offene Terminkontrakte werden anhand des Glattstellungskurses oder, wenn dieser nicht verfügbar ist, anhand des letzten notierten Angebotskurses bewertet. Wenn keine Notierungen für den Bewertungstag vorliegen, wird der letzte verfügbare Glattstellungskurs benutzt.

### 1.4 Devisentermingeschäfte

Der unrealisierte Gewinn oder Verlust aus offenen Devisentermingeschäften wird als Differenz zwischen dem vertraglich vereinbarten Satz und dem Glattstellungssatz des Kontrakts berechnet. Die realisierten Gewinne oder Verluste beinhalten Nettogewinne oder -verluste aus Devisentermingeschäften, die durch andere Kontrakte mit demselben Kontrahenten beglichen oder verrechnet wurden.

### 1.5 Gekaufte und verkaufte Optionen

Wenn eine Option gekauft wird, wird ein dem bezahlten Preis entsprechender Betrag als Anlage verbucht und im Folgenden dem aktuellen Marktwert der gekauften Option angepasst. Der Preis, der für den Kauf von Optionen bezahlt wurde, die verfallen, ohne ausgeübt zu werden, wird am Verfallsdatum als realisierter Verlust verbucht. Wenn eine gekaufte Verkaufsoption ausgeübt wird, wird der Optionspreis vom Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung abgezogen, um festzustellen, ob das jeweilige Portfeuille einen Gewinn oder Verlust realisiert hat. Wenn eine gekaufte Kaufoption ausgeübt wird, erhöht der Optionspreis die Kostenbasis des Wertpapiers oder der vom jeweiligen Portfeuille gekauften Fremdwährung. Wenn eine Option verkauft wird, wird ein dem erhaltenen Preis entsprechender Betrag als Verbindlichkeit verbucht und im Folgenden dem aktuellen Marktwert der verkauften Option angepasst. Der Preis, der für verkaufte Optionen erhalten wird, die verfallen, ohne ausgeübt zu werden, wird vom jeweiligen Portfeuille am Verfallsdatum als realisierter Gewinn verbucht. Wenn eine verkaufte Kaufoption ausgeübt wird, wird der Preis zum Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung hinzuaddiert, um festzustellen, ob das jeweilige Portfeuille einen Gewinn oder Verlust realisiert hat. Wenn eine verkaufte Verkaufsoption ausgeübt wird, senkt der Optionspreis die Kostenbasis des vom jeweiligen Portfeuille gekauften Wertpapiers oder der Fremdwährung. Börsennotierte Kauf- und Verkaufsoptionen eines Portfeuillees werden zum letzten Verkaufspreis bewertet. Falls an dem Tag kein Verkauf stattgefunden hat, werden die Wertpapiere zum letzten Rücknahmepreis an dem Tag bewertet.

### 1.6 Anlagen in anderen Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“)

Anlagen in anderen OGA werden auf Grundlage des letzten verfügbaren NAV des betreffenden OGA bewertet.



### 1.7 Swap-Vereinbarungen

Für Zwischenzahlungen auf Swap-Kontrakte nehmen die Portefeuilles täglich Rückstellungen innerhalb der Erträge und Aufwendungen vor. Swap-Kontrakte werden täglich zum letzten Börsenkurs bewertet, wobei Wertschwankungen in der Zusammensetzung des Fondsvermögens als „Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung) aus Swaps“ und in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens als „Änderung der unrealisierten Gewinne und Verluste aus Swaps“ ausgewiesen werden. Bei Fälligkeit oder Verkauf eines Swap-Kontrakts wird der Nettobetrag unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Swaps“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens erfasst. Die bezahlten oder erhaltenen Vorabgebühren werden in der Zusammensetzung des Fondsvermögens als Kosten oder Erlöse ausgewiesen und über die Laufzeit des Kontrakts linear abgeschrieben. Aufgelaufene, abgeschriebene Vorabgebühren für Credit-Default-Swaps sind solange im Swap-Ertrag enthalten, bis die Position verkauft wird, danach werden die abgeschriebenen Vorabgebühren unter „Realisierte Nettogewinne und (-verluste) aus Swaps“ verbucht. Bei allen anderen Swap-Arten werden die abgeschriebenen Vorabgebühren unter „Realisierte Nettogewinne und (-verluste) aus Swaps“ ausgewiesen. Schwankungen des Werts von Swap-Kontrakten werden als eine Komponente der „Änderungen der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesen.

In der Zusammensetzung des Fondsvermögens ausgewiesene „Für Swap-Kontrakte bezahlte (erhaltene) Vorabgebühren“ enthalten im Freiverkehr für Credit-Default-Swaps bezahlte (erhaltene) Gebühren sowie eine Marge, die noch für die zentral abgerechneten Credit-Default-Swaps beglichen werden muss.

### 2. Gründungskosten

Die Gründungskosten aller bestehenden Portefeuilles wurden in früheren Jahren vollständig abgeschrieben.

### 3. Zuteilungsmethode

Die Erträge und Aufwendungen (mit Ausnahme der klassenspezifischen Verwaltungs- und Vertriebsgebühren) der „Renten“- und „Misch“-Portefeuilles werden täglich auf Basis einer „gemischten Zuteilungs-Rechnung“ zugewiesen. Diese Zuteilungs-Rechnung basiert auf dem prozentualen Verhältnis zwischen dem Wert der abgerechneten Anteile einer Anteilklasse mit täglicher Feststellung einer Ausschüttung und dem Wert der umlaufenden Anteile, die entweder auf monatlicher Basis Ausschüttungen ausbezahlen oder keine Ausschüttungen tätigen. Erträge und Aufwendungen der „Aktien“-Portefeuilles des Fonds werden täglich auf Basis ihres prozentualen Verhältnisses nach dem Wert ihrer umlaufenden Anteile zugewiesen. Für alle Portefeuilles werden die realisierten und unrealisierten Gewinne und Verluste des Fonds täglich auf Basis ihres prozentualen Verhältnisses nach dem Wert ihrer umlaufenden Anteile zugewiesen. Klassenspezifische Verwaltungs-, Verwaltungsgesellschafts- und Vertriebsgebühren sowie unrealisierte Gewinne und Verluste aus Devisentermingeschäften, die sich auf die währungsabgesicherten Anteilklassen beziehen, werden der jeweiligen Anteilklasse direkt berechnet/zugewiesen.

Aufgrund des stark institutionellen Charakters aller Arten von Anteilen der Klasse S der Portefeuilles werden bestimmte Kosten des Fonds auf Grundlage der minimalen Aktivität der Anteilhaber und Anforderungen des Kontostandes ggf. den

entsprechenden Anteilen der Klasse S zugewiesen.

### 4. Währungsumrechnung

Werte, die in einer anderen Währung ausgedrückt sind als der Währung, in der das Portefeuille laut Vertragsbedingungen denominiert ist, werden unter Anwendung des Mittelwerts zwischen dem letzten erhältlichen Kauf- und Verkaufspreis umgerechnet. Transaktionen in Fremdwährungen werden zu dem am Transaktionsdatum geltenden Wechselkurs in die Währung des jeweiligen Portefeuilles umgerechnet.

Die kombinierte Zusammensetzung des Fondsvermögens wird in US-Dollar zu den am Datum der kombinierten Zusammensetzung des Fondsvermögens geltenden Wechselkursen dargestellt, während die kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens in US-Dollar zu den durchschnittlichen, während des Berichtszeitraums geltenden Wechselkursen dargestellt wird.

Dem Halbjahresabschluss wurden folgende Kurse zugrunde gelegt: Kassakurs von 1.2070 und Mittelkurs von 1.1971 für die Umrechnung von EUR in USD, Kassakurs von 0.0094 und Mittelkurs von 0.0096 für die Umrechnung von JPY in USD.

Die in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesene „Anpassung aus Währungsumrechnung“ ergibt sich aus den unterschiedlichen Wechselkursen, die zur Umrechnung des kombinierten Nettovermögens zu Beginn des Jahres, der kombinierten Zusammensetzung des Fondsvermögens und der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens verwendet wurden.

### 5. Anlageerträge und Anlagetransaktionen

Dividenerträge werden am Tag der Notierung ex Dividende verbucht. Zinserträge werden tagesgenau verbucht. Die Anlagegewinne und -verluste für die Portefeuilles werden anhand der durchschnittlichen Kostenbasis festgestellt.

Der Fonds verbucht Disagios und amortisiert Prämien als Wertberichtigungen der Zinserträge. Anlagegeschäfte werden am Transaktionstag zuzüglich eines Tages verbucht.

### 6. Schätzungen

Bei der Erstellung des Abschlusses im Einklang mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen muss die Fondsverwaltung Schätzungen und Annahmen erstellen, die sich auf den Betrag der berichteten Aktiva und Passiva und die Offenlegung der Eventualaktiva und -passiva zum Zeitpunkt des Halbjahresabschlusses sowie die berichteten Einnahmen und Auslagen während des Berichtszeitraums auswirken. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen.

### 7. Swing Pricing-Anpassung (Die folgenden Ausführungen gelten für alle Portefeuilles, mit Ausnahme des Global Equity Blend Portfolio, des Global Value Portfolio und Short Duration Bond Portfolio)

Die Verwaltungsgesellschaft des Fonds hat allen Anteilhabern der Portefeuilles mitgeteilt, dass mit Wirkung vom 2. November 2015 eine Richtlinie zur Anpassung des Nettoinventarwerts (NAV) eingeführt wird, die auch als „Swing Pricing“ bekannt ist. Gemäß dieser Richtlinie kann der NAV eines Portefeuilles angepasst werden, um die Auswirkungen der geschätzten Transaktionskosten, Preisabschläge und Gebühren, die durch die Kauf- und Rücknahmeaktivitäten der Anteilhaber

entstehen, widerzuspiegeln. Swing Pricing kommt automatisch zur Anwendung, wenn die täglichen Nettozeichnungen oder -rücknahmen einen Schwellenwert überschreiten, der vom Swing-Pricing-Komitee unter Aufsicht des Verwaltungsrats festgelegt wurde. Wenn Swing Pricing zur Anwendung kommt, wird der NAV der Anteile des jeweiligen Portefeuilles um einen Betrag nach oben oder unten korrigiert, der im Allgemeinen höchstens 2% des jeweiligen NAV entspricht, so dass die Transaktionskosten, die aufgrund der Kauf- und Rücknahmeaktivität entstehen, nicht vom Portefeuille selbst, sondern von den Anlegern getragen werden, die mit den Portefeuilleanteilen handeln. Diese Anpassung soll die Verwässerung des Werts der Anteilinhaber-Investitionen in Anteile eines Portefeuilles, die durch Transaktionen mit Portefeuilleanteilen hervorgerufen wird, minimieren.

Die jüngsten und beispiellosen Bedingungen an den Finanzmärkten im Zusammenhang mit der COVID-19-Krise führten zu einer Weitung der Geld-Brief-Spannen bei bestimmten Wertpapieren und folglich zu höheren Transaktionskosten für den Fonds. Das Swing-Pricing-Komitee ist der Ansicht, dass die aktuellen allgemeinen Swing-Pricing-Schwellenwerte von bis zu 2% für den Fonds möglicherweise die erwarteten Kosten im Zusammenhang mit den Preisen für die Handelsabwicklung nicht angemessen widerspiegeln und daher die Interessen der Anteilinhaber des Fonds im Falle von Rücknahme-

und Zeichnungsaktivitäten möglicherweise nicht vollständig schützen. Der Verwaltungsrat hat im Einklang mit den „CSSF-FAQ zum Swing-Pricing-Mechanismus“ beschlossen, dem Swing-Pricing-Komitee die Möglichkeit einzuräumen, über den Schwellenwert für Swing Pricing hinauszugehen, je nachdem, wie es dies für die Portefeuilles für angemessen hält, um sicherzustellen, dass die übrigen Anteilinhaber des Fonds nicht von den derzeitigen Transaktionskosten im Zusammenhang mit der COVID-19-Krise beeinträchtigt werden.

Der in den statistischen Angaben offengelegte NAV je Anteil und das Gesamtnettvermögen sind der veröffentlichte NAV je Anteil und das Gesamtnettvermögen, wohingegen das in der Zusammensetzung des Fondsvermögens sowie in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesene Gesamtnettvermögen der Gesamt-NAV ohne Swing-Anpassungen zum Ende eines Berichtszeitraums ist.

Alle Portefeuilles, die dem Swing Pricing unterliegen, wendeten während des Berichtszeitraums den Swing-Pricing-Mechanismus auf den NAV an. Zum 28. Februar 2021 wendeten die folgenden Portefeuilles den Swing-Pricing-Mechanismus auf den NAV an:

- Japan Strategic Value Portfolio.
- Mortgage Income Portfolio.

#### ANMERKUNG C: Steuern

Als Luxemburger *fonds commun de placement* (offener Investmentfonds) unterliegt der Fonds in Luxemburg nach den derzeit geltenden Steuergesetzen keiner Einkommen-, Quellen- oder Kapitalertragsteuer. Der Fonds unterliegt der Luxemburger *taxe d'abonnement* von 0.05% pro Jahr, die vierteljährlich auf Grundlage des Gesamtnettvermögens am letzten Tag jedes Quartals errechnet und entrichtet wird. Der Satz liegt bei 0.01% für Anteilklassen, die institutionellen Anlegern vorbehalten sind, wie gemäß Artikel 174 des Gesetzes von 2010 definiert.

Auf Zinsen, Dividenden und Kursgewinne aus Wertpapieren werden unter Umständen in gewissen Ländern Quellen- oder Kapitalertragsteuern erhoben.

Im Zusammenhang mit einer Anlage eines Portefeuilles in einem separaten Portefeuille wird der Betrag der „*taxe d'abonnement*“, der dem Anteil des Portefeuilles an der innerhalb der jeweiligen Anteilklasse des separaten Portefeuilles anfallenden „*taxe d'abonnement*“ entspricht, erlassen.

#### ANMERKUNG D: Ausschüttungen

Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt derzeit nicht, auf die Anteile des Global Equity Blend Portfolio Dividenden auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das Dynamic Diversified Portfolio:

- Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Ausschüttungen können aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.
- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S, S1, SP, S1P, AX, BX, CX und IX (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Netto-

gewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das Global Value Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S, S1, SA GB, SB GB, S1A GB und S1B GB (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD, BD und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Emerging Markets Growth Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, N, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD und ED (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Sustainable US Thematic Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, AN, B, C, E, I, IN, S, S1, S1A GB und S1B GB (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen INN und SINN beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, eine jährliche Dividende zu erklären und auszuschütten, die in der Regel sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entspricht, die diesen Anteilklassen zuzuschreiben sind.
- Für Anteile der Klasse AD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Asia Ex-Japan Equity Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AY und BY kann die Verwaltungsgesellschaft im eigenen Ermessen auf Grundlage der Nettoerträge, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind, Dividenden erklären und ausschütten.

- Für Anteile der Klassen AD, BD, ED, ID und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Japan Strategic Value Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S, S1 und 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD, BD und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das China Low Volatility Equity Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S und S1 beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD und BD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Short Duration Bond Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, AX, B, BX, C, I, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H, sofern



nicht anders angegeben) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.

- Für Anteile der Klassen AJ, AT, BT, CT, IT und NT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, BA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, I2, N2, S 2 und S1 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) und Anteile der Klassen S EUR H, S1 EUR H und S SGD H beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das Global High Yield Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, JA, J und W (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, NT, S1D, S1D2 und WT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen IQD und S1QD beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind. Für Anteile der Klasse SK kann die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem Ermessen Dividenden erklären und ausschütten.

- Für Anteile der Klassen AK und CK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, BA, EA, IA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klassen SHK und SQ beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttungen täglich zu erklären und monatlich vorzunehmen. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, I2, N2, S, S1 und W2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das American Income Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, JA, J und W (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, LT, NT, S1D, S1D2 und WT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AK und CK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, BA, EA, IA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klasse SHK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H)

beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttungen täglich zu erklären und monatlich vorzunehmen. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

- Für Anteile der Klasse S1QD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, I2, L2, N2, S, S1 und W2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das European Income Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C und I beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, NT, S1D und WT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AK und CK beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, BA, IA, SA und WA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klasse SHK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttungen täglich zu erklären und monatlich vorzunehmen. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile

der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, I2, S, S1 und W2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das Emerging Markets Debt Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C und I (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, NT und ZT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, BA, EA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen AI und EI (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und möglicherweise in erheblichem Umfang aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten

eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren. Falls der Nettoinventarwert je Anteil unter 1 USD bzw. 1 AUD fällt, wird die Verwaltungsgesellschaft in ihrem alleinigen Ermessen erwägen, entweder (i) die Anteilklasse umzustrukturieren, auch durch die Zusammenlegung mit einer Anteilklasse mit ähnlichen Merkmalen, oder (ii) die Anteilklasse zu liquidieren. Dividenden können auf Wunsch der Anteilinhaber automatisch wiederangelegt werden.

- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, I2, N2, S, S1 und S1 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klasse S1QD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.

Für das Mortgage Income Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, AX, BX, C, CX, I, IX, S und S1X beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, ATX, IT, NT und ZT beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen

des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.

- Für Anteile der Klassen AA, BA, EA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen 1 um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen A2, A2X, B2X, C2, C2X, I2, I2X, N2 und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Die Verwaltungsgesellschaft kann außerdem festlegen, ob und in welchem Maße die bezahlten Dividenden realisierte Kapitalgewinne beinhalten und/oder aus dem Kapital bezahlt werden, das der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen ist. Soweit die Nettoerträge und die realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuweisen sind, den auszuschüttenden Betrag übersteigen, wird die überschüssige Rendite im jeweiligen Nettoinventarwert dieser Anteile widergespiegelt. Dividenden können auf Wunsch der Anteilinhaber automatisch wiederangelegt werden.

#### ANMERKUNG E: Verwaltungsgebühren und andere Transaktionen mit verbundenen Unternehmen

Der Fonds zahlt der Verwaltungsgesellschaft eine Verwaltungsgebühr. Gemäß den Bedingungen des Anlageverwaltungsvertrags zahlt die Verwaltungsgesellschaft AllianceBernstein L.P. (der „Anlageverwalter“) aus der erhaltenen Verwaltungsgebühr eine Anlageverwaltungsgebühr.

Die Verwaltungsgesellschaft hat sich freiwillig bereit erklärt, bestimmte Aufwendungen zu tragen, soweit dies erforderlich ist, um die Gesamtbetriebskosten auf jährlicher Basis zu beschränken.

Diese Beschränkungen wurden wie folgt festgesetzt (die Beschränkungen sind als Prozentsatz des tagesdurchschnittlichen Nettovermögens ausgedrückt):

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Dynamic Diversified		
Portfolio . . . . .	Klasse A	1.95%
	Klasse A EUR H	1.95%
	Klasse AX	1.90%
	Klasse B(a)	2.95%
	Klasse BX	2.90%
	Klasse C	2.25%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Dynamic Diversified		
Portfolio (Fortsetzung) . . . . .	Klasse C EUR H	2.25%
	Klasse CX	2.20%
	Klasse I	1.25%
	Klasse I EUR H	1.25%
	Klasse IX	1.20%
	Klasse S1 EUR H	0.80%
Global Equity Blend		
Portfolio . . . . .	Klasse A	2.10%
	Klasse A EUR H	2.10%
	Klasse B	3.10%
	Klasse C	2.55%
	Klasse I	1.30%
	Klasse S	0.10%
	Klasse S1	0.80%
Global Value Portfolio . . . . .		
	Klasse S	0.12%
	Klasse S GBP H	0.12%
	Klasse S1	0.82%
	Klasse SD	0.12%



AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
Emerging Markets Growth			Japan Strategic Value		
Portfolio .....	Klasse S	0.30%	Portfolio .....	Klasse 2(b)	1.35%
	Klasse S1	1.20%		Klasse A	2.15%
Sustainable US Thematic				Klasse A AUD H	2.15%
Portfolio .....	Klasse A	1.75%		Klasse A CZK H	2.15%
	Klasse A AUD H	1.75%		Klasse A EUR H	2.15%
	Klasse A CAD H	1.75%		Klasse A NZD H	2.15%
	Klasse A EUR H	1.75%		Klasse A SGD H	2.15%
	Klasse A GBP H	1.75%		Klasse A USD H	2.15%
	Klasse A SGD H	1.75%		Klasse AD	2.15%
	Klasse AN	1.75%		Klasse AD AUD H	2.15%
	Klasse B	2.75%		Klasse AD NZD H	2.15%
	Klasse C	2.20%		Klasse AD USD H	2.15%
	Klasse C EUR H	2.20%		Klasse AD ZAR H	2.15%
	Klasse I	0.95%		Klasse B	3.15%
	Klasse I EUR H	0.95%		Klasse BD	3.15%
	Klasse I GBP	0.95%		Klasse BD AUD H	3.15%
	Klasse IN	0.95%		Klasse BD USD H	3.15%
	Klasse S	0.15%		Klasse BD ZAR H	3.15%
	Klasse S1	0.80%		Klasse C	2.60%
	Klasse S1 JPY H	0.80%		Klasse C EUR H	2.60%
Asia Ex-Japan Equity				Klasse I	1.35%
Portfolio .....	Klasse A	2.05%		Klasse I EUR H	1.35%
	Klasse A AUD H	2.05%		Klasse I USD H	1.35%
	Klasse A SGD H	2.05%		Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse AD	2.05%		Klasse S1	0.80%
	Klasse AD AUD H	2.05%		Klasse S1 USD H	0.80%
	Klasse AD CAD H	2.05%		Klasse SD	0.15%
	Klasse AD EUR H	2.05%	China Low Volatility Equity		
	Klasse AD GBP H	2.05%	Portfolio .....	Klasse A	1.99%
	Klasse AD NZD H	2.05%		Klasse A PLN H	1.99%
	Klasse AD RMB H	2.05%		Klasse AD	1.99%
	Klasse AD SGD H	2.05%		Klasse AD AUD H	1.99%
	Klasse AD ZAR H	2.05%		Klasse AD CAD H	1.99%
	Klasse AY JPY	2.05%		Klasse AD EUR H	1.99%
	Klasse BD	3.05%		Klasse AD GBP H	1.99%
	Klasse BD AUD H	3.05%		Klasse AD NZD H	1.99%
	Klasse BD CAD H	3.05%		Klasse AD RMB H	1.99%
	Klasse BD GBP H	3.05%		Klasse AD SGD H	1.99%
	Klasse BD NZD H	3.05%		Klasse AD ZAR H	1.99%
	Klasse BD ZAR H	3.05%		Klasse B	2.99%
	Klasse BY JPY	2.52%		Klasse BD	2.99%
	Klasse C	2.50%		Klasse BD AUD H	2.99%
	Klasse C AUD H	2.50%		Klasse BD EUR H	2.99%
	Klasse ED	3.05%		Klasse BD NZD H	2.99%
	Klasse I	1.25%		Klasse BD ZAR H	2.99%
	Klasse I AUD H	1.25%		Klasse C	2.44%
	Klasse I GBP	1.25%		Klasse I	1.19%
	Klasse ID	1.25%		Klasse S	0.16%
	Klasse ID AUD H	1.25%		Klasse S1	0.91%
	Klasse S	0.30%	Short Duration Bond		
	Klasse S1	1.20%	Portfolio .....	Klasse A	1.20%
	Klasse SD	0.30%		Klasse A2	1.20%
				Klasse A2 EUR H	1.20%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
Short Duration Bond			American Income Portfolio		
Portfolio (Fortsetzung) . . . . .	Klasse A2 SGD H	1.20%	(Fortsetzung) . . . . .	Klasse A2 DUR PH	1.50%
	Klasse AA	1.20%		Klasse A2 EUR H	1.50%
	Klasse AA AUD H	1.20%		Klasse A2 PLN H	1.50%
	Klasse AA CAD H	1.20%		Klasse A2 SGD H	1.50%
	Klasse AA GBP H	1.20%		Klasse AA	1.50%
	Klasse AA NZD H	1.20%		Klasse AA AUD H	1.50%
	Klasse AA SGD H	1.20%		Klasse AA CAD H	1.50%
	Klasse AJ	1.00%		Klasse AA DUR PH	1.50%
	Klasse AR EUR H	1.20%		Klasse AA EUR H	1.50%
	Klasse AT	1.20%		Klasse AA GBP H	1.50%
	Klasse AT AUD H	1.20%		Klasse AA NZD H	1.50%
	Klasse AT CAD H	1.20%		Klasse AA RMB H	1.50%
	Klasse AT EUR H	1.20%		Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse AT GBP H	1.20%		Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse AT NZD H	1.20%		Klasse AK	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.20%		Klasse AK EUR H	1.50%
	Klasse AX	1.00%		Klasse AR EUR	1.50%
	Klasse B	2.20%		Klasse AR EUR H	1.50%
	Klasse B2	2.20%		Klasse AT	1.50%
	Klasse BA	2.20%		Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse BT	2.20%		Klasse AT CAD H	1.50%
	Klasse BT AUD H	2.20%		Klasse AT DUR PH	1.50%
	Klasse BT CAD H(a)	2.20%		Klasse AT EUR H	1.50%
	Klasse BT GBP H	2.20%		Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse BX(a)	1.00%		Klasse AT NZD H	1.50%
	Klasse C	1.60%		Klasse AT RMB H	1.50%
	Klasse C2	1.60%		Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse C2 EUR H	1.60%		Klasse B	2.20%
	Klasse I	0.575%		Klasse B2	2.20%
	Klasse I2	0.575%		Klasse BA	2.20%
	Klasse I2 AUD H	0.575%		Klasse BA AUD H	2.20%
	Klasse I2 EUR H	0.575%		Klasse BA ZAR H	2.20%
	Klasse IT	0.575%		Klasse BT	2.20%
	Klasse IT AUD H	0.575%		Klasse BT AUD H	2.20%
	Klasse N2	1.70%		Klasse BT CAD H	2.20%
	Klasse NT	1.70%		Klasse BT EUR H	2.20%
	Klasse S	0.10%		Klasse BT GBP H	2.20%
	Klasse S EUR H	0.10%		Klasse BT NZD H	2.20%
	Klasse S SGD H	0.10%		Klasse C	1.95%
	Klasse S1 2	0.35%		Klasse C2	1.95%
	Klasse S1 EUR H	0.35%		Klasse C2 DUR PH	1.95%
	Klasse SA	0.10%		Klasse C2 EUR H	1.95%
Global High Yield Portfolio . . . .				Klasse CT	1.95%
	Klasse S EUR H	0.10%		Klasse EA	2.00%
	Klasse S1	1.00%		Klasse EA AUD H	2.00%
	Klasse S1D	1.00%		Klasse EA ZAR H	2.00%
	Klasse SA	0.10%		Klasse I	0.95%
	Klasse SHK	0.10%		Klasse I2	0.95%
	Klasse SK	0.75%		Klasse I2 AUD H	0.95%
	Klasse SQ	0.70%		Klasse I2 CHF H	0.95%
American Income Portfolio . . . .				Klasse I2 DUR PH	0.95%
	Klasse A	1.50%		Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse A2	1.50%		Klasse I2 SGD H	0.95%
	Klasse A2 CHF H	1.50%		Klasse IA	0.95%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
American Income Portfolio			European Income Portfolio		
(Fortsetzung) . . . . .	Klasse IA AUD H	0.95%	(Fortsetzung) . . . . .	Klasse B2	2.11%
	Klasse IT	0.95%		Klasse BA	2.11%
	Klasse IT AUD H	0.95%		Klasse BA AUD H	2.11%
	Klasse IT CAD H	0.95%		Klasse BA USD H	2.11%
	Klasse IT EUR H	0.95%		Klasse BT	2.11%
	Klasse IT GBP H	0.95%		Klasse BT AUD H	2.11%
	Klasse IT JPY	0.95%		Klasse BT USD H	2.11%
	Klasse IT JPY H	0.95%		Klasse C	1.86%
	Klasse IT NZD H	0.95%		Klasse C2	1.86%
	Klasse IT RMB H	0.95%		Klasse C2 USD H	1.86%
	Klasse IT SGD H	0.95%		Klasse CK	1.86%
	Klasse L2	1.05%		Klasse CT USD H	1.86%
	Klasse L2 AUD H	1.05%		Klasse I	0.86%
	Klasse L2 SGD H	1.05%		Klasse I2	0.86%
	Klasse LT	1.05%		Klasse I2 AUD H	0.86%
	Klasse LT AUD H	1.05%		Klasse I2 CHF H	0.86%
	Klasse LT SGD H	1.05%		Klasse I2 USD H	0.86%
	Klasse N2	2.05%		Klasse IA	0.86%
	Klasse NT	2.05%		Klasse IA HKD H	0.86%
	Klasse S	0.15%		Klasse IA SGD H	0.86%
	Klasse S1	0.65%		Klasse IA USD H	0.86%
	Klasse S1D	0.65%		Klasse IT	0.86%
	Klasse S1D2	0.65%		Klasse IT SGD H	0.86%
	Klasse SA	0.15%		Klasse IT USD H	0.86%
	Klasse SHK	0.15%		Klasse NT USD H	1.96%
	Klasse W	0.95%		Klasse S	0.15%
	Klasse W2	0.95%		Klasse S1	0.65%
	Klasse W2 CHF H	0.95%		Klasse S1 USD H	0.65%
	Klasse W2 EUR H	0.95%		Klasse S1D	0.65%
	Klasse WT	0.95%		Klasse SA USD H	0.15%
	Klasse WT AUD H	0.95%		Klasse SHK	0.15%
	Klasse WT EUR H	0.95%		Klasse W2	0.86%
	Klasse WT GBP H	0.95%		Klasse W2 CHF H	0.86%
	Klasse WT SGD H	0.95%		Klasse W2 USD H	0.86%
European Income Portfolio . . . .				Klasse WA	0.86%
	Klasse A	1.41%		Klasse WA HKD H	0.86%
	Klasse A2	1.41%		Klasse WA USD H	0.86%
	Klasse A2 CHF H	1.41%		Klasse WT	0.86%
	Klasse A2 PLN H	1.41%		Klasse WT SGD H	0.86%
	Klasse A2 SGD H	1.41%		Klasse WT USD H	0.86%
	Klasse A2 USD H	1.41%	Emerging Markets Debt		
	Klasse AA	1.41%	Portfolio . . . . .	Klasse A	1.50%
	Klasse AA AUD H	1.41%		Klasse A2	1.50%
	Klasse AA HKD H	1.41%		Klasse A2 CHF H	1.50%
	Klasse AA RMB H	1.41%		Klasse A2 EUR H	1.50%
	Klasse AA SGD H	1.41%		Klasse A2 PLN H	1.50%
	Klasse AA USD H	1.41%		Klasse A2 SGD H	1.50%
	Klasse AK	1.41%		Klasse AA	1.50%
	Klasse AR	1.41%		Klasse AA AUD H	1.50%
	Klasse AT	1.41%		Klasse AA CAD H	1.50%
	Klasse AT AUD H	1.41%		Klasse AA EUR H	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.41%		Klasse AA GBP H	1.50%
	Klasse AT USD H	1.41%		Klasse AA NZD H	1.50%
	Klasse B	2.11%		Klasse AA RMB H	1.50%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Emerging Markets Debt		
Portfolio (Fortsetzung) . . . . .	Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse AR EUR	1.50%
	Klasse AT	1.50%
	Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse AT CAD H	1.50%
	Klasse AT EUR H	1.50%
	Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse AT NZD H	1.50%
	Klasse AT RMB H	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse B(a)	2.50%
	Klasse B2	2.50%
	Klasse BA	2.50%
	Klasse BA AUD H	2.50%
	Klasse BA ZAR H	2.50%
	Klasse BT	2.50%
	Klasse BT AUD H	2.50%
	Klasse BT CAD H	2.50%
	Klasse BT EUR H	2.50%
	Klasse BT GBP H	2.50%
	Klasse BT NZD H	2.50%
	Klasse C	1.95%
	Klasse C2	1.95%
	Klasse C2 EUR H	1.95%
	Klasse CT	1.95%
	Klasse EA	2.00%
	Klasse EA AUD H	2.00%
	Klasse EA ZAR H	2.00%
	Klasse I	0.95%
	Klasse I2	0.95%
	Klasse I2 CHF H	0.95%
	Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse IT	0.95%
	Klasse IT AUD H	0.95%
	Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse IT SGD H	0.95%
	Klasse N2	2.05%
	Klasse NT	2.05%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse S1 2	0.70%
	Klasse S1 EUR H	0.70%
	Klasse S1 GBP H	0.70%
	Klasse S1QD EUR H	0.70%
	Klasse SA	0.15%
Mortgage Income Portfolio . . . . .		
	Klasse A	1.50%
	Klasse A2	1.50%
	Klasse A2X	1.25%
	Klasse AA	1.50%
	Klasse AA AUD H	1.50%
	Klasse AA RMB H	1.50%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Mortgage Income Portfolio		
(Fortsetzung) . . . . .	Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse AR EUR H	1.50%
	Klasse AT	1.50%
	Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse AX	1.25%
	Klasse B2X	1.70%
	Klasse BA	2.50%
	Klasse BA AUD H	2.50%
	Klasse BA ZAR H	2.50%
	Klasse BX	1.70%
	Klasse C	1.95%
	Klasse C2	1.95%
	Klasse C2X	1.70%
	Klasse CX	1.70%
	Klasse I	0.95%
	Klasse I2	0.95%
	Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse I2X	0.70%
	Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse IX	0.70%
	Klasse N2	2.05%
	Klasse NT	2.05%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse S1 JPY	0.65%
	Klasse S1X	0.55%
	Klasse SA	0.15%

(a) Die Anteilklasse wurde am 29. Januar 2021 aufgelöst.

(b) Die Anteilklasse wurde am 19. Februar 2021 aufgelöst.

Folgende Tabelle gibt Aufschluss über die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen während des Berichtszeitraums zum 28. Februar 2021 und die Forderungen aus Aufwandsersatzung zum 28. Februar 2021:

AB FCPI-	Getragene Aufwendungen	Forderungen aus Aufwandsersatzung
Dynamic Diversified Portfolio . . .	\$ 96,473	14,315
Global Equity Blend Portfolio . . .	\$ 13,013	1,616
Asia Ex-Japan Equity Portfolio . .	\$ 5,227	–
Japan Strategic Value Portfolio . .	¥ 6,501,047	983,486
China Low Volatility Equity		
Portfolio . . . . .	\$ 23,624	4,098
Short Duration Bond Portfolio . . .	\$ 6,466	1,278
American Income Portfolio . . . . .	\$ 93	18
Emerging Markets Debt Portfolio	\$ –	3,407
Mortgage Income Portfolio . . . . .	\$ 1,652	19,456

Die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Rückerstattete oder erlassene

Aufwendungen“ verbucht. Forderungen aus Aufwandserstattung werden in der Zusammensetzung des Fondsvermögens unter „Sonstige Forderungen“ oder „Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten“ verbucht.

Der Fonds zahlt der Verwaltungsgesellschaft außerdem eine Verwaltungsgesellschaftsgebühr.

Bestimmte Anteilsklassen jedes Portefeuilles zahlen der Vertriebsgesellschaft eine Vertriebsgebühr, die eine Vergütung für die Erbringung vertriebsbezogener Dienstleistungen für den Fonds in Bezug auf diese Anteile darstellt.

Alle oben erwähnten Gebühren laufen zu einem Jahressatz des tagesdurchschnittlichen Nettoinventarwertes des jeweiligen Portefeuilles auf und werden monatlich entrichtet.

Die Jahressätze der betreffenden Gebühren für die einzelnen Portefeuilles sind in Tabelle 1 (auf Seite 196 bis 206) aufgeführt.

Ferner unterliegen alle Arten von Anteilen der Klasse B einem Rücknahmeabschlag in Höhe von zwischen 0.00% und 4.50% und alle Arten von Anteilen der Klasse C einem Rücknahmeabschlag in Höhe von zwischen 0.00% und 1.00%. Anteile der Klassen E und J unterliegen einem Rücknahmeabschlag in Höhe von zwischen 0.00% und 3.00%. Der tatsächlich berechnete Satz hängt von dem Portefeuille und der Haltedauer der Anteile ab.

Der Fonds zahlt seiner Registrier- und Transferstelle AllianceBernstein Investor Services, einem Geschäftsbereich der Verwaltungsgesellschaft, eine Vergütung dafür, dass sie Personal und Räumlichkeiten im Rahmen der Erbringung von Dienstleistungen als Registrier- und Transferstelle des Fonds zur Verfügung stellt. Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2021 belief sich dieser Betrag auf \$12,278,028.

Der Fonds vergütet dem Anlageverwalter bestimmte Dienstleistungen, die dieser dem Fonds im Zusammenhang mit der Registrierung des Fonds zum Vertrieb in bestimmten Hoheitsgebieten außerhalb von Luxemburg vorbehaltlich bestimmter Bedingungen erbringt. Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2021 belief sich dieser Betrag auf \$416,956. Der Betrag ist in der Gebühr für professionelle Dienstleistungen in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten.

Der Fonds vergütet seinem Rechtsberater Elvinger Hoss Prussen, *société anonyme* (bei dem Yves Prussen, ein Verwal-

tungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft, Partner ist) gegenüber dem Fonds erbrachte Rechtsdienste. Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2021 wurde eine Vergütung in Höhe von €77,998 entrichtet, die in der Gebühr für professionelle Dienstleistungen in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten ist.

Der Anlageverwalter hat keine Geschäfte bezüglich einer Platzierung und/oder Neuemission abgeschlossen, an der eine verbundene Person als Mitglied des Übernahmekonsortiums wesentlich beteiligt war.

Alle im Namen des Fonds abgeschlossenen Geschäfte wurden im Verlauf der regulären Geschäftstätigkeit und/oder zu den handelsüblichen Bedingungen getätigt. Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2021 wurden keine Provisionen für Wertpapiertransaktionen unter Beanspruchung der Dienste der Tochtergesellschaften, Sanford C. Bernstein & Co., LLC und Sanford C. Bernstein Ltd., gezahlt. Mehrere Verwaltungsratsmitglieder des Fonds sind Mitarbeiter und/oder leitende Angestellte des Anlageverwalters und/oder seiner verbundenen Unternehmen.

Das Dynamic Diversified Portfolio investiert in das AB SICAV I – Low Volatility Equity Portfolio, das von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet wird. Das Global High Yield Portfolio investiert in das AB SICAV I – Emerging Market Corporate Debt Portfolio, das AB SICAV I – Euro High Yield Portfolio, das AB SICAV I – Asia Income Opportunities Portfolio, das AB SICAV I – Emerging Market Local Currency Debt Portfolio, das AB SICAV I – US High Yield Portfolio und das AB SICAV I – Financial Credit Portfolio, die von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden. Das American Income Portfolio investiert in das AB SICAV I – US High Yield Portfolio und AB SICAV I – Asia Income Opportunities Portfolio das von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet wird. Das Emerging Markets Debt Portfolio investiert in das AB SICAV I – Emerging Market Corporate Debt Portfolio, das von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet wird.

Der Fonds kann Wertpapiere von einem verbundenen Fonds erwerben oder an diesen verkaufen, sofern die Verbindung ausschließlich darin besteht, dass die Fonds einen gemeinsamen Anlageberater, gemeinsame leitende Angestellte oder gemeinsame Verwaltungsratsmitglieder haben. Im Berichtszeitraum gab es keine Kauf- und Verkaufstransaktionen mit einem verbundenen Fonds.

#### **ANMERKUNG F: Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen und Transaktionskosten**

Im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2021 haben der Anlageverwalter und eventuelle verbundene Unteranlageverwalter, soweit nach geltendem Recht zulässig, Ausgleichsprovisionen/-vereinbarungen mit Brokern in Bezug auf Portefeuilles des Fonds erhalten bzw. abgeschlossen, die in Aktienwerten anlegen, für welche bestimmte Güter und Dienstleistungen zur Unterstützung des Anlageentscheidungsprozesses erhalten wurden. Die Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen wurden auf Grundlage der Voraussetzung abgeschlossen, dass die Abwicklung von Transaktionen für den Fonds im Einklang mit den Standards zur bestmöglichen Abwicklung erfolgt und der Anlageverwalter beim Abschluss von Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen zahlreiche Faktoren hinsichtlich der

Standards zur bestmöglichen Abwicklung berücksichtigt, wie beispielsweise Umfang und Art der Brokergebühren.

Darüber hinaus können aufgrund der Art der Anlagestrategie bestimmter Portefeuilles, einschließlich der Fälle, in denen der Anlageverwalter Anlageverwaltungsdienstleistungen an AllianceBernstein Limited delegiert, alle Kosten im Zusammenhang mit Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen „entflochten“ und vom Anlageverwalter oder seinen Unterauftragten getragen werden, falls dies nach geltendem Recht erforderlich ist.

Die erhaltenen Güter und Dienstleistungen umfassen u. a. spezialisiertes Branchen-, Unternehmens- und Verbraucher-Research, Portefeuille- und Marktanalysen sowie Computersoftware für die Bereitstellung dieser Dienstleistungen.



Die erhaltenen Güter und Dienstleistungen sind von der Art, dass die gemäß dieser Vereinbarung bereitgestellten Leistungen bei der Bereitstellung von Anlagendiensten für den Fonds behilflich sind und zur Verbesserung der Wertentwicklung des Fonds beitragen könnten.

Um jegliche Zweifel zu vermeiden, umfassen diese Güter und Dienstleistungen keinerlei Güter und Dienstleistungen für Reisen, Hotelunterkunft, Unterhaltung oder allgemeine Verwaltung, Büroausstattung bzw. -räumlichkeiten, Beitragsgebühren, Angestelltegehälter oder direkte geldliche Zahlungen.

Transaktionskosten sind Kosten, die bei dem Erwerb, der Ausgabe oder der Veräußerung von übertragbaren Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten, Derivaten oder anderen geeigneten Anlagen anfallen. Hierzu können die Geld-Brief-Spanne, Gebühren und Provisionen, die an Vermittler, Berater, Broker und Händler gezahlt werden, sowie transaktionsbezogene Steuern und andere Marktgebühren gehören. Hierzu gehören keine Zu- oder Abschreibungen auf Schulden, Finanzierungskosten oder interne Verwaltungs- oder Bestandskosten. Transaktionskosten sind in den Anlagekosten im Verzeichnis der Anlagewerte sowie unter „Realisierte Gewinne und (-verluste) aus Anlagen“ und unter „Veränderung der unrealisierten Wertsteigerung und (Wertminderung) aus Anlagen“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens

enthalten. Die Transaktionskosten werden in der Gesamtausgabenquote und/oder der Berechnung der Aufwandsersatzung unberücksichtigt gelassen.

In der folgenden Tabelle sind die Transaktionskosten, die für die einzelnen Portefeuilles im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2021 angefallen sind, aufgeführt:

AB FCPI-	Transaktionskosten
Dynamic Diversified Portfolio . . . . .	\$ 8,641
Global Equity Blend Portfolio . . . . .	\$ 48,549
Global Value Portfolio . . . . .	\$ 125,798
Emerging Markets Growth Portfolio . . . . .	\$ 1,239,583
Sustainable US Thematic Portfolio . . . . .	\$ 29,689
Asia Ex-Japan Equity Portfolio . . . . .	\$ 507,460
Japan Strategic Value Portfolio . . . . .	¥ 2,749,601
China Low Volatility Equity Portfolio . . . . .	\$ 167,612
Short Duration Bond Portfolio . . . . .	\$ 15,277
Global High Yield Portfolio . . . . .	\$ 3,049,579
American Income Portfolio . . . . .	\$ 193,174
European Income Portfolio . . . . .	€ 17,113
Emerging Markets Debt Portfolio . . . . .	\$ 2,737
Mortgage Income Portfolio . . . . .	\$ -0-

#### ANMERKUNG G: Devisentermingeschäfte

Ein Devisentermingeschäft ist eine Verpflichtung zu einem späteren Kauf oder Verkauf einer Fremdwährung zu einem vereinbarten Terminsatz. Der Gewinn bzw. Verlust, der sich aus dem Unterschied zwischen dem ursprünglichen Vertrag und der Glattstellung dieses Vertrags ergibt, wird in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Realisierte Gewinne und Verluste aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ verbucht.

Wertschwankungen offener Devisenterminkontrakte werden zu Finanzberichterstattungszwecken unter „Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung) aus Devisenterminkontrakten“ in der Zusammensetzung des Fondsvermögens berücksichtigt.

Eine oder mehrere der Anteilklassen eines Portefeuilles, die in einer bestimmten Währung angeboten werden (jeweils eine „angebotene Währung“), können gegen diese angebotene Währung abgesichert sein. Jede solche Anteilklasse stellt eine „währungsabgesicherte Anteilklasse“ dar. Währungsabgesicherte Anteilklassen zielen darauf ab, den Anlegern eine Rendite zu bieten, die stärker mit der Rendite in der Basiswährung des Portefeuilles korreliert, indem die Auswirkungen der Wechselkursschwankungen zwischen der Basiswährung des

Portefeuilles und der jeweiligen angebotenen Währung reduziert werden, wobei praktische Erwägungen wie Transaktionskosten berücksichtigt werden.

Die eingesetzte Absicherungsstrategie soll das Währungsrisiko zwischen der Basiswährung des Portefeuilles und der jeweils angebotenen Währung zwar reduzieren, aber nicht eliminieren.

Die hiermit verbundenen Risiken sind die potenzielle Unfähigkeit des Kontrahenten, seinen vertraglichen Verpflichtungen nachzukommen, und unerwartete Wertentwicklungen einer Fremdwährung im Vergleich zur abgesicherten Währung.

Da die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilklassen eines Portefeuilles nicht abgegrenzt werden, besteht das unwahrscheinliche Risiko, dass die Währungsabsicherungsgeschäfte einer währungsabgesicherten Anteilklasse unter bestimmten Umständen zu Verbindlichkeiten führen könnten, die sich auf den Nettoinventarwert der anderen Anteilklassen desselben Portefeuilles auswirken könnten. In diesem Fall können die Vermögenswerte der anderen Anteilklassen des Portefeuilles dazu benutzt werden, die Verbindlichkeiten zu decken, die einer solchen währungsabgesicherten Anteilklasse entstanden sind.

Die Wertpapiere im Fonds werden als Sicherheit für Devisenterminkontrakte verwendet.

#### ANMERKUNG H: Pensionsgeschäfte

Pensionsgeschäfte werden mit Schuldverschreibungen der Vereinigten Staaten, ihrer Behörden oder Vertretungen derselben abgesichert. Die Depotbank hält die Wertpapiere, die einem Pensionsgeschäft zugrunde liegen, stets in einem Wert, der zumindest dem Rückkaufpreis zuzüglich der angefallenen Zinsen entspricht.

Zum 28. Februar 2021 gab es keine Pensionsgeschäfte.

Während des Berichtszeitraums zum 28. Februar 2021 wurden keine Zinserträge aus Pensionsgeschäften verzeichnet.



**ANMERKUNG I: Umgekehrte Pensionsgeschäfte**

Umgekehrte Pensionsgeschäfte unterscheiden sich von Pensionsgeschäften insofern, dass Wertpapiere nicht vorbehaltlich des Rückkaufs durch den Verkäufer in bar erworben werden, sondern der Fonds Vermögenswerte des Portefeuilles verkauft und gleichzeitig eine Vereinbarung abschließt, dieselben Vermögenswerte zu einem späteren Zeitpunkt zu einem festgelegten Preis, der etwas höher ist als der Verkaufspreis, zurückzukaufen. Während der Laufzeit eines umgekehrten Pensionsgeschäfts erhält der Fonds weiterhin Kapital- und Zinszahlungen auf diese Wertpapiere. Im Allgemeinen kann der Fonds mithilfe eines umgekehrten Pensionsgeschäfts das Geld, das in die relevanten Portefeuille-Wertpapiere investiert wurde, während der Laufzeit des Pensionsgeschäfts vollständig oder größtenteils zurückerlangen und gleichzeitig die Zinserträge, die mit diesen

Portefeuille-Wertpapieren verbunden sind, behalten.

Solche Transaktionen sind nur von Vorteil, wenn die „Zinskosten“ des Fonds bei einem umgekehrten Pensionsgeschäft, d. h. die Differenz zwischen dem Verkaufs- und Rückkaufpreis der Wertpapiere, geringer sind als die Kosten, die ansonsten damit verbunden wären, die Geldsumme zu erhalten, die in die Portefeuille-Wertpapiere investiert ist.

Zum 28. Februar 2021 bestanden keine umgekehrten Pensionsgeschäfte.

Während des Berichtszeitraums zum 28. Februar 2021 wurden keine Zinserträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften verzeichnet.

**ANMERKUNG J: Finanzterminkontrakte**

Der Fonds kann Finanzterminkontrakte kaufen oder verkaufen. Der Fonds trägt die Verantwortung für die Marktrisiken, die sich aus den Wertänderungen dieser Finanzinstrumente ergeben. Die Terminkontrakte, deren Kontrahenten kein Kreditrisiko darstellen, werden vom Fonds an geregelten Börsen abgeschlossen.

Zu dem Zeitpunkt, an dem der Fonds einen Finanzterminkontrakt abschließt, hinterlegt und hält er beim Broker die von der Börse, an der der Kontrakt abgeschlossen wird, erforderte Sicherheitsleistung in Form einer Einschusszahlung.

Der Fonds erklärt sich nach dem Kontrakt einverstanden, einen Bargeldbetrag vom Broker in Empfang zu nehmen oder diesem zu bezahlen, der den täglichen Wertschwankungen des Kontrakts entspricht. Dieser Zahlungsempfang bzw. diese Zahlung wird als Einschusszahlung bezeichnet und vom Fonds als unrealisierter Gewinn bzw. Verlust verbucht. Nach der Glattstellung des Kontrakts weist der Fonds in Höhe des Unterschieds zwischen dem Wert des Kontrakts bei Abschluss und bei der Glattstellung einen realisierten Gewinn bzw. Verlust aus.

**ANMERKUNG K: Swap-Geschäfte**

Ein Swap ist eine Vereinbarung, die zwei Parteien dazu verpflichtet, in festgelegten Abständen eine Reihe von Cashflows auszutauschen, welche auf Veränderungen bei bestimmten Kursen oder Sätzen für eine bestimmte Anzahl eines zugrunde liegenden Vermögenswertes oder einem auf andere Weise festgelegten Nominalbetrag basieren bzw. unter Bezugnahme hierauf berechnet werden. Realisierte Gewinne und (Verluste) sowie Veränderungen der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps sind in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens jeweils unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ und „Veränderung der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps“ enthalten.

**Zentral abgerechnete Credit-Default-Swaps**

Bei einer zentral abgerechneten Credit-Default-Swap-Vereinbarung ist der Käufer verpflichtet, dem Verkäufer über die Laufzeit der Vereinbarung hinweg regelmäßige Zahlungen zu leisten, wofür er im Gegenzug eine bedingte Zahlung erhält, falls ein Kreditereignis in Bezug auf eine zugrunde liegende Referenz-Obligation eintritt.

**Zentral abgerechnete Zinsswaps**

Ein zentral abgerechneter Zinsswap ist eine gegenseitige Vereinbarung, bei der beide Parteien dem Austausch einer Reihe von fest- oder variabel verzinslichen Zahlungen zustimmen, die auf Basis eines Nominalbetrags berechnet werden.

**Total-Return-Swaps**

Ein Total-Return-Swap ist eine gegenseitige Vereinbarung, bei der beide Parteien dem Austausch der Gesamtwertentwicklung eines zugrunde liegenden Vermögenswertes gegen eine Reihe von Zinszahlungen zustimmen, die auf Basis eines Nominalbetrags berechnet werden.

**Credit-Default-Swaps**

Bei einer Credit-Default-Swap-Vereinbarung ist der Käufer verpflichtet, dem Verkäufer über die Laufzeit der Vereinbarung hinweg regelmäßige Zahlungen zu leisten, wofür er im Gegenzug eine bedingte Zahlung erhält, falls ein Kreditereignis in Bezug auf eine zugrunde liegende Referenz-Obligation eintritt.

**Zinsswaps**

Ein Zinsswap ist eine bilaterale Vereinbarung, bei der beide Parteien dem Austausch einer Reihe von fest- oder variabel verzinslichen Zahlungen zustimmen, die auf Basis eines Nominalbetrags berechnet werden.

**Inflations-Swaps**

Ein Inflations-Swap ist eine bilaterale Vereinbarung, bei der beide Parteien dem Austausch von festverzinslichen Zahlungen gegen variabel verzinsliche, Inflationsindex-gebundene Zahlungen zustimmen, die auf Basis eines Nominalbetrags berechnet werden.

**ANMERKUNG L: Optionsgeschäfte**

Der Fonds kann Kauf- und Verkaufsoptionen auf Wertpapiere kaufen und verkaufen. Das mit dem Kauf einer Option verbun-

dene Risiko besteht darin, dass der Fonds eine Prämie bezahlt, unabhängig davon, ob die Option ausgeübt wird oder nicht. Außerdem besteht das Risiko, dass der Fonds die Prämie verliert

und sich der Marktwert verändert, sollte der Kontrahent seinen vertraglichen Verpflichtungen nicht nachkommen. Gekaufte Kauf- und Verkaufsoptionen werden auf dieselbe Art ausgewiesen wie die Wertpapiere eines Portefeuilles. Die Kosten für die durch Ausübung einer Kaufoption gekauften Wertpapiere erhöhen sich um die gezahlten Prämien. Die Erlöse aus den durch Ausübung einer Verkaufsoption verkauften Wertpapieren verringern sich um die gezahlten Prämien.

Wenn der Fonds eine Option verkauft, wird die vom Fonds erhaltene Prämie als Verbindlichkeit verbucht und anschließend an den aktuellen Marktwert der verkauften Option angepasst.

Für verkaufte Optionen erhaltene Prämien, die auslaufen, ohne ausgeübt zu werden, werden vom Fonds am Verfallstermin als realisierter Gewinn aus verkauften Optionen verbucht. Die Differenz zwischen der erhaltenen Prämie und dem gezahlten Betrag bei Ausführung einer Glattstellungstransaktion, einschließlich Händlerprovisionen, wird ebenfalls als realisierter Gewinn behandelt, bzw. als realisierter Verlust, wenn die erhaltene Prämie geringer ist als der bezahlte Betrag für die Glattstellungstransaktion.

Wird eine Kaufoption ausgeübt, wird die Prämie zum Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Währung addiert, um zu ermitteln, ob der Fonds einen Gewinn

oder Verlust realisiert hat. Wird eine Verkaufsoption ausgeübt, wird die erhaltene Prämie von den Kosten des vom Fonds gekauften Wertpapiers oder der gekauften Währung abgezogen. Beim Verkauf einer Option trägt der Fonds das Marktrisiko, dass sich der Kurs des Wertpapiers oder der Währung, das bzw. die der verkauften Option zugrunde liegt, ungünstig verändert. Die Ausübung einer vom Fonds verkauften Option könnte dazu führen, dass der Fonds ein Wertpapier oder eine Währung zu einem Preis kauft bzw. verkauft, der vom aktuellen Marktwert abweicht.

Der Fonds kann auch in Optionen auf Swap-Vereinbarungen, sogenannte Swaptions, investieren. Eine Swaption ist eine Option, die dem Käufer das Recht gibt, jedoch nicht die Verpflichtung, zu einem Zeitpunkt in der Zukunft im Austausch gegen Zahlung einer marktüblichen Prämie ein Swap-Geschäft abzuschließen. Eine Receiver Swaption gibt dem Erwerber das Recht auf Empfang der Gesamrendite eines bestimmten Vermögenswertes, eines Referenzsatzes oder eines Index. Eine Payer Swaption gibt dem Erwerber das Recht auf Zahlung der Gesamrendite eines bestimmten Vermögenswertes, eines Referenzsatzes oder eines Index. Swaptions umfassen ferner Optionen, die es ermöglichen, dass ein bestehendes Swap-Geschäft durch einen der Kontrahenten beendet oder verlängert wird.

#### ANMERKUNG M: Sicherheiten

In der folgenden Tabelle sind die Barsicherheiten aufgeführt, die zum 28. Februar 2021 für bestimmte derivative Finanzinstrumente vom Broker gehalten wurden bzw. diesem zu entrichten waren:

AB FCPI –	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker zu entrichtende Barmittel
Dynamic Diversified Portfolio		
Credit Suisse . . . . .	\$ 79,335	68,251
Morgan Stanley . . . . .	\$ 476,302	20,145
Global Equity Blend Portfolio		
Citibank . . . . .	\$ 14,206	–
Deutsche Bank . . . . .	\$ 20,908	–
JPMorgan Chase . . . . .	\$ 6,387	7,413
Short Duration Bond Portfolio		
Citibank . . . . .	\$ 1,007,052	4,345
Morgan Stanley . . . . .	\$ 4,239,409	1,435,151
Global High Yield Portfolio		
Citibank . . . . .	\$ 50,619,519	8,596,320
Credit Suisse . . . . .	\$ 37,500,000	–
Goldman Sachs . . . . .	\$ 51,760,000	5,180,000
HSBC Bank . . . . .	\$ –	1,350,000
JPMorgan Chase . . . . .	\$ 51,186,000	–
Morgan Stanley . . . . .	\$ 4,438,266	414,791,623
American Income Portfolio		
Citibank . . . . .	\$ 42,890,000	185,852,069
Credit Suisse . . . . .	\$ 790,000	–
Goldman Sachs . . . . .	\$ 2,200,000	–
JPMorgan Chase . . . . .	\$ 112,942,000	–
Morgan Stanley . . . . .	\$ 31,094,020	1,217,337

AB FCPI –	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker zu entrichtende Barmittel
European Income Portfolio		
Citibank . . . . .	€ 16,000,948	426
Goldman Sachs . . . . .	€ 15,471,866	881,581
Emerging Markets Debt Portfolio		
Citibank . . . . .	\$ –	260,000
Goldman Sachs . . . . .	\$ 1,163,601	–
Morgan Stanley . . . . .	\$ 873,963	258,854
Mortgage Income Portfolio		
Citibank . . . . .	\$ 4,172,373	–
Credit Suisse . . . . .	\$ 1,811,400	–
Goldman Sachs . . . . .	\$ 727,000	–
JPMorgan Chase . . . . .	\$ 5,525,000	–
Morgan Stanley . . . . .	\$ 9,092,381	–

Barsicherheiten, die von Brokern in Bezug auf Derivate gehalten bzw. diesen geschuldet werden, sind in der Zusammensetzung des Fondsvermögens unter „Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel“ und „An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar“ ausgewiesen.

In Bezug auf die am 28. Februar 2021 von den einzelnen Portefeuilles gehaltenen Derivate sind in der folgenden Tabelle aus Wertpapieren bestehende Sicherheiten aufgeführt:

AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
Short Duration Bond Portfolio.		
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bonds,		
7.50%, 11/15/2024	\$ 255,299	–

AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten	AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
Global High Yield Portfolio . . .			Global High Yield		
Australia and New Zealand			Portfolio (Fortsetzung) . . . . .		
Banking Group			U.S. Treasury Notes, 0.38%, 04/30/2025	\$ 354,433	–
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 805,021	–	NatWest Markets		
Barclays			U.S. Treasury Bonds, 0.13%, 01/15/2022	\$ –	2,140,419
U.S. Treasury Bonds, 1.38%, 08/15/2050	\$ 275,223	–	U.S. Treasury Bonds, 0.63%, 07/15/2021	\$ –	139,976
Citibank			Standard Chartered Bank		
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 30,083,587	–	U.S. Treasury Bonds, 1.38%, 08/15/2050	\$ 864,448	–
U.S. Treasury Notes, 0.38%, 04/30/2025	\$ 653,705	–	U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 549,756	–
Credit Suisse			U.S. Treasury Notes, 0.38%, 04/30/2025	\$ 134,385	–
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 94,479,337	–	American Income Portfolio . . .		
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 603,752	–	Barclays		
U.S. Treasury Bonds, 6.63%, 02/15/2027	\$ 306,725	–	U.S. Treasury Bonds, 6.50%, 11/15/2026	\$ 8,246,076	–
U.S. Treasury Bonds, 7.63%, 02/15/2025	\$ 59,313	–	Citibank		
U.S. Treasury Notes, 0.38%, 04/30/2025	\$ 383,251	–	U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 465,075,524	–
Deutsche Bank			U.S. Treasury Bonds, 6.50%, 11/15/2026	\$ 65,093,750	–
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 251,436	–	U.S. Treasury Notes, 0.50%, 10/31/2027	\$ 2,617,878	–
U.S. Treasury Bonds, 6.63%, 02/15/2027	\$ 6,432,881	–	U.S. Treasury Notes, 0.63%, 08/15/2030	\$ 149,635,092	–
U.S. Treasury Bonds, 7.63%, 02/15/2025	\$ 588,039	–	Credit Suisse		
Goldman Sachs			U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 334,697	–
U.S. Treasury Bonds, 1.38%, 08/15/2050	\$ 8,032,006	–	U.S. Treasury Bonds, 6.50%, 11/15/2026	\$ 291,620	–
U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 118,611,386	–	U.S. Treasury Notes, 0.63%, 08/15/2030	\$ 52,708,513	–
U.S. Treasury Bonds, 6.63%, 02/15/2027	\$ 55,529,382	–	Deutsche Bank		
U.S. Treasury Notes, 0.38%, 04/30/2025	\$ 2,317,925	–	U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 5,785,188	–
Morgan Stanley			Goldman Sachs		
U.S. Treasury Bonds, 1.38%, 08/15/2050	\$ 1,950,143	–	U.S. Treasury Notes, 0.50%, 10/31/2027	\$ 1,165,442	–
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 265,933,775	–	U.S. Treasury Notes, 0.63%, 08/15/2030	\$ 147,623,048	–
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 50,780,562	–	Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bonds, 6.63%, 02/15/2027	\$ 10,130,163	–	U.S. Treasury Bonds, 1.13%, 08/15/2040	\$ 31,635,800	–
U.S. Treasury Bonds, 6.75%, 08/15/2026	\$ 278,276,902	–	U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 783,078	–
U.S. Treasury Bonds, 7.50%, 11/15/2024	\$ 73,417,500	–	U.S. Treasury Notes, 0.50%, 10/31/2027	\$ 822,394	–
U.S. Treasury Bonds, 7.63%, 02/15/2025	\$ 52,461,512	–	U.S. Treasury Notes, 0.63%, 08/15/2030	\$ 1,663,206	–

**ANMERKUNG N: Verleih von Portefeuille-Wertpapieren**

Ein Portefeuille kann seine Wertpapiere besichert verleihen. Das Risiko, das mit dem Verleih von Wertpapieren verbunden ist, besteht genau wie bei anderen Kreditgewährungen in dem möglichen Verlust des Anrechts auf die Sicherheiten, falls der Entleiher in Konkurs geht. Darüber hinaus wird ein Portefeuille dem Risiko ausgesetzt sein, dass der Erlös aus dem Verkauf jeglicher Sicherheiten, der nach dem Zahlungsverzug des Entleihers realisiert wird, nicht ausreicht, um die verliehenen Wertpapiere zu ersetzen.

Um festzulegen, ob Wertpapiere an einen bestimmten Entleiher verliehen werden sollten oder nicht, wird der Anlageverwalter alle relevanten Fakten und Umstände berücksichtigen, wozu u. a. die Kreditwürdigkeit des Entleihers zählt.

Während die Wertpapiere verliehen sind, zahlt der Entleiher dem jeweiligen Portefeuille möglicherweise alle aus diesen Wertpapieren generierten Erträge. Das Portefeuille kann alle Barsicherheiten in Geldmarktinstrumente investieren und dadurch zusätzliche Erträge erwirtschaften oder aber einen vereinbarten Betrag an Erträgen von einem Entleiher erhalten, der entsprechende Sicherheiten geliefert hat.

Das Portefeuille hat u. U. das Recht, das eingetragene Eigentum an den verliehenen Wertpapieren oder äquivalenten Wertpapieren zurückzuerlangen, um Eigentumsrechte auszuüben, wie beispielsweise Stimmrechte, Zeichnungsrechte und Rechte auf Dividenden, Zinsen oder Ausschüttungen. Ein Portefeuille kann angemessene Konsortialführer-, Verwaltungs- und sonstige Gebühren im Zusammenhang mit einer Ausleiher zahlen.

Für besicherte Wertpapierleihen erhält ein Portefeuille Brutto-Gebühreneinnahmen, von denen 20% an die Wertpapierleihstelle für die Bereitstellung von Wertpapierleihdiensten entrichtet werden.

Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2021 erwirtschafteten die Portefeuilles Nettogebühreneinnahmen, die in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe, netto“ ausgewiesen sind.

Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2021 verdiente Brown Brothers Harriman & Co. (in seiner Funktion als Wertpapierleihstelle) ein Honorar von \$35,054 für die Bereitstellung von Wertpapierleihdiensten. Dieses Honorar ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe, netto“ ausgewiesen. Die zum 28. Februar 2021 verliehenen Wertpapiere und die entsprechenden ausstehenden Sicherheiten haben folgenden Wert. Die Sicherheiten beziehen sich auf die in den Portefeuilles gehaltenen Wertpapiere.

AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Global Equity Blend Portfolio .		
JPMorgan	\$ 1,032,798	1,084,439
Global Value Portfolio . . . . .		
JPMorgan	\$ 9,109,580	9,565,059
Emerging Markets Growth Portfolio . . . . .		
Barclays	\$ 10,192,180	11,384,103
UBS AG	\$ 53	60
Asia Ex-Japan Equity Portfolio . . . . .		
JPMorgan	\$ 3,689,027	3,873,479
Japan Strategic Value Portfolio . . . . .		
Citigroup Global Markets Limited	¥ 161,910,068	170,005,659
Merrill Lynch	¥ 9,443,374	9,915,546
China Low Volatility Equity Portfolio . . . . .		
Citigroup Global Markets Limited	\$ 27,697	29,082

**ANMERKUNG O: Bankkredite**

Vorbehaltlich gewisser Einschränkungen kann der Fonds über einen von der Depotbank verliehenen Überziehungskredit (die „Fazilität“) verfügen, um gegebenenfalls eine ungewöhnlich hohe Zahl von Rücknahmen kurzfristig oder vorübergehend zu finanzieren.

Die Portefeuilles des Fonds können nur Kredite in Höhe von 10% ihres jeweiligen Nettovermögens aufnehmen. Auf die über die Fazilität erhaltenen Kredite sind Zinsen in der vereinbarten Höhe zu entrichten; ferner werden sie mit den zugrunde liegenden Vermögenswerten des jeweiligen Portefeuilles besichert.

**ANMERKUNG P: Gemeinsame Verwaltung von Vermögenswerten**

Zum Zwecke der effizienten Verwaltung kann die Verwaltungsgesellschaft Vermögenswerte bestimmter Portefeuilles innerhalb oder außerhalb des Fonds gemeinsam verwalten, wenn dies gemäß der Anlagepolitik des jeweiligen Portefeuilles gestattet ist. In diesem Fall werden die Vermögenswerte verschiedener Portefeuilles gemeinsam verwaltet. Auf gemeinsam verwaltete Vermögenswerte wird als „Pool“ Bezug genommen. Diese Pool-Vereinbarungen dienen dazu, die operativen und anderen Aufwendungen zu reduzieren; die gesetzlichen Rechte und Pflichten der Anteilhaber ändern sich dadurch nicht. Die Pools sind keine separaten juristischen Personen;

Anleger können nicht direkt auf diese Pools zugreifen. Jedes Portefeuille behält das Anrecht auf seine eigenen spezifischen Vermögenswerte.

Wenn die Vermögenswerte verschiedener Portefeuilles zum Zwecke der gemeinsamen Verwaltung zu Pools zusammengefasst werden, wird der Anteil des Pools an Vermögenswerten, der jedem einzelnen beteiligten Portefeuille zuzurechnen ist, mit dem Verweis auf die ursprüngliche Beteiligung des Portefeuilles an diesem Pool verzeichnet, der sich im Falle weiterer Zuweisungen bzw. im Falle von Abzügen ändern kann. Der Anspruch jedes einzelnen beteiligten Portefeuilles auf die gemeinsam verwalteten Vermögenswerte gilt für alle Arten von Anlagen des Pools.

Zusätzliche Anlagen, die für die gemeinsam verwalteten Portefeuilles getätigt werden, werden den einzelnen Portefeuilles proportional zu ihren Ansprüchen zugewiesen. Vermögenswerte, die abgestoßen werden, werden auf dieselbe Weise vom Anspruch jedes einzelnen beteiligten Portefeuilles abgezogen.

Zum 28. Februar 2021 verwaltet der Fonds die Vermögenswerte bestimmter Portefeuilles innerhalb des Fonds unter Verwendung der folgenden Pools gemeinsam:

**Pool an Vermögenswerten**

**Beteiligte Portefeuilles**

ACM Global Investments-Global Bond Pool . . . . .	Short Duration Bond Portfolio
ACM Bernstein-Global Growth Pool . . . . .	Global Equity Blend Portfolio
ACM Global Investments-Global Value Pool . . . . .	Global Equity Blend Portfolio
	Global Value Portfolio

**ANMERKUNG Q: Ereignisse nach dem Stichtag**

Der Anlageverwalter delegierte die Anlageverwaltungsdienstleistungen für bestimmte Portefeuilles zum 1. April 2021 an den neuen verbundenen Unteranlageverwalter AllianceBernstein Australia Limited:

- Asia Ex-Japan Equity Portfolio
- China Low Volatility Equity Portfolio



# TABELLE 1

## GEBÜHRENSTRUKTUR

AB FCPI

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b><u>Dynamic Diversified Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
A EUR H .....	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
AX .....	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
B(a) .....	1.70%	0.10%	1.00%	2.95%
BX .....	1.40%	0.10%	1.00%	2.90%
C .....	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
C EUR H .....	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
CX .....	1.70%	0.10%	N/A	2.20%
I .....	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
I EUR H .....	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
IX .....	0.70%	0.10%	N/A	1.20%
S1 EUR H .....	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
<b><u>Global Equity Blend Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.60%	0.10%	N/A	1.93%
A EUR H .....	1.60%	0.10%	N/A	1.93%
B .....	1.60%	0.10%	1.00%	2.92%
C .....	2.05%	0.10%	N/A	2.38%
I .....	0.80%	0.10%	N/A	1.13%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S1 .....	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
<b><u>Global Value Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.50%	0.10%	N/A	1.79%
A SGD H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.79%
AD .....	1.50%	0.10%	N/A	1.79%
AD AUD H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.79%
AD CAD H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.79%
AD EUR H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.79%
AD GBP H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.79%
AD SGD H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.78%
AD ZAR H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.79%
B .....	1.50%	0.10%	1.00%	2.78%
BD .....	1.50%	0.10%	1.00%	2.78%
BD AUD H .....	1.50%	0.10%	1.00%	2.77%
BD EUR H .....	1.50%	0.10%	1.00%	2.76%
BD ZAR H .....	1.50%	0.10%	1.00%	2.78%
C .....	1.95%	0.10%	N/A	2.24%
I .....	0.70%	0.10%	N/A	1.00%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
S GBP H .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
S1 .....	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.78%
SD .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
<b><u>Emerging Markets Growth Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.70%	0.10%	N/A	1.94%
A AUD H .....	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
A PLN H .....	1.70%	0.10%	N/A	1.96%
A SGD H .....	1.70%	0.10%	N/A	1.94%
AD .....	1.70%	0.10%	N/A	1.97%



	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b><u>Emerging Markets Growth Portfolio (Fortsetzung)</u></b>				
<b>Klasse</b>				
B .....	1.70%	0.10%	1.00%	2.94%
C .....	2.15%	0.10%	N/A	2.39%
C AUD H .....	2.15%	0.10%	N/A	2.39%
ED .....	1.70%	0.10%	1.00%	2.96%
I .....	0.90%	0.10%	N/A	1.14%
I AUD H .....	0.90%	0.10%	N/A	1.15%
N .....	2.15%	0.10%	N/A	2.39%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.06%
S1 .....	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.97%
<b><u>Sustainable US Thematic Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
A AUD H .....	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
A CAD H .....	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
A EUR H .....	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A GBP H .....	1.50%	0.05%	N/A	1.65%
A SGD H .....	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
AN .....	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
B .....	1.50%	0.05%	1.00%	2.70%
C .....	1.95%	0.05%	N/A	2.16%
C EUR H .....	1.95%	0.05%	N/A	2.15%
I .....	0.70%	0.05%	N/A	0.91%
I EUR H .....	0.70%	0.05%	N/A	0.91%
I GBP .....	0.70%	0.05%	N/A	0.89%
IN .....	0.70%	0.05%	N/A	0.91%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.07%
S1 .....	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.72%
S1 JPY H .....	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.72%
<b><u>Asia Ex-Japan Equity Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A AUD H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A SGD H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD .....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD AUD H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD CAD H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD EUR H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD GBP H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD NZD H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD RMB H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.04%
AD SGD H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
AD ZAR H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AY JPY .....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
BD .....	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
BD AUD H .....	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
BD CAD H .....	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
BD GBP H .....	1.70%	0.05%	1.00%	2.93%
BD NZD H .....	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
BD ZAR H .....	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
BY JPY .....	1.45%	0.05%	0.72%	2.52%
C .....	2.15%	0.05%	N/A	2.44%
C AUD H .....	2.15%	0.05%	N/A	2.49%

**TABELLE 1**  
**GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)**

**AB FCPI**

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>Asia Ex-Japan Equity Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
ED .....	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
I .....	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
I AUD H .....	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
I GBP .....	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
ID .....	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
ID AUD H .....	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.17%
S1 .....	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.07%
SD .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.17%
<b>Japan Strategic Value Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
2(b) .....	1.20%	0.05%	N/A	1.35%
A .....	1.50%	0.05%	N/A	2.11%
A AUD H .....	1.50%	0.05%	N/A	2.12%
A CZK H .....	1.50%	0.05%	N/A	2.13%
A EUR H .....	1.50%	0.05%	N/A	2.12%
A NZD H .....	1.50%	0.05%	N/A	2.12%
A SGD H .....	1.50%	0.05%	N/A	2.13%
A USD H .....	1.50%	0.05%	N/A	2.12%
AD .....	1.50%	0.05%	N/A	2.12%
AD AUD H .....	1.50%	0.05%	N/A	2.12%
AD NZD H .....	1.50%	0.05%	N/A	2.12%
AD USD H .....	1.50%	0.05%	N/A	2.13%
AD ZAR H .....	1.50%	0.05%	N/A	2.12%
B .....	1.50%	0.05%	1.00%	3.12%
BD .....	1.50%	0.05%	1.00%	3.10%
BD AUD H .....	1.50%	0.05%	1.00%	3.12%
BD USD H .....	1.50%	0.05%	1.00%	3.13%
BD ZAR H .....	1.50%	0.05%	1.00%	3.11%
C .....	1.95%	0.05%	N/A	2.58%
C EUR H .....	1.95%	0.05%	N/A	2.57%
I .....	0.70%	0.05%	N/A	1.30%
I EUR H .....	0.70%	0.05%	N/A	1.33%
I USD H .....	0.70%	0.05%	N/A	1.33%
S EUR H .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%
S1 .....	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 USD H .....	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
SD .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%
<b>China Low Volatility Equity Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A PLN H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD AUD H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD CAD H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD EUR H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD GBP H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD NZD H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD RMB H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD SGD H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD ZAR H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
B .....	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%

**China Low Volatility Equity Portfolio (Fortsetzung)**

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
BD .....	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD AUD H .....	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD EUR H .....	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD NZD H .....	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD ZAR H .....	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
C .....	2.15%	0.05%	N/A	2.44%
I .....	0.90%	0.05%	N/A	1.19%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.14%
S1 .....	0.75%	0.01%(8)	N/A	0.89%

**Short Duration Bond Portfolio**

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
A .....	0.85%	0.10%	N/A	1.12%
A2 .....	0.85%	0.10%	N/A	1.11%
A2 EUR H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.11%
A2 SGD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.08%
AA .....	0.85%	0.10%	N/A	1.11%
AA AUD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.11%
AA CAD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.11%
AA GBP H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.11%
AA NZD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.12%
AA SGD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.12%
AJ .....	0.65%	0.10%	N/A	0.91%
AR EUR H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.11%
AT .....	0.85%	0.10%	N/A	1.11%
AT AUD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.12%
AT CAD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.10%
AT EUR H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.11%
AT GBP H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.12%
AT NZD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.12%
AT SGD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.12%
AX .....	0.65%	0.10%	N/A	0.92%
B .....	0.85%	0.10%	1.00%	2.11%
B2 .....	0.85%	0.10%	1.00%	2.11%
BA .....	0.85%	0.10%	1.00%	2.11%
BT .....	0.85%	0.10%	1.00%	2.11%
BT AUD H .....	0.85%	0.10%	1.00%	2.11%
BT CAD H(a) .....	0.85%	0.10%	1.00%	2.11%
BT GBP H .....	0.85%	0.10%	1.00%	2.10%
BX(a) .....	0.65%	0.10%	N/A	0.89%
C .....	1.25%	0.10%	N/A	1.51%
C2 .....	1.25%	0.10%	N/A	1.51%
C2 EUR H .....	1.25%	0.10%	N/A	1.47%
I .....	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
I2 .....	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
I2 AUD H .....	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
I2 EUR H .....	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
IT .....	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
IT AUD H .....	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
N2 .....	1.35%	0.10%	N/A	1.60%
NT .....	1.35%	0.10%	N/A	1.60%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
S EUR H .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S SGD H .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%

**TABELLE 1**  
**GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)**

**AB FCPI**

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
S1 2 .....	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.33%
S1 EUR H .....	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
SA .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
<b>Global High Yield Portfolio**</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
A2 .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
A2 CHF H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
A2 EUR H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
A2 PLN H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.60%
A2 SGD H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA AUD H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA CAD H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA EUR H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA GBP H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA NZD H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA RMB H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA SGD H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA ZAR H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AK .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AK EUR H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AR EUR H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT AUD H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT CAD H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT EUR H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT GBP H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT NZD H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT RMB H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT SGD H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
B .....	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
B2 .....	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
B2 EUR H .....	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
BA .....	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
BA AUD H .....	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
BA ZAR H .....	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
BT .....	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
BT AUD H .....	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
BT CAD H .....	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
BT EUR H .....	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
BT GBP H .....	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
BT NZD H .....	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
C .....	1.87%(2)	0.10%	N/A	2.08%
C2 .....	1.87%(2)	0.10%	N/A	2.08%
C2 EUR H .....	1.87%(2)	0.10%	N/A	2.08%
CK .....	1.87%(2)	0.10%	N/A	2.08%
CK EUR H .....	1.87%(2)	0.10%	N/A	2.06%
CT .....	1.87%(2)	0.10%	N/A	2.08%
EA .....	1.37%(1)	0.10%	0.50%	2.08%
EA AUD H .....	1.37%(1)	0.10%	0.50%	2.08%
EA ZAR H .....	1.37%(1)	0.10%	0.50%	2.08%
I .....	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%

**Global High Yield Portfolio\*\* (Fortsetzung)**

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt- kostenquote*
I2	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
I2 AUD H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
I2 CHF H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
I2 EUR H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
I2 SGD H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IA AUD H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IQD	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IT	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IT AUD H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IT CAD H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.06%
IT EUR H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IT GBP H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IT NZD H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IT RMB H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
J	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
N2	1.93%(4)	0.10%	N/A	2.14%
NT	1.93%(4)	0.10%	N/A	2.14%
S EUR H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
S1	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.93%
S1D	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.93%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
SK	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.68%
SQ	0.60%	0.01%(8)	N/A	0.63%
W	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.99%
W2	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.96%
W2 CHF H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.96%
W2 EUR H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.94%
WT	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.94%
WT AUD H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT CAD H	0.75%(9)	0.10%	N/A	1.04%
WT EUR H	0.75%(9)	0.10%	N/A	1.02%
WT GBP H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.96%
WT RMB H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.99%

**American Income Portfolio**

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt- kostenquote*
A	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
A2	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
A2 CHF H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
A2 DUR PH	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
A2 EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
A2 PLN H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
A2 SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA CAD H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA DUR PH	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA GBP H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA NZD H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA RMB H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AA SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA ZAR H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%

**TABELLE 1**  
**GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)**

**AB FCPI**

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>American Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
AK .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AK EUR H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AR EUR .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AR EUR H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AT .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AT AUD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AT CAD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AT DUR PH .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AT EUR H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AT GBP H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AT NZD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AT RMB H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AT SGD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
B .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
B2 .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BA .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BA AUD H .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BA ZAR H .....	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
BT .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT AUD H .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT CAD H .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT EUR H .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT GBP H .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT NZD H .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
C .....	1.55%	0.10%	N/A	1.75%
C2 .....	1.55%	0.10%	N/A	1.75%
C2 DUR PH .....	1.55%	0.10%	N/A	1.75%
C2 EUR H .....	1.55%	0.10%	N/A	1.75%
CT .....	1.55%	0.10%	N/A	1.75%
EA .....	1.10%	0.10%	0.50%	1.80%
EA AUD H .....	1.10%	0.10%	0.50%	1.80%
EA ZAR H .....	1.10%	0.10%	0.50%	1.80%
I .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
I2 .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
I2 AUD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
I2 CHF H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
I2 DUR PH .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
I2 EUR H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
I2 SGD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IA .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IA AUD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IT .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IT AUD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IT CAD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IT EUR H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT GBP H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IT JPY .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IT JPY H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IT NZD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT RMB H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IT SGD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
J .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
L2 .....	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
L2 AUD H .....	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
L2 SGD H .....	0.90%	0.10%	N/A	1.05%



	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>American Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
LT .....	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT AUD H .....	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT SGD H .....	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
N2 .....	1.65%	0.10%	N/A	1.85%
NT .....	1.65%	0.10%	N/A	1.85%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
S1 .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.53%
S1D .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.53%
S1D2 .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.53%
SA .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
SHK .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
W .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.60%
W2 .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
W2 CHF H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
W2 EUR H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
WT .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.58%
WT AUD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
WT EUR H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
WT GBP H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
WT SGD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
<b>European Income Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
A2 .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
A2 CHF H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
A2 PLN H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.34%
A2 SGD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.34%
A2 USD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AA .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AA AUD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AA HKD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AA RMB H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AA SGD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AA USD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AK .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AR .....	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AT .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AT AUD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AT SGD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AT USD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
B .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.06%
B2 .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.06%
BA .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%
BA AUD H .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.06%
BA USD H .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.06%
BT .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%
BT AUD H .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%
BT USD H .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.06%
C .....	1.55%	0.10%	N/A	1.81%
C2 .....	1.55%	0.10%	N/A	1.81%
C2 USD H .....	1.55%	0.10%	N/A	1.81%
CK .....	1.55%	0.10%	N/A	1.80%
CT USD H .....	1.55%	0.10%	N/A	1.81%

**TABELLE 1**  
**GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)**

**AB FCPI**

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>European Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
I .....	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
I2 .....	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
I2 AUD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
I2 CHF H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 USD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IA .....	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IA HKD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.86%
IA SGD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IA USD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IT .....	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IT SGD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.79%
IT USD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
NT USD H .....	1.65%	0.10%	N/A	1.91%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
S1 .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1 USD H .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1D .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
SA USD H .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
SHK .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
W2 .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.65%
W2 CHF H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.66%
W2 USD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.64%
WA .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.66%
WA HKD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.64%
WA USD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.68%
WT .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.66%
WT SGD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.65%
WT USD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.65%
<b>Emerging Markets Debt Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2 .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2 CHF H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
A2 EUR H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
A2 PLN H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
A2 SGD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA AUD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA CAD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA EUR H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA GBP H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA NZD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA RMB H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA SGD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA ZAR H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AR EUR .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT AUD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT CAD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT EUR H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT GBP H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT NZD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT RMB H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
AT SGD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
B(a) .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
B2 .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.35%
BA .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BA AUD H .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BA ZAR H .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BT .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.35%
BT AUD H .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BT CAD H .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BT EUR H .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.32%
BT GBP H .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BT NZD H .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
C .....	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
C2 .....	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
C2 EUR H .....	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
CT .....	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
EA .....	1.10%	0.05%	0.50%	1.85%
EA AUD H .....	1.10%	0.05%	0.50%	1.86%
EA ZAR H .....	1.10%	0.05%	0.50%	1.85%
I .....	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
I2 .....	0.55%	0.05%	N/A	0.81%
I2 CHF H .....	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I2 EUR H .....	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
IT .....	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
IT AUD H .....	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
IT EUR H .....	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
IT SGD H .....	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
N2 .....	1.65%	0.05%	N/A	1.90%
NT .....	1.65%	0.05%	N/A	1.91%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S EUR H .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.06%
S GBP H .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.06%
S1 2 .....	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.65%
S1 EUR H .....	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.61%
S1 GBP H .....	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.60%
S1QD EUR H .....	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.65%
SA .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%

**Mortgage Income Portfolio**

<b>Klasse</b>				
A .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
A2 .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
A2X .....	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
AA .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA AUD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA RMB H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA SGD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA ZAR H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AR EUR H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AT .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AT AUD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AT GBP H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AT SGD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AX .....	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%

**TABELLE 1**  
**GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)**

**AB FCPI**

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamtkostenquote*</u>
<b>Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
B2X .....	1.05%(5)	0.05%	0.45%	1.70%
BA .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.30%
BA AUD H .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.33%
BA ZAR H .....	1.10%	0.05%	1.00%	2.31%
BX .....	1.05%(5)	0.05%	0.45%	1.70%
C .....	1.55%	0.05%	N/A	1.78%
C2 .....	1.55%	0.05%	N/A	1.78%
C2X .....	1.50%(6)	0.05%	N/A	1.70%
CX .....	1.50%(6)	0.05%	N/A	1.70%
I .....	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
I2 .....	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
I2 EUR H .....	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
I2X .....	0.50%(7)	0.05%	N/A	0.70%
IT EUR H .....	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
IX .....	0.50%(7)	0.05%	N/A	0.70%
N2 .....	1.65%	0.05%	N/A	1.87%
NT .....	1.65%	0.05%	N/A	1.88%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
S1 .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1 EUR H .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.58%
S1 JPY .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1X .....	0.40%	0.01%(8)	N/A	0.45%
SA .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%

\* Ungeprüft. Annualisierte Sätze. Bei der Berechnung der Gesamtkostenquote werden die von der SFAMA am 16. Mai 2008 aufgestellten Richtlinien befolgt.

\*\* Zur Berechnung der Gesamtkostenquote des Global High Yield Portfolios wird das Gesamtnettovermögen der vom Anlageverwalter verwalteten zugrundeliegenden Fonds bei der Berechnung der Nettoverwaltungsgebühr, der Verwaltungsgesellschaftsgebühr und der taxe d'abonnement des Portefeuilles abgezogen, um eine doppelte Gebührenbelastung zu vermeiden.

- (a) Die Anteilklasse wurde am 29 Januar 2021 aufgelöst.  
(b) Die Anteilklasse wurde am 19. Februar 2021 aufgelöst.

Verwaltungsgebühren für den Berichtszeitraum werden zu ihrem tatsächlichen Satz ausgewiesen, der durch Folgendes bestimmt wird:

- Änderung während des Berichtszeitraums von 1.70% bis zu \$5,000,000,000 und 1.50% bei über \$5,000,000,000 zu bis zu 1.45% bis zu \$15,000,000,000 und bis zu 1.25% bei über \$15,000,000,000, mit Wirkung zum 1. Januar 2021. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- Änderung während des Berichtszeitraums von 2.15% bis zu \$5,000,000,000 und 1.95% bei über \$5,000,000,000 zu bis zu 1.95% bis zu \$15,000,000,000 und bis zu 1.75% bei über \$15,000,000,000, mit Wirkung zum 1. Januar 2021. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- Änderung während des Berichtszeitraums von 1.15% bis zu \$5,000,000,000 und 0.95% bei über \$5,000,000,000 zu bis zu 0.95% bis zu \$15,000,000,000 und bis zu 0.75% bei über \$15,000,000,000, mit Wirkung zum 1. Januar 2021. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- Änderung während des Berichtszeitraums von 2.25% bis zu \$5,000,000,000 und 2.05% bei über \$5,000,000,000 zu bis zu 2.00% bis zu \$15,000,000,000 und bis zu 1.85% bei über \$15,000,000,000, mit Wirkung zum 1. Januar 2021. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- 1.05% bis zu \$100,000,000, 1.00% für die nächsten \$100,000,000 und 0.95% bei über \$200,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- 1.50% bis zu \$100,000,000, 1.45% für die nächsten \$100,000,000 und 1.40% bei über \$200,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- 0.50% bis zu \$100,000,000, 0.45% für die nächsten \$100,000,000 und 0.40% bei über \$200,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

Gebühr der Verwaltungsgesellschaft

- (8) Jährliche Gebühr in Höhe von \$50,000 oder 0.01% des tagesdurchschnittlichen NAV, je nachdem welcher Betrag niedriger ist.

Maximale Verwaltungsgebühr gemäß den Angaben im Prospekt des Fonds

- (9) Max 1.15%  
(10) Max. 0.55%

**TABELLE 2**  
**PORTEFEUILLEUMSATZ**

**AB FCPI**

<b>AB FCPI-</b>	<b>Umsatz*</b>
Dynamic Diversified Portfolio . . . . .	183.71%
Global Equity Blend Portfolio . . . . .	128.21%
Global Value Portfolio . . . . .	13.96%
Emerging Markets Growth Portfolio . . . . .	186.21%
Sustainable US Thematic Portfolio . . . . .	(5.88)%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio . . . . .	36.02%
Japan Strategic Value Portfolio . . . . .	14.49%
China Low Volatility Equity Portfolio . . . . .	11.25%
Short Duration Bond Portfolio . . . . .	4.18%
Global High Yield Portfolio . . . . .	37.69%
American Income Portfolio . . . . .	(18.34)%
European Income Portfolio . . . . .	(28.10)%
Emerging Markets Debt Portfolio . . . . .	56.51%
Mortgage Income Portfolio . . . . .	73.72%

\* Ungeprüft.

Wie im Prospekt dargelegt, kann der Anlageverwalter bei der Umsetzung der jeweiligen Anlagestrategie der Portefeuilles einen Teil seiner Vermögensverwaltungsaufgaben an eine oder mehrere seiner 100%igen Tochtergesellschaften (die „verbundenen Unteranlageverwalter“) übertragen. Alle verbundenen Unteranlageverwalter sind zur Erbringung von Anlageverwaltungsdienstleistungen zugelassen, registriert oder besitzen eine entsprechende Genehmigung und unterliegen der Aufsicht durch die zuständige Aufsichtsbehörde.

Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2021 hat der Anlageverwalter die Anlageverwaltungsdienstleistungen für die nachstehend aufgeführten Portefeuilles an die folgenden verbundenen Unteranlageverwalter übertragen:

**AllianceBernstein Limited:**

- Global Equity Blend Portfolio
- Global Value Portfolio
- European Income Portfolio
- Short Duration Bond Portfolio

**AllianceBernstein Hong Kong Limited:**

- Asia Ex-Japan Equity Portfolio
- China Low Volatility Equity Portfolio

**AllianceBernstein (Singapore) Ltd.:**

- Emerging Markets Growth Portfolio

**AllianceBernstein (Japan) Ltd.:**

- Japan Strategic Value Portfolio

**Finanzinformationen zum Fonds**

Der Fonds veröffentlicht Halbjahres- und Jahresberichte, in denen Aufstellungen der Bestände eines jeden Portefeuilles und deren Marktwerte zum Ende des jeweiligen Halbjahres enthalten sind.

Bitte beachten Sie, dass bei den Portefeuilles, deren Basiswährung der Yen ist, die Zahlung der Rücknahmeerlöse (der Rücknahmepreis abzüglich eines ggf. zur Anwendung kommenden Rücknahmeabschlags) von der Depotbank oder deren Vertreter normalerweise innerhalb von vier Geschäftstagen nach Annahme des Rücknahmeantrags für eine bestimmte Handelstransaktion vorgenommen wird.

Anteile der Klassen SA GB und S1A GB stehen nur solchen britischen institutionellen Anlegern zur Verfügung, die zur Zufriedenheit der Verwaltungsgesellschaft nachweisen können, dass sie gemäß den relevanten Steuerabkommen zwischen dem Land des Steuerwohnsitzes des Anlegers und den USA von der Quellensteuer auf Dividendenerträge aus den USA befreit sind, und die sich bereit erklären, der Verwaltungsgesellschaft bestimmte andere Bestätigungen und Informationen zukommen zu lassen, soweit dies erforderlich ist, um nachzuweisen, dass sie zur Anlage in diese Anteile berechtigt sind.

Anteile der Klassen SB GB und S1B GB stehen nur solchen britischen institutionellen Anlegern zur Verfügung, die zur Zufriedenheit der Verwaltungsgesellschaft nachweisen können, dass sie gemäß den relevanten Steuerabkommen zwischen dem Land des Steuerwohnsitzes des Anlegers und den USA Anspruch auf einen reduzierten Quellensteuersatz von 15% haben, und die sich bereit erklären, der Verwaltungsgesellschaft bestimmte andere Bestätigungen und Informationen zukommen zu lassen, soweit dies erforderlich ist, um nachzuweisen, dass sie zur Anlage in diese Anteile berechtigt sind.

Informationen zu Emissions- und Rückkaufpreisen, zum Kauf und Verkauf von Wertpapieren, zur Finanzlage des Fonds und Exemplare der Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos angefordert werden bei:

AllianceBernstein Investor Services, ein Geschäftsbereich von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.  
2-4, rue Eugène Ruppert  
L-2453 Luxemburg

UniCredit Bank Austria AG  
Rothschildplatz 1  
1020 Wien  
Österreich

Nordea Bank Danmark A/S  
Strandgade 3  
DK-0900 Kopenhagen C  
Dänemark

Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ)  
Kungsträdgårdsgatan 8  
SE-106 40 Stockholm  
Schweden

BNP Paribas Securities Services  
3, rue d'Antin  
75002, Paris  
Frankreich

ODDO BHF Aktiengesellschaft  
Bockenheimer Landstraße 10  
60323 Frankfurt am Main  
Deutschland

AllianceBernstein Hong Kong Limited  
39th Floor, One Island East, Taikoo Place  
18 Westlands Road, Quarry Bay  
Hongkong

BNP Paribas Securities Services SA, Milan Branch  
Via Ansperto 5  
Mailand  
Italien

Allfunds Bank, S.A. Milan Branch  
Via Santa Margherita 7  
Mailand  
Italien

Société Générale Securities Services S.p.A.  
Santa Chiara 19  
Turin  
Italien

BANCA SELLA HOLDING S.p.A.  
Piazza Gaudenzio Sella 1  
I-13900 Biella  
Italien

CACEIS Bank Luxembourg Zweigniederlassung Amsterdam  
De Ruyterkade 6  
1013 AA Amsterdam  
P.O. Box 192  
1000 AD Amsterdam  
Niederlande



AllianceBernstein (Singapore) Ltd.  
One Raffles Quay  
#27-11 South Tower  
Singapur 048583

Allfunds Bank, S.A.U. at C  
Estafeta n° 6 (La Moraleja),  
Complejo Pza. de la Fuente- Edificio 3  
28109, Alcobendas (Madrid)  
Spanien

UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s.  
Prag 4 - Michle,  
Želetavská 1525/1  
140 92, Tschechische Republik

Raiffeisenbank Austria d.d.  
Petrinjska 59  
HR-10000 Zagreb  
Kroatien

Moventum Spółka z o.o.  
21 Cybernetyki Str.  
Warschau, Polen

BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, wurde von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA als Schweizer Vertreter des Fonds zugelassen und fungiert außerdem als Zahlstelle. Der Prospekt, die Dokumente mit wesentlichen Anlegerinformationen (KIIDs), die Verwaltungsbestimmungen, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie die

Aufstellung der Käufe und Verkäufe, die der Fonds im Laufe des Geschäftsjahres getätigt hat, sind auf einfache Anfrage kostenlos beim Schweizer Vertreter, BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, CH-8002 Zürich, Schweiz erhältlich.

Das Dokument mit wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) des Fonds steht unter [www.alliancebernstein.com/go/kiid](http://www.alliancebernstein.com/go/kiid) zur Verfügung.

#### Mitteilungen an die Anteilhaber

Soweit laut Gesetzgebung und anwendbarer Bestimmungen vorgeschrieben, werden Mitteilungen an die Anteilhaber im *Recueil Electronique des Sociétés et Associations* (ehemals *Mémorial*) sowie in der/den anderen Tageszeitung(en) in den Ländern veröffentlicht, die die Verwaltungsgesellschaft von Zeit zu Zeit festlegen kann.

#### Veränderungen des Wertpapierbestands

Während des Geschäftsjahres erfolgte Änderungen des Anlageportfolios werden den Anteilhabern am Hauptsitz der Verwaltungsgesellschaft kostenlos zur Verfügung gestellt.

#### Richtlinie zu umstrittenen Waffen

Die Verwaltungsgesellschaft sorgt dafür, dass Unternehmen weltweit auf ihre betriebliche Verwicklung in Tretminen, Streumunition und/oder Uranmunition überprüft werden. Wenn eine solche betriebliche Verwicklung bestätigt wurde, ist es die Richtlinie der Verwaltungsgesellschaft, dem Fonds die Anlage in Wertpapiere, die von solchen Unternehmen begeben werden, nicht zu gestatten.

#### Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die Security Financing Transaction Regulation (die „SFTR“) legt neue Anforderungen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps fest.

Wertpapierfinanzierungsgeschäft wird in Artikel 3(11) des SFTR folgendermaßen definiert:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- Wertpapier- oder Rohstoffleihe;
- ein Kauf-/Rückverkaufsgeschäft oder Verkaufs-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Margenleihgeschäft.

Zum 28. Februar 2021 war der Fonds in Wertpapierleihgeschäften engagiert und hielt Total-Return-Swaps (TRS), die als Transaktionstyp unter die SFT-Verordnung fallen.

#### Allgemeine Angaben

Zum 28. Februar 2021 belief sich das Vermögen über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps hinweg auf folgende Beträge:

#### Global Equity Blend Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$1,032,798	0.88%	1.81%

#### Global Value Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$9,109,580	1.73%	1.81%

#### Emerging Markets Growth Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$10,192,233	1.14%	1.81%

#### Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$3,689,027	0.95%	1.50%

#### Japan Strategic Value Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	¥171,353,442	2.09%	1.94%

#### China Low Volatility Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$27,697	0.02%	0.02%

#### Dynamic Diversified Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV
Total-Return-Swaps	\$164,632	0.19%

#### Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2021 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

Im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2021 wurden keine Barsicherheiten wiederangelegt.

**Angaben zur Konzentration**

Zum 28. Februar 2021 waren Folgende die zehn größten Emittenten der bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte erhaltenen Wertpapiersicherheiten:

*Wertpapierleihe*

**Global Equity Blend Portfolio**

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$ 585,588
2	Niederländische Regierung	\$ 498,842
3	Deutsche Regierung	\$ 9

**Global Value Portfolio**

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$ 5,165,052
2	Niederländische Regierung	\$ 4,399,927
3	Deutsche Regierung	\$ 80

**Emerging Markets Growth Portfolio**

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$ 5,957,692
2	Deutsche Regierung	\$ 3,200,111
3	Britische Regierung	\$ 2,194,082
4	Schweizer Regierung	\$ 32,278

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$ 2,091,647
2	Niederländische Regierung	\$ 1,781,800
3	Deutsche Regierung	\$ 32

**Japan Strategic Value Portfolio**

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Deutsche Regierung	¥ 142,978,164
2	Französische Regierung	¥ 33,373,529
3	Niederländische Regierung	¥ 1,784,779
4	US-Regierung	¥ 1,784,733

**China Low Volatility Equity Portfolio**

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Deutsche Regierung	\$ 23,848
2	Französische Regierung	\$ 5,234

*Total-Return-Swaps*

Zum 28. Februar 2021 wurden keine Wertpapiersicherheiten für Total-Return-Swaps erhalten.

Zum 28. Februar 2021 waren Folgende die zehn größten Gegenparteien bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps:

**Global Equity Blend Portfolio**

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	JPMorgan	\$ 1,032,798

**Global Value Portfolio**

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	JPMorgan	\$ 9,109,580

**Emerging Markets Growth Portfolio**

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Barclays	\$ 10,192,180
	2	UBS AG	\$ 53

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	JPMorgan	\$ 3,689,027

**Japan Strategic Value Portfolio**

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Citigroup Global Markets Limited	¥ 161,910,068
	2	Merrill Lynch	¥ 9,443,374

**China Low Volatility Equity Portfolio**

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Citigroup Global Markets Limited	\$ 27,697

**Dynamic Diversified Portfolio**

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	Morgan Stanley	\$ 173,137
	2	UBS AG	\$ (8,505)

**Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten**

*Wertpapierleihe*

Zum 28. Februar 2021 wurden die erhaltenen Sicherheiten bei zwei Depotbanken gehalten:

**Global Equity Blend Portfolio**

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 1,084,439

**Global Value Portfolio**

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 9,565,059

**Emerging Markets Growth Portfolio**

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 9,190,022
CREST	Wertpapiersicherheit	\$ 2,194,082
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$ 59

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 3,873,479

**Japan Strategic Value Portfolio**

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	¥178,136,472
US-Notenbank	Wertpapiersicherheit	¥ 1,784,733

**China Low Volatility Equity Portfolio**

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 29,082

*Total-Return-Swaps*

Zum 28. Februar 2021 wurden keine Wertpapier- und Barsicherheiten für Total-Return-Swaps erhalten.

**Verwahrung der gewährten Sicherheiten**

*Total-Return-Swaps*

Zum 28. Februar 2021 wurden keine Wertpapier- und Barsicherheiten für Total-Return-Swaps gewährt.

**Erträge/Kosten**

Zum 28. Februar 2021 belaufen sich die Erträge und Kosten für alle Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total-Return-Swaps auf Folgendes:

*Wertpapierleihe*

**Global Equity Blend Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 2,396	80%
Für dritte Partei	\$ 599	20%

**Global Value Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 18,564	80%
Für dritte Partei	\$ 4,641	20%

**Emerging Markets Growth Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 111,288	80%
Für dritte Partei	\$ 27,822	20%

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 2,823	80%
Für dritte Partei	\$ 706	20%

**Japan Strategic Value Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	¥ 290,348	80%
Für dritte Partei	¥ 72,587	20%

**China Low Volatility Equity Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 2,359	80%
Für dritte Partei	\$ 590	20%

*Total-Return-Swaps*

**Dynamic Diversified Portfolio**

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$ 1,300,344	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$ 1,480,314	100%

**Global High Yield Portfolio**

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$ 7,613,729	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$ 19,730,226	100%

\* Die Erträge (Kosten) werden während des Berichtszeitraums als realisierte Gewinne (Verluste), Änderung der unrealisierten Gewinne (Verluste) und erhaltene (gezahlte) Zinsen auf Total-Return-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte verbucht.

\*\* Alle Renditen aus OTC-Derivatgeschäften fließen dem Portfeuille zu und unterliegen keinen Gewinnaufteilungsvereinbarungen.

**Zusammenfassende Transaktionsangaben**

Zum 28. Februar 2021 besitzen die verschiedenen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Returns-Swaps folgende Fälligkeiten:

*Wertpapierleihe*

**Global Equity Blend Portfolio**

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$1,032,798

**Global Value Portfolio**

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$9,109,580

**Emerging Markets Growth Portfolio**

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$10,192,233

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$3,689,027

**Japan Strategic Value Portfolio**

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	¥0
Ein Tag bis eine Woche	¥0
Eine Woche bis ein Monat	¥0
Ein bis drei Monate	¥0
Drei Monate bis ein Jahr	¥0
Mehr als ein Jahr	¥0
Offene Laufzeit	¥171,353,442

**China Low Volatility Equity Portfolio**

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$27,697

*Total-Return-Swaps*

**Dynamic Diversified Portfolio**

<b>Fälligkeit</b>	<b>Betrag</b>
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$169,973
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$(8,505)
Mehr als ein Jahr	\$3,164
Offene Laufzeit	\$0

Zum 28. Februar 2021 kommen folgende Abrechnungs- und Clearing-Mechanismen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps zum Einsatz:

*Wertpapierleihe*

**Global Equity Blend Portfolio**

<b>Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus</b>	<b>Betrag</b>
Tri-party	\$1,032,798

**Global Value Portfolio**

<b>Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus</b>	<b>Betrag</b>
Tri-party	\$9,109,580

**Emerging Markets Growth Portfolio**

<b>Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus</b>	<b>Betrag</b>
Tri-party	\$10,192,233

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

<b>Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus</b>	<b>Betrag</b>
Tri-party	\$3,689,027

**Japan Strategic Value Portfolio**

<b>Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus</b>	<b>Betrag</b>
Tri-party	¥171,353,442

**China Low Volatility Equity Portfolio**

<b>Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus</b>	<b>Betrag</b>
Tri-party	\$27,697

*Total-Return-Swaps*

**Dynamic Diversified Portfolio**

<b>Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus</b>	<b>Betrag</b>
Bilateral	\$164,632

Die zusammenfassenden Transaktionsangaben für Sicherheitspositionen (einschließlich Barmittel), die zum 28. Februar 2021 für sämtliche Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps erhalten wurden, lauten folgendermaßen:

*Wertpapierleihe*

**Global Equity Blend Portfolio**

<b>Gegenpartei</b>	<b>Art der Sicherheit</b>	<b>Betrag</b>	<b>Qualität*</b>	<b>Laufzeit der Sicherheit</b>	<b>Währung der Sicherheit</b>	<b>Sitzland der Gegenpartei</b>
JPMorgan	Niederländische Staatsanleihe 1.75%, 07/15/2023	\$195,199	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Französische Staatsanleihe 3.25%, 10/25/2021	\$195,198	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Niederländische Staatsanleihe 0.25%, 07/15/2025	\$195,197	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Französische Staatsanleihe 0.75%, 11/25/2028	\$195,196	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2025	\$195,194	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2024	\$108,446	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2026	\$9	AAA	>1 Jahr	€	USA

\* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

**Global Value Portfolio**

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
JPMorgan	Niederländische Staatsanleihe 1.75%, 07/15/2023	\$1,721,708	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Französische Staatsanleihe 3.25%, 10/25/2021	\$1,721,705	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Niederländische Staatsanleihe 0.25%, 07/15/2025	\$1,721,697	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Französische Staatsanleihe 0.75%, 11/25/2028	\$1,721,682	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2025	\$1,721,665	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2024	\$956,522	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2026	\$80	AAA	>1 Jahr	€	USA

\* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

**Emerging Markets Growth Portfolio**

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Barclays	Französische Staatsanleihe 0.00%, 02/25/2026	\$2,049,138	AA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 03/22/2024	\$2,049,124	AA	>1 Jahr	£	Großbritannien
Barclays	Französische Staatsanleihe 5.50%, 04/25/2020	\$2,049,112	AA	Weniger als ein Monat	€	Großbritannien
Barclays	Deutsche Schatzanweisung 0.00%, 09/29/2021	\$1,700,928	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 11/04/2021	\$1,477,560	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/08/2022	\$626,374	AAA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 11/15/2027	\$303,619	AAA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Französische Staatsanleihe 1.00%, 05/25/2027	\$298,480	AA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/10/2025	\$266,003	AAA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.00%, 04/22/2024	\$144,958	AA	>1 Jahr	£	Großbritannien
Barclays	Deutsche Staatsanleihe 4.75%, 07/04/2028	\$120,841	AAA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 12/10/2021	\$115,244	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2023	\$83,369	AA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/04/2028	\$67,075	AAA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Staatsanleihe der Schweizerischen Eidgenossenschaft 0.00%, 06/22/2029	\$32,278	AAA	>1 Jahr	CHF	Großbritannien
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 1.00%, 08/15/2024	\$11	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.00%, 02/25/2022	\$11	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 5.63%, 01/04/2028	\$10	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 2.25%, 10/25/2022	\$8	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2024	\$8	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.75%, 11/25/2028	\$6	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 02/15/2026	\$6	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz

\* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
JPMorgan	Französische Staatsanleihe 3.25%, 10/25/2021	\$697,224	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Niederländische Staatsanleihe 1.75%, 07/15/2023	\$697,224	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Niederländische Staatsanleihe 0.25%, 07/15/2025	\$697,221	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Französische Staatsanleihe 0.75%, 11/25/2028	\$697,215	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2025	\$697,208	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2024	\$387,355	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2026	\$32	AAA	>1 Jahr	€	USA

\* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

**Japan Strategic Value Portfolio**

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/10/2025	¥30,600,393	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2030	¥30,599,507	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2025	¥30,596,154	AA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Schatzanweisung 0.00%, 02/23/2022	¥30,594,576	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/08/2021	¥30,588,474	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/14/2023	¥17,026,555	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.25%, 11/25/2026	¥1,784,786	AA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2027	¥1,784,779	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 12/31/2025	¥1,784,733	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 05/15/2023	¥1,784,660	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 3.25%, 07/04/2021	¥1,783,999	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2024	¥992,589	AA	>1 Jahr	€	USA

\* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

**China Low Volatility Equity Portfolio**

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2030	\$5,234	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/10/2025	\$5,234	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Schatzanweisung 0.00%, 02/23/2022	\$5,234	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2025	\$5,234	AA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/08/2021	\$5,233	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/14/2023	\$2,913	AAA	>1 Jahr	€	USA

\* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.



**VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

**AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.**  
 2-4, rue Eugène Ruppert  
 L-2453 Luxemburg  
 RCS: B34405

**VERWALTUNGSRAT DER  
 VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

**Silvio Cruz**  
**Yves Prussen**  
**Bertrand Reimmel**  
**Steven Eisenberg**  
**Mark Manley**

**ANLAGEVERWALTER\***

**AllianceBernstein L.P.**  
 1345 Avenue of the Americas  
 New York, New York 10105  
 Vereinigte Staaten von Amerika

**VERWALTUNGSSTELLE\* UND VERWAHRSTELLE**

**Brown Brothers Harriman  
 (Luxembourg) S.C.A.**  
 80, Route d'Esch  
 L-1470 Luxemburg

**REGISTER- UND TRANSFERSTELLE**

**AllianceBernstein Investor Services**  
 ein Geschäftsbereich von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.  
 2-4, rue Eugène Ruppert  
 L-2453 Luxemburg

**VERTRIEBSSTELLE**

**AllianceBernstein Investments**  
 ein Geschäftsbereich von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.  
 2-4, rue Eugène Ruppert  
 L-2453 Luxemburg

**UNABHÄNGIGER WIRTSCHAFTSPRÜFER**

**Ernst & Young S.A.**  
 35E, Avenue John F. Kennedy  
 L-1855 Luxemburg

**RECHTSBERATER**

*In Luxemburg*

**Elvinger Hoss Prussen, société anonyme**  
 2, place Winston Churchill  
 B.P. 425  
 L-2014 Luxemburg

*In den Vereinigten Staaten*

**Dechert LLP**  
 One International Place  
 40<sup>th</sup> Floor  
 100 Oliver Street  
 Boston, MA 02110-2605  
 Vereinigte Staaten von Amerika

\* Von der Verwaltungsgesellschaft delegiert.

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)



**ALLIANCEBERNSTEIN®**